证券代码：600169

证券简称：太原重工

公告编号：2025-016

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2025年4月25日召开第九届董事会第十次会议，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

公司进出口业务主要以欧元、美元结算。受国内外环境综合因素影响，人民币对欧元、美元的汇率存在波动。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、掉期、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汇借款，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，明确岗位责任，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

该事项经公司董事会审计与风控委员会审议通过。公司于2025年4月25

日召开第九届董事会第十次会议审议通过该事项，无需提交公司股东大会审议。

特此公告。

太原重工股份有限公司董事会

2025年4月29日