

天津久日新材料股份有限公司

关于继续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、准确性和完整性依法承担法律责任。

天津久日新材料股份有限公司（以下简称公司）于2021年6月17日召开了公司第四届董事会第十二次会议、第四届监事会第九次会议，审议通过了《关于开展金融衍生品套期保值业务的议案》，同意公司及全资子公司天津久源新材料技术有限公司（以下简称久源技术）开展金融衍生品套期保值业务，实现以规避风险为目的的资产保值，降低汇率波动对公司的影响。公司及全资子公司久源技术拟开展的金融衍生品套期保值业务包括外币远期结售汇、外汇期权等业务，主要外币币种为美元，资金来源为公司自有资金，预计不超过5,000.00万美元（含5,000.00万美元）。有效期自公司董事会审议通过之日起12个月内有效。具体内容详见公司于2021年6月19日披露于上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）的《天津久日新材料股份有限公司关于开展金融衍生品套期保值业务的公告》（公告编号：2021-031）。

鉴于上述授权期限即将到期，公司于2022年6月10日召开第四届董事会第二十一次会议，以9票同意、0票反对、0票弃权的表决结果审议通过《关于继续开展金融衍生品套期保值业务的议案》；于同日召开第四届监事会第十八次会议，以3票同意、0票反对、0票弃权的表决结果审议通过《关于继续开展金融衍生品套期保值业务的议案》，同意公司及全资子公司久源技术继续开展金融衍生品套期保值业务，实现以规避风险为目的的资产保值，降低汇率波动对公司的影响。公司及全资子公司久源技术拟继续开展的金融衍生品套期保值业务包括外币远期结售汇、外汇期权、利率互换等业务，主要外币币种为美元，资金来源为公司自有资金，预计不超过5,000.00万美元（含5,000.00万美元）。有效期自公司董事会审议通过之日起12个月内有效。同时，为提高工作效率，保证后续工作的顺利开展，授权

公司董事长在余额不超过 5,000 万美元（含 5,000.00 万美元）额度范围内行使金融衍生品套期保值业务的审批权限并签署相关文件，在额度范围内资金可滚动使用，由公司财务中心负责具体实施相关事宜。该事项在董事会审批权限范围内，无需提交股东大会审批。公司独立董事发表了明确同意的独立意见，保荐机构招商证券股份有限公司对本事项出具了明确的核查意见。

一、继续开展金融衍生品套期保值业务的必要性

由于公司业务有一半以上来自国际市场，公司的出口业务占公司业务比例较大，主要采用美元等外币进行结算，外币汇率波动对公司经营成果的影响日益加大。为减少汇率波动带来的风险，提高外汇资金使用效率，合理降低财务费用，公司及全资子公司久源技术拟继续开展金融衍生品套期保值业务，实现以规避风险为目的的资产保值，降低汇率波动对公司的影响。

二、拟继续开展的金融衍生品套期保值业务的情况

（一）业务品种

结合资金管理要求和日常经营需要，公司及全资子公司久源技术拟继续开展的金融衍生品套期保值业务包括外币远期结售汇、外汇期权、利率互换等业务。

（二）业务规模、业务期限及投入资金来源

公司及全资子公司久源技术拟继续开展的金融衍生品套期保值业务主要外币币种为美元，资金来源为公司自有资金，预计不超过 5,000.00 万美元（含 5,000.00 万美元）。有效期自公司董事会审议通过之日起 12 个月内有效。

三、继续开展金融衍生品套期保值业务的风险分析

1. 价格波动风险：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市场风险；

2. 内部控制风险：金融衍生品套期保值业务专业性较强，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：继续开展金融衍生品套期保值业务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。

四、公司拟采取的风险控制措施

1. 公司已制定《金融衍生品套期保值业务管理制度》，能有效规范金融衍生品投资行为，控制金融衍生品投资风险；
2. 选择流动性强、风险可控的金融衍生品继续开展套期保值等业务；
3. 金融衍生品套期保值业务以获取无风险收益、提高股东回报为原则，最大程度规避汇率波动带来的风险，并结合市场情况，适时调整操作及风控策略；
4. 慎重选择从事金融衍生品套期保值业务的交易对手；
5. 设专人对持有的金融衍生品套期保值业务合约持续监控，在市场剧烈波动或风险增大情况下，或导致发生重大浮盈浮亏时及时报告公司决策层，并积极应对；
6. 公司只与经国家外汇管理局和中国人民银行批准具有金融衍生品套期保值业务经营资格的金融机构进行交易，规避可能产生的法律风险。

五、业务授权

为提高工作效率，保证后续工作的顺利开展，公司董事会授权公司董事长在余额不超过 5,000.00 万美元（含 5,000.00 万美元）额度范围内行使金融衍生品套期保值业务的审批权限并签署相关文件，在额度范围内资金可滚动使用，由公司财务中心负责具体实施相关事宜。

六、审议程序

2022 年 6 月 10 日，公司召开第四届董事会第二十一次会议，以 9 票同意、0 票反对、0 票弃权的表决结果审议通过《关于继续开展金融衍生品套期保值业务的议案》；并于同日召开第四届监事会第十八次会议，以 3 票同意、0 票反对、0 票弃权的表决结果审议通过《关于继续开展金融衍生品套期保值业务的议案》。

七、独立董事意见

经核查，我们认为：公司及全资子公司天津久源新材料技术有限公司继续开展金融衍生品套期保值业务将有利于实现以规避风险为目的的资产保值，降低汇率波动对公司的影响，不存在损害公司及投资者利益的情况。

因此，我们同意《关于继续开展金融衍生品套期保值业务的议案》。

八、保荐机构意见

经核查，保荐机构认为：

公司及全资子公司天津久源新材料技术有限公司继续开展金融衍生品套期保值业务有利于公司降低汇率波动带来的风险，提高外汇资金使用效率，合理降低财务费用，实现以规避风险为目的的资产保值，已经履行了必要的审批程序，审批程

序符合相关法律、法规及久日新材《公司章程》的规定。基于上述核查，保荐机构对公司及全资子公司久源技术继续开展金融衍生品套期保值业务无异议。

特此公告。

天津久日新材料股份有限公司董事会

2022年6月11日