

三安光电股份有限公司

开展2017年度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个别及连带责任。

重要内容提示

●外汇衍生品交易受托方：商业银行

●外汇衍生品交易金额：2017 年度任何时点交易余额不超过 1 亿美元，可循环使用。

一、外汇衍生品交易业务概述

公司进出口业务较多，为防范利率及汇率波动风险，降低利率汇率波动对公司利润的影响，减少汇兑损失，降低财务费用，决定委托商业银行开展外汇衍生品交易，币种主要为美元、欧元、港币，2017 年度任何时点交易余额不超过 1 亿美元，在此额度内可以循环使用，并授权公司经营层负责具体与外汇衍生品交易相关事宜。

（一）、外汇衍生品交易品种

本公告所称外汇衍生品是指一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，合约的基本种类包括远期、掉期（互换）、期权等以及具有以上一种或多种特征的结构衍生工具，衍生产品交易指自愿承担风险，进行衍生产品交易。公司拟开展的外汇衍生品交易业务主要在以下范围内：

1、远期结汇/售汇业务，是指与商业银行签订远期合约，约定未来办理结汇或购汇的外币币种、金额、汇率和期限；到期外汇收入或支出发生时，即按照合约订明的币种、金额、期限、汇率办理结汇或售汇的业务。

2、人民币与外币掉期业务，是指与商业银行以 A 货币（人民币或者外币）交换 B 货币（人民币或者外币），并按照事先约定的金额、汇率在未来某一特定日期，再以 B 货币换回 A 货币的人民币兑外币的交易，包括一笔即期外汇交易和一笔远期外汇交易，或者两笔远期外汇交易。在人民币掉期交易的币别对中，一种币别必须为人民币，另一种币别必须为外币。

3、外汇期权业务，是指与商业银行在成交时就确定未来某一交易日作为行权日期，期权买方只能在行权日当日约定的截止日期之前行权，其他时间不得行

权的普通欧式期权业务。行权指的是期权买方通知期权卖方，按照期权成交时约定的本金金额、汇率、交割日期、买卖方向、币别等要素，与期权卖方进行结售汇交易。

（二）、公司内部需履行的审批程序

公司第八届董事会第四十次会议已审议通过了关于开展外汇衍生品交易的议案，同意公司在 2017 年度内开展外汇衍生品交易，任何时点交易余额不超过 1 亿美元，可循环使用，并授权公司经营层负责具体与外汇衍生品交易相关事宜。

二、外汇衍生品交易协议主体的基本情况

2017 年度公司开展外汇衍生品的协议对方均为商业银行，与公司不存在产权、资产、人员等方面的其它关系。

三、开展外汇衍生品交易的风险分析及风控措施

（一）风险分析

1、汇率及利率波动风险：对于结汇业务如果到期日即期汇率大于远期结售汇合约汇率，则该笔合约将产生亏损；对于售汇业务如果到期日即期汇率小于远期结售汇合约汇率，则该笔合约将产生亏损。

2、收汇预测风险：公司根据现有业务规模、业务淡旺季以及回款期进行收汇预测。实际经营过程中，市场情况可能会发生变化，将会导致该公司业务规模、回款期和预测有偏差，产生延期交割风险。

3、保证金风险：外汇衍生品交易实行保证金交易，公司主要交易的金融机构对公司的外汇衍生品交易都实行了用授信额度来抵减保证金，以避免占用公司大量资金进而影响公司业务的发展。

（二）风险控制措施

公司已组织由财务总监负责组成的外汇衍生品交易工作小组，专门负责对接该项业务，并对该小组人员进行了专业培训，重点关注该项业务的风险控制、审批程序、后续管理等环节，参与该项业务的人员都已理解外汇衍生品业务的特点及风险，基本可以保证开展外汇衍生品业务的风险可控。

四、对公司的影响

公司进出口业务较多，需要大量的外汇交易，为规避汇率波动风险，公司通过利用合理的金融工具，有利于减少汇兑损失，降低财务费用。

五、独立董事意见

公司使用自有资金开展外汇衍生品交易可以降低利率汇率波动对公司的影响，减少汇兑损失，降低财务费用，不存在损害公司和全体股东利益的情形，符合国家相关法律法规及《公司章程》的有关规定，同意公司开展外汇衍生品交易。

特此公告。

三安光电股份有限公司

二〇一七年四月十三日