

株洲时代新材料科技股份有限公司 关于公司 2022 年度金融衍生品交易预计额度的 公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实、准确和完整承担个别及连带责任。

2022 年 3 月 29 日，株洲时代新材料科技股份有限公司（以下简称“公司”）第九届董事会第十二次会议审议通过了《关于公司 2022 年度金融衍生品交易预计额度的议案》，同意公司申请年度金融衍生业务额度折合人民币约为 9.3 亿元，该议案无需提交公司股东大会审议。具体内容如下：

一、拟开展金融衍生品交易业务的背景

为有效规避汇率风险，减少汇率波动对公司跨国经营活动产生不利影响，在遵守国家政策法规的前提下，运用合适的金融衍生工具管理汇率波动导致的利润波动风险，以保障财务安全性和核心业务盈利能力、增强公司的市场内竞争力。

二、拟开展金融衍生品交易业务的概述

公司拟申请的年度金融衍生业务额度折合人民币约为 9.3 亿元。其中美元外汇敞口 7,024 万美元，欧元外汇敞口 6,214 万欧元。

以上额度的设定，均依据对汇率风险敞口金额的测算，实际执行时将以届时风险敞口金额为上限，本公司没有任何使用杠杆工具放大上述业务交易规模的计划。

衍生品交易业务的具体管理原则如下：

（一）秉持汇率风险中性原则，尽可能降低汇率波动对主营业务以及企业财务的负面影响；

（二）套期保值以真实业务为基础，以锁定收汇汇率为目标，不以获取投资收益为目的；

(三) 金融衍生业务与真实业务品种相同或相近、期限匹配、方向相反、数量相当。

三、拟开展金融衍生品交易业务的品种

本公司拟选用定价和市价易于计算、风险能有效评估的外汇远期、掉期、期权等简单易管理的金融衍生产品。

四、拟开展金融衍生品交易业务的交易对手

拟交易对手范围包括公司所合作的低信用风险的金融机构，如：中国银行、工商银行、建设银行、农业银行、招商银行等。

五、金融衍生品交易业务的风险提示

(一) 市场风险：当汇率波动使公司发生收入降低、成本上升、资产缩水、负债增加等损失的风险；

(二) 操作风险：由于不完善或有问题的内部操作过程、人员、系统而导致金融衍生业务损失的风险；

(三) 信用风险：选定的金融衍生交易对手未能履行金融衍生业务合同所规定的义务和信用质量发生变化，而导致的直接或间接损失的风险；

(四) 财务风险：因配套资金规模安排不当，当市场价格出现剧烈波动或金融衍生业务出现亏损时，由于保证金账户中资金无法维持金融衍生工具头寸，而导致被强制平仓的风险。

六、拟采取的风险控制措施

(一) 明确金融衍生工具的使用目的和原则。坚持以套期保值为目的，合理管理金融衍生工具持仓规模。在交易工具的使用上严格遵循交易配比、反向对冲，平衡损益、简单性和系统性等交易原则；

(二) 根据国家有关法律法规、公司章程和公司授权手册等相关规定，强化本公司外汇风险内部管控体系建设，建立健全金融衍生工具交易管理制度办法和流程，清晰界定业务交易审批和执行层面的权责划分，严格分离内控、交

易、会计核算岗位人员，确保每一笔金融衍生工具业务交易的合规性和有效性；

（三）审慎选择交易对手及代理机构，全面分析资信情况，选择信誉良好、实力雄厚、经营规范、与公司保持长期合作关系的交易对手及代理机构；

（四）建立财务风险实时监控机制。

七、对公司的影响

公司拟开展的衍生品交易业务是基于公司实际情况，为有效规避汇率风险，减少汇率波动对公司跨国经营活动产生不利影响为目的，符合公司生产经营的实际需要。公司会根据当前市场汇率走势和波动性预期，择机在预计额度范围内开展金融衍生工具交易业务。

八、独立董事意见

在董事会审议关于公司 2022 年度金融衍生品交易预计额度的议案时，公司独立董事发表了明确同意的独立意见，认为公司开展的衍生品交易业务是基于公司实际情况，为有效规避汇率风险，减少汇率波动对公司跨国经营活动产生不利影响为目的，符合公司生产经营的实际需要，符合有关法律法规的要求，符合全体股东及上市公司利益；全体独立董事一致同意上述议案。

九、监事会意见

监事会认为公司开展的衍生品交易业务是基于公司实际情况，为有效规避汇率风险，减少汇率波动对公司跨国经营活动产生不利影响为目的，符合公司生产经营的实际需要，符合有关法律法规的要求，符合全体股东及上市公司利益；监事会成员一致同意上述议案。

特此公告。

株洲时代新材料科技股份有限公司董事会

2022 年 3 月 31 日