

证券代码：603867

证券简称：新化股份

公告编号：2026-023

浙江新化化工股份有限公司 关于开展外汇衍生品交易的公告

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法律责任。

重要内容提示：

● 交易主要情况

交易目的	<input type="checkbox"/> 获取投资收益 <input checked="" type="checkbox"/> 套期保值（合约类别： <input type="checkbox"/> 商品； <input checked="" type="checkbox"/> 外汇； <input type="checkbox"/> 其他：_____） <input type="checkbox"/> 其他：_____	
交易品种	远期结售汇、人民币和其他外汇的掉期业务、远期外汇买卖、外汇掉期、外汇期权、利率互换、利率掉期、利率期权等或上述产品的组合。	
交易金额	预计动用的交易保证金和权利金上限（单位：万元）	800
	预计任一交易日持有的最高合约价值（单位：万元）	10000
资金来源	<input checked="" type="checkbox"/> 自有资金 <input type="checkbox"/> 借贷资金 <input type="checkbox"/> 其他：___	
交易期限	2026年6月23日至2027年6月22日	

● 已履行及拟履行的审议程序

浙江新化化工股份有限公司（以下简称“公司”）于2026年6月22日召开了第七届董事会第二次会议审议通过了《关于开展外汇衍生品交易的议案》。本次开展外汇衍生品交易事项无需提交公司股东会审议。

● 特别风险提示

公司及子公司开展外汇衍生品交易业务遵循锁定汇率风险、套期保值的原则，不进行投机和非法套利，但在外汇衍生品交易业务开展过程中仍可能存在一定的

市场风险、操作风险、流动性风险及法律风险，敬请广大投资者注意投资风险。

一、交易情况概述

（一）交易目的

公司主要产品存在一定规模的出口业务，日常经营中以外币结算的销售收入面临汇率波动风险。为有效规避汇率大幅波动对公司经营业绩的不利影响，提高外汇资金使用效率，公司及子公司拟适度运用远期结汇等外汇衍生品工具，对日常经营产生的外币收付款进行套期保值。

外汇衍生品交易与公司主营业务紧密相关，系公司出口业务中客观存在的汇率风险敞口，具有明确的套期保值基础。公司已制定《证券投资、期货与衍生品交易管理制度》，明确了决策程序、风险控制措施及信息披露要求，具备开展相关交易的制度保障和操作能力。

（二）交易金额

根据公司经营情况，公司及子公司预计动用的交易保证金和权利金上限（包括为交易而提供的担保物价值、预计占用的金融机构授信额度、为应急措施所预留的保证金等）为 800 万元人民币，预计任一交易日持有的最高合约价值为不超过 1.0 亿元人民币或等值外币。开展期限内任一时点的交易金额（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）不超过上述额度。在上述额度范围内资金可循环滚动使用。

（三）资金来源

公司及子公司用于开展外汇衍生品交易业务的资金为自有资金，不涉及募集资金。

（四）交易方式

公司及子公司将与经国家外汇管理局和中国人民银行批准、具有外汇衍生品交易业务资质的金融机构开展外汇衍生品交易业务。拟开展的外汇衍生品交易业

务，包括远期结售汇、人民币和其他外汇的掉期业务、远期外汇买卖、外汇掉期、外汇期权、利率互换、利率掉期、利率期权等或上述产品的组合。

（五）交易期限

交易期限为自公司第七届董事会第二次会议审议通过之日起 12 个月内。

二、审议程序

公司于 2026 年 6 月 22 日召开第七届董事会第二次会议，全票审议通过了《关于开展外汇衍生品交易业务的议案》。授权总经理在额度范围和有效期内负责签署相关协议，由公司财务部负责外汇交易业务的具体办理事宜。本次开展外汇衍生品交易事项属于公司董事会决策权限，无需提交股东会审议，不构成关联交易。

三、交易风险分析及风控措施

（一）交易风险分析

公司开展外汇衍生品交易业务遵循合法、谨慎、安全和有效的原则，不得进行投机性和单纯的套利交易，但外汇衍生品交易操作仍存在一定风险：

1.市场风险：当国际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造成公司外汇衍生品交易业务亏损的市场风险。

2.流动性风险：因业务变动等原因需提前平仓或者展期衍生金融产品，可能给公司带来一定损失，需向银行支付差价的风险。

3.操作风险：衍生品交易业务专业性较强，复杂程度高，可能会由于操作人员未及时、充分地理解衍生品信息，或者未按规定程序进行操作而造成一定风险。

4.客户违约风险：客户应收账款发生逾期，货款无法在预测的回款期内收回，可能会造成延期交割或者平仓等交易，导致公司损失。

（二）公司采取的风险控制措施

1.公司制定了《证券投资、期货与衍生品交易管理制度》，对外汇套期保值

业务的操作原则、审批权限、责任部门及责任人、内部操作流程、信息保密措施、内部风险控制程序、信息披露等作出明确规定，《证券投资、期货与衍生品交易管理制度》满足实际操作的需要，其风险控制措施是切实可行的。

2.公司将在授权额度和有效期内，择机选择交易结构简单、流动性强、风险可控的外汇衍生品交易业务，优选具有合法资质的、信用良好且与公司已建立业务往来的银行等金融机构。

3.公司将严格执行规范的业务操作流程和授权管理体系，加强对银行账户和资金的管理，严格资金划拨和使用的审批程序。

4.公司将高度重视外币应收账款管理，严格按照预测客户回款时间和金额进行交易。

四、交易对公司的影响及相关会计处理

公司本次开展外汇衍生品交易业务以日常生产经营为基础，以规避和防范汇率风险或利率风险为目的，依据实际业务的发生情况配套相应的外汇衍生品交易，有利于增强公司财务稳健性。

公司根据财政部《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 37 号——金融工具列报》《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》相关规定及其指南，对外汇衍生品交易业务进行相应的核算与会计处理。具体以年度审计结果为准。

特此公告。

浙江新化化工股份有限公司董事会

2026 年 6 月 24 日