

证券代码：920218

证券简称：新天力

公告编号：2026-073

新天力科技股份有限公司 期货及衍生品交易管理制度

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、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法律责任。

一、 审议及表决情况

本制度于 2026 年 8 月 25 日经公司第二届董事会第十二次会议审议通过，表决结果：同意 6 票、反对 0 票、弃权 0 票。无需提交股东会审议。

二、 分章节列示制度主要内容：

新天力科技股份有限公司 期货及衍生品交易管理制度

第一章 总则

第一条 为规范新天力科技股份有限公司（以下简称“公司”）期货和衍生品交易行为，强化风险控制，确保公司资金和财产的安全，维护公司与全体股东的利益，根据《中华人民共和国公司法》《中华人民共和国证券法》《上市公司信息披露管理办法》《北京证券交易所上市公司持续监管指引第 15 号——交易与关联交易》等法律法规、业务规则及《新天力科技股份有限公司对外投资管理制度》（以下简称《对外投资管理制度》）的有关规定，结合公司实际情况，制定本制度。

第二条 本制度所称期货交易是指以期货合约或者标准化期权合约作为交易标的的交易活动。

本制度所称衍生品交易是指期货交易以外，以互换合约、远期合约和非标准

化期权合约及其组合为交易标的的交易活动，包括但不限于远期结售汇、外汇期权、外汇掉期、货币互换、利率互换业务等。期货和衍生品的基础资产既可以是证券、指数、利率、汇率、货币、商品等标的，也可以是上述标的的组合。

本制度所称套期保值业务，是指为管理外汇风险、价格风险、利率风险、信用风险等特定风险而达成与上述风险基本吻合的期货和衍生品交易的活动。

第三条 本制度适用于公司及下属控股子公司（以下简称“子公司”）。子公司的期货及衍生品交易业务由公司进行统一管理。未经公司同意，子公司不得自行开展该业务。

第四条 公司及其子公司开展期货和衍生品交易除遵守国家相关法律、法规及规范性文件的规定外，还应遵守本制度的相关规定。

第二章 基本原则

第五条 公司及其子公司参与期货和衍生品交易应当遵循合法、审慎、安全、有效的原则。

第六条 公司及其子公司须具有与期货和衍生品交易相匹配的自有资金，不得使用募集资金从事期货和衍生品交易。公司应严格按照审议批准的交易额度控制公司或其子公司的交易资金规模。

第七条 公司及其子公司从事套期保值业务的期货和衍生品品种应当仅限于与公司及其子公司生产经营相关的产品、原材料和外汇等，且原则上拟开展交易的期货和衍生品在种类、规模及期限上与需管理的风险敞口相匹配。

第八条 公司及其子公司开展期货和衍生品交易应当与具有相应交易业务资质的机构（以下简称“合格机构”）进行交易，不得与不具有交易业务资质的机构或个人进行交易。

第九条 公司或子公司开展期货和衍生品交易的，必须以自身名义设立期货和衍生品交易账户，不得使用他人账户进行交易。

第三章 审批权限

第十条 公司或子公司拟从事期货和衍生品交易的，应当编制可行性分析

报告并提交董事会审议。

第十一条 期货和衍生品交易属于下列情形之一的，应当在董事会审议通过后提交股东会审议：

- （一）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，下同）占公司最近一期经审计净利润的 50%以上，且绝对金额超过 750 万元人民币；
- （二）预计任一交易日持有的最高合约价值占公司最近一期经审计净资产的 50%以上，且绝对金额超过 5000 万元人民币；
- （三）公司从事不以套期保值为目的的期货和衍生品交易。

公司或子公司因交易频次和时效要求等原因难以对每次期货和衍生品交易履行审议程序和披露义务的，可以对未来 12 个月内期货和衍生品交易的范围、额度及期限等进行合理预计并审议。相关额度的使用期限不应超过 12 个月，期限内任一时点的金额（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）不应超过已审议额度。

第四章 业务管理及内部操作流程

第十二条 公司财务部为期货和衍生品交易的管理及实施部门，财务部在授权范围内负责进行期货和衍生品交易的实际操作，并完成相应的会计核算。

第十三条 公司财务部进行期货和衍生品交易具体操作流程如下：

- （一）追踪期货及衍生品公开市场价格，及时评估已交易期货及衍生品的风险敞口变化情况，提出开展或中止期货和衍生品交易的具体方案；
- （二）根据批准的交易方案，与已选定的合格机构进行交易确认，开展相关业务；
- （三）对接合格机构获取交易清单，并于每笔交易到期交割日前及时通知和提示交割事宜；
- （四）对每笔期货和衍生品交易进行登记，及时跟踪交易变动状态，妥善安排交割资金，防范交割违约风险；
- （五）妥善保管交易记录及相关文件。

第十四条 公司审计部负责监督、审查期货及衍生品交易的实际操作情况、资金使用情况及盈亏情况，并定期向公司董事会审计委员会进行汇报。

董事会审计委员会负责审查期货和衍生品交易的必要性、合理性、可行性、对公司的影响及风险控制情况，必要时可以要求公司聘请专业机构出具可行性分析报告。

第十五条 公司证券事务部负责审核期货及衍生品交易业务决策程序的合法合规性并及时进行信息披露。

第五章 信息隔离措施

第十六条 参与公司或子公司期货和衍生品交易业务的公司内部人员及合作机构，未经允许不得泄露交易方案、交易情况、结算情况、资金状况等与公司或子公司交易有关的信息。

第十七条 参与期货和衍生品交易操作环节的公司内部人员和其他人员均相互独立，不得由单人负责业务操作的全部流程，并由公司审计部负责监督。

第六章 内部风险报告制度及风险处理程序

第十八条 公司财务部应当跟踪期货和衍生品公开市场价格或者公允价值的变化，及时评估已交易期货和衍生品的风险敞口变化情况，并向公司管理层和董事会报告期货和衍生品交易授权执行情况、交易头寸情况、风险评估结果、交易盈亏状况、止损规定执行情况等。

公司开展以套期保值为目的的期货和衍生品交易，应当及时跟踪期货和衍生品与已识别风险敞口对冲后的净敞口价值变动，对套期保值效果进行持续评估。

第十九条 公司应当制定切实可行的应急处理预案，以及时应对交易过程中可能发生的重大突发事件。公司应当针对各类期货及衍生品或者不同交易对手设定适当的止损限额或者设置亏损预警线，严格执行止损业务流程。

第二十条 止损业务流程：当市场价格波动较大或发生异常波动的情况时，财务部应立即报告财务负责人、总经理。若交易合约市值损失接近止损限额或亏损预警线的，应立即启动止损机制；如果发生强行平仓、交易所风险处置等风险

事件，财务部应立即报告财务负责人、总经理，并及时提交分析意见，由财务负责人、总经理作出决策。止损业务操作过程中，若出现或很可能出现应当披露的重大亏损情形时，公司管理层应当及时报告董事会。

第七章 信息披露和档案管理

第二十一条 公司或子公司拟开展期货和衍生品交易时，应当根据证券交易所业务规则要求，对外披露交易目的、交易品种、交易工具、交易场所、预计动用的交易保证金和权利金上限、预计任一交易日持有的最高合约价值、专业人员配备情况等，并进行充分的风险提示。

公司或子公司以套期保值为目的开展期货和衍生品交易的，公司应当明确说明拟使用的期货和衍生品合约的类别及其预期管理的风险敞口，明确两者是否存在相互风险对冲的经济关系，以及如何运用选定的期货和衍生品合约对相关风险敞口进行套期保值。公司应当对套期保值预计可实现的效果进行说明，包括持续评估是否达到套期保值效果的计划举措。

公司或子公司从事以投机为目的的期货和衍生品交易的，公司应当在公告标题中真实、准确地披露交易目的，不得使用套期保值、风险管理等类似用语，不得以套期保值为名变相进行以投机为目的的期货和衍生品交易。公告中应当披露针对投机交易的风险缓释措施及损失承担安排等。

第二十二条 公司或子公司期货和衍生品交易已确认损益及浮动亏损金额每达到公司最近一年经审计的归属于公司股东净利润的 10%且绝对金额超过 1,000 万元人民币的，应当立即报告董事会并及时披露。公司或子公司开展套期保值业务的，可以将套期工具与被套期项目价值变动加总后适用前述规定。

公司或子公司开展套期保值业务出现前款规定的亏损情形时，公司还应当重新评估套期关系的有效性，披露套期工具和被套期项目的公允价值或现金流量变动未按预期抵销的原因，并分别披露套期工具和被套期项目价值变动情况等。

第二十三条 公司或子公司开展以套期保值为目的的期货和衍生品交易，公司在披露年度报告时，应当同时结合被套期项目情况对套期保值效果进行全面披露。套期保值业务不满足会计准则规定的套期会计适用条件或未适用套期会计核算，但能够通过期货和衍生品交易实现风险管理目标的，可以结合套期工具和

被套期项目之间的关系等说明是否有效实现了预期风险管理目标。

第二十四条 期货和衍生品交易协议、授权文件、交易凭证等原始档案由公司财务部负责保管，保管期限为 10 年。

第八章 附则

第二十五条 本制度未尽事宜，按有关法律、法规、规章、规范性文件、证券交易所业务规则及《对外投资管理制度》执行；本制度如与有关法律、法规、规章、规范性文件、证券交易所业务规则相抵触，按届时有效的法律、法规、规章、规范性文件执行。

第二十六条 本制度由董事会负责解释和修订。

第二十七条 本制度自公司董事会审议通过之日起生效实施。

新天力科技股份有限公司

董事会

2026 年 8 月 27 日