

证券代码：000035

证券简称：中国天楹

公告编号：TY2024-64

中国天楹股份有限公司

关于开展外汇套期保值类金融衍生品交易业务的公告

本公司及董事会全体成员保证本公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

重要内容提示：

1、交易种类：中国天楹股份有限公司（以下简称“公司”）计划开展的外汇套期保值类金融衍生品交易业务主要包括远期、掉期、期权等产品或上述产品的组合。

2、交易金额：公司计划以银行敞口授信额度开展的外汇套期保值类金融衍生品交易业务金额不超过 600 万美元或其他等值外币。额度使用期限自董事会审议通过之日起 12 个月内有效，上述额度在决议有效期内可循环滚动使用，额度使用期限内任一时点的交易余额不超过已审议额度。

3、履行程序：公司于 2024 年 10 月 30 日召开第九届董事会第八次会议和第九届监事会第五次会议，审议并通过了《关于开展外汇套期保值类金融衍生品交易业务的议案》。该事项不涉及关联交易，属于公司董事会决策权限，无需提交股东大会审议。

4、风险提示：公司计划开展的外汇套期保值类金融衍生品业务以海外业务拓展为背景，充分利用金融衍生品交易的套期保值功能，有助于降低汇率市场风险对公司业务经营的影响，增强公司财务稳健性，保证公司经营业绩的相对稳定。但衍生品交易业务操作过程中仍存在一定的市场风险、内部控制风险、流动性风险、履约风险以及法律风险等，敬请广大投资者注意投资风险。

一、开展外汇套期保值类金融衍生品交易业务概述

1、交易背景与目的：在“环保+新能源”双引擎和“国际+国内双循环”发展战略引领下，公司在深耕国内环保与新能源业务市场的同时，充分发挥自身先进的垃圾焚烧发电技术、高端环保设备制造与研发能力以及丰富的项目建设与运营经验等核心优势，积极开展“一带一路”共建合作，已先后在越南、新加坡、

印度尼西亚等一带一路国家落地多座垃圾焚烧发电项目并成功将环保装备推向国际市场。

随着“国际+国内双循环”发展战略的深入推进，公司海外经营与外汇业务规模日益扩大，加之外汇市场的波动日益频繁，汇率波动对公司经营成果的影响也逐渐加大。为降低汇率市场风险对公司业务经营的影响，增强公司财务稳健性，保证公司经营业绩的相对稳定，公司计划开展外汇套期保值类金融衍生品交易业务。

公司计划开展的外汇套期保值类金融衍生品交易业务将遵循合法、谨慎、安全、有效的原则，所有金融衍生品交易以套期保值、规避和防范利率、汇率风险为目的，不影响公司正常生产经营，不进行投机和套利交易。

2、交易金额：公司计划以银行敞口授信额度开展的外汇套期保值类金融衍生品交易业务金额不超过 600 万美元或其他等值外币。额度使用期限自董事会审议通过之日起 12 个月内有效，上述额度在决议有效期内可循环滚动使用，额度使用期限内任一时点的交易余额不超过已审议额度。

3、交易方式：公司计划开展的外汇套期保值类金融衍生品交易业务的交易对手方均为经营稳健、资信良好、与公司合作关系稳定、具有金融衍生品交易业务经营资格的商业银行、证券公司等金融机构。交易种类主要包括远期、掉期、期权等产品或上述产品的组合。

4、交易期限：自董事会审议通过之日起 12 个月内有效，上述额度在决议有效期内可循环滚动使用。

5、资金来源：公司计划开展的外汇套期保值类金融衍生品交易业务的资金来源为公司自有资金或银行授信，不存在直接或间接使用募集资金从事该业务的情形。

二、审议程序

1、董事会意见

公司于 2024 年 10 月 30 日召开第九届董事会第八次会议，审议并通过了《关于开展外汇套期保值类金融衍生品交易业务的议案》，同意公司开展外汇套期保值类金融衍生品交易业务，额度不超过 600 万美元或其他等值外币。额度使用期限自本次董事会审议通过之日起 12 个月内有效，上述额度在决议有效期内可循环滚动使用。

同时为提高公司外汇套期保值类金融衍生品交易业务办理效率，董事会授权公司经营管理层在前述额度和有效期内审批公司日常外汇套期保值类金融衍生品交易业务具体操作方案、签署相关协议及文件等。

2、监事会意见

公司于2024年10月30日召开第九届监事会第五次会议，审议并通过了《关于开展外汇套期保值类金融衍生品交易业务的议案》。经认真审核，监事会认为公司计划开展的外汇套期保值类金融衍生品交易业务有利于降低汇率市场风险对公司业务经营的影响，增强公司财务稳健性，保证公司经营业绩的相对稳定，符合公司谨慎、稳健的风险管理原则和生产经营的实际需要。公司开展外汇套期保值类金融衍生品交易业务事项的相关决策程序符合相关法律法规的规定，不存在损害公司及其股东特别是中小股东利益的情形。监事会同意公司开展外汇套期保值类金融衍生品交易业务。

三、交易风险分析及风控措施

（一）风险分析

1、市场风险：可能产生因标的利率、汇率等市场价格波动而造成金融衍生品价格变动而造成亏损的风险。

2、内部控制风险：外汇套期保值类金融衍生品交易业务专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内部控制机制不完善而造成风险。

3、流动性风险：因市场流动性不足而无法完成交易的风险。

4、履约风险：开展外汇套期保值类金融衍生品交易存在合约到期无法履约造成违约而带来的风险。

5、法律风险：因相关法律发生变化或交易对手违反相关法律制度可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失。

（二）风控措施

1、公司将选择结构简单、风险可控、流动性强的金融衍生品开展业务，以规避和防范汇率风险和利率风险。

2、公司将审慎选择交易对手和金融衍生产品，与具有合法资质的大型商业银行等金融机构开展金融衍生品交易业务，最大程度降低信用风险。

3、公司已经制定了《证券投资、衍生品交易与委托理财管理制度》，对公

司衍生品交易业务的风险控制、审议程序、后续管理等作出明确规定。公司成立由财务总监等相关负责人组成的工作小组，负责具体外汇套期保值类金融衍生品交易业务。

4、公司严格执行金融衍生品业务操作流程和审批权限，配备专职人员，明确岗位责任，严格遵守在授权范围内从事外汇套期保值类金融衍生品交易业务；同时加强相关人员的业务培训及职业道德，提高相关人员素质，发现异常情况及时报告，最大限度的规避操作风险的发生。

5、公司设专人对持有的金融衍生品合约持续监控，在市场波动剧烈或风险增大情况下，或导致发生重大浮盈浮亏时及时报告公司决策层，并及时制订应对方案。

6、公司不断加强对银行账户和资金的管理，严格管理资金划拨和使用的审批程序。

7、公司聘任的审计机构和内部审计部门定期对外汇套期保值类金融衍生品交易业务套期保值的规范性、内控机制的有效性、信息披露的真实性等方面进行监督检查。

四、交易相关会计处理

公司根据《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》《企业会计准则第 24 号—套期会计》《企业会计准则第 39 号—公允价值计量》等相关规定及其指南，对计划开展的外汇套期保值类金融衍生品交易业务进行相应的核算处理，反映资产负债表及损益表相关项目。公司将在定期报告中对已经开展的衍生品交易相关信息予以披露。

五、备查文件

- 1、第九届董事会第八次会议决议；
- 2、第九届监事会第五次会议决议；
- 3、关于开展外汇套期保值类金融衍生品交易业务的可行性分析报告。

特此公告。

中国天楹股份有限公司董事会

2024 年 10 月 31 日