

证券代码：600169

证券简称：太原重工

公告编号：2024-023

## 太原重工股份有限公司

### 关于开展金融衍生品套期保值业务的公告

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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

太原重工股份有限公司（以下简称“公司”）于2024年4月19日召开第九届董事会第七次会议，审议通过《关于金融衍生品套期保值方案的议案》。为降低公司外汇业务汇率风险，公司拟开展以套期保值为目的金融衍生品交易业务，在4.5亿元人民币或其他等值外币金额内循环操作。

#### 一、开展金融衍生品交易业务目的及必要性

由于公司目前进口主要以欧元结算，出口主要以美元结算，受国内外环境综合因素影响，欧元、美元汇率波动明显。在2023年，美联储货币政策持续收紧，美元资产受到追捧，美元指数频繁出现短线上涨行情，“蝴蝶效应”下，人民币等多国货币对美元出现贬值。同时，欧元兑人民币汇率也大幅升值，并在2023年7月19日创出了三年多的新高1:8.1014，全年欧元兑人民币升值6.7%，远超离岸市场美元兑人民币的升值幅度（2.6%）。

为有效应对汇兑风险，公司和控股子公司拟开展金融衍生品交易业务，用于锁定成本、规避汇率风险，主要挑选与主业经营密切相关的简单金融衍生产品，且要求衍生产品与业务背景的品种、规模、方向、期限相匹配，符合公司谨慎、稳健的风险管理原则。

#### 二、金融衍生品交易业务的品种

公司拟操作的金融衍生品包括但不限于远期结售汇、期权、货币及利率互换或上述产品的组合。

#### 三、金融衍生品交易业务计划

1. 额度及有效期：不超过4.5亿元人民币或其他等值外币，自董事会审议批准之后12个月内循环操作。

2. 业务期限：单一金融衍生品期限不超过其所对应基础资产期限。

#### **四、金融衍生品投资的主要条款**

1.交易对手：银行类金融机构。

2.流动性安排：所有金融衍生品交易业务均对应正常合理的进出口业务和外币借款，与收付款时间相匹配，相关外汇资金衍生品交易将主要采用银行授信的方式进行操作，不会对公司的流动性造成影响。

#### **五、风险分析**

1.市场风险：公司及控股子公司开展与主营业务相关的金融衍生品业务，当国际和国内经济形势发生变化时，相应的汇率、利率等市场价格波动将可能对公司金融衍生品交易产生影响，当到期时汇率、利率与预期存在偏差时，存在丧失机会收益的风险。

2.流动性风险：公司拟开展的金融衍生品业务性质简单，交易的期限均根据公司未来的收付款预算进行操作，基本在一年以内，对公司流动性没有影响。

3.信用风险：公司在开展衍生品交易业务时，存在一方合同到期无法履约的风险。

4.操作风险：公司在开展衍生品交易业务时，如发生操作人员未按规定程序报备及审批，或未准确、及时、完整地记录金融衍生品业务信息，将可能导致衍生品业务损失或丧失交易机会。

5.法律风险：公司开展衍生品交易业务时，存在交易人员未能充分理解交易合同条款和产品信息，导致经营活动不符合法律规定或者外部法律事件而造成的交易损失。

#### **六、风险控制措施**

1.选择结构简单、流动性强、风险可控的金融衍生工具开展套期保值业务。

2.严格控制金融衍生品的交易规模，公司只能在董事会授权额度内进行以套期保值为目的的衍生品交易。

3.制定规范的业务操作流程和授权管理体系，配备专职人员，明确岗位职责，严格在授权范围内从事衍生品交易业务；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，并建立异常情况及时报告制度，最大限度的规避操作风险的发生。

4.加强对银行账户和资金的管理，严格遵守资金划拨和使用的审批程序。

5.选择恰当的风险评估模型和监控系统，持续监控和报告各类风险，在市场

波动剧烈或风险增大情况下，增加报告频度，并及时制订应对预案。

6.公司定期对金融衍生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。

### **七、审议程序**

该事项经公司 2024 年 4 月 19 日召开的第九届董事会第七次会议审议通过，无需提交公司股东大会审议。

### **八、董事会审计与风控委员会关于本次金融衍生品套期保值业务的意见**

董事会审计与风控委员会认为：公司拟开展以套期保值为目的的金融衍生品交易业务是基于正常生产经营行为，以合理规避汇率风险为目的而开展的，不存在损害公司及全体股东特别是中小股东利益的情形。公司的审议程序符合法律、法规及《公司章程》的有关规定。在风险控制的条件下，同意公司在本次董事会审议的额度和期限内开展金融衍生品套期保值业务。

特此公告。

附：《太原重工股份有限公司关于开展金融衍生品交易业务的可行性分析报告》

太原重工股份有限公司董事会

2024 年 4 月 23 日