

安徽华信国际控股股份有限公司

关于同意全资子公司开展人民币外汇掉期业务的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、开展人民币外汇掉期业务的概述

1、为进一步优化安徽华信国际控股股份有限公司（以下简称“公司”）及其合并报表范围内子公司长短期债务结构，缩小外币性资产与负债敞口，以合适的融资成本满足公司中长期发展对增加营运资金的需求，公司拟在 2017 年以全资子公司华信天然气（香港）有限公司（以下简称“华信天然气香港”）为主体，拟择期进行名义本金不超过 3 亿美元的利率掉期业务，通过外汇掉期业务进行浮动利率与固定利率的转换，进一步降低融资成本，合理控制利率风险。

2、公司第七届董事会审计委员会第七次会议一致审议通过了华信天然气香港拟进行名义本金不超过 3 亿美元的利率掉期业务事项，并同意将此事项提交公司董事会审议。

3、2017 年 8 月 22 日召开的公司第七届董事会第九次会议一致审议通过了华信天然气香港拟进行名义本金不超过 3 亿美元的利率掉期业务事项，与会董事充分讨论了上述事项，知悉华信天然气香港拟进行的利率掉期业务的背景、操作流程、风险管理流程及其与公司日常经营的相关性，并同意将此事项提交公司 2017 年第三次临时股东大会审议。

4、公司禁止从事任何投机套利行为。利率掉期业务所面临的风险包括市场重估风险、交割风险、信用风险和其它风险。

二、外汇掉期业务主要条款

- 1、交易主体：华信天然气（香港）有限公司
- 2、交易品种：人民币外汇掉期

3、交易本金：无交易本金，名义本金以协议确认金额为准，名义本金余额不超过香港天然气实际美元借款本金余额，且最高不超过 3 亿美元（交易双方不交换本金，名义本金只作为计算基数）

4、交易期限：与债务性融资期限相匹配

5、参考币种：美元

6、其他条款：公司进行的利率掉期交易属于场外非标准化合约，根据交易双方协商确认参考利率、付息日、利率交割日、支付方式等

7、有效期限：自公司 2017 年第三次临时股东大会审议通过之日起 12 个月内有效

三、预计开展的人民币外汇掉期业务交易额度和投入资金

1、预计交易额度

预计开展的人民币外汇掉期业务总规模：香港天然气拟在合适时机通过与银行签订名义本金不超过 3 亿美元的利率掉期协议。

2、预计占用资金

无交易本金，名义本金以协议确认金额为准，名义本金余额不超过香港天然气实际美元借款本金余额，且最高不超过 3 亿美元（交易双方不交换本金，名义本金只作为计算基数）。

四、衍生品投资的准备情况

1、公司已制定《金融衍生品交易业务内部控制制度》，对公司进行衍生品投资的风险控制、审议程序、后续管理等进行明确规定，以有效规范衍生品投资行为，控制衍生品投资风险。

2、在股东大会授权范围内，由公司计划财务部具体负责公司衍生品投资事务执行工作。

3、公司管理及操作人员已充分理解衍生品投资的特点和潜在风险，严格执行衍生品投资的业务操作和风险管理制度。

五、人民币外汇掉期业务风险分析

进行人民币外汇掉期业务可能面临以下风险：

1、市值重估风险

市值重估风险，指在重估期内受市场价格参数变动影响，利率掉期产品交易敞口的市场价值发生变动。如报告期末利率掉期的公允价值较报告期初发生变动，将会对公司当期损益产生影响。

2、交割风险

利率掉期业务不涉及本金交换，交易双方依据合同约定的名义本金交换利息额，交割风险仅限于应付利息部分。公司通过有效的资金计划，保证在交割时拥有足额资金供清算。

3、信用风险

信用风险，指交易对手不能履行合同义务支付掉期收益而对公司造成的风险。鉴于香港天然气进行利率掉期业务的交易对手均为国内大中型股份制银行、且已与公司已建立长期业务往来，基本不存在信用风险。

4、其它风险

在开展业务时，如操作人员未按规定程序进行操作或未充分理解利率掉期信息，将带来操作风险；如交易合同条款的不明确，将可能面临法律风险。

六、风险管理策略

1、公司对利率掉期业务进行严格的风险评审和风险跟踪，投资额度不得超过经董事会或股东大会批准的授权额度上限；公司开展的利率掉期以可比较的利率水准为基础，以控制债务性融资成本为目的。

2、公司与交易银行签订条款准确清晰的合约，严格执行风险管理制度，以防范法律风险。

3、公司计划财务部跟踪衍生品公开市场价格或公允价值变动，及时评估已投资利率掉期业务的风险敞口变化情况，并定期向总经理办公会报告，如发现异常情况及时上报董事长，执行应急措施。

4、公司内部审计部门定期对衍生品投资进行合规性审计。

七、利率掉期的会计核算政策及后续披露

1、公司根据《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-套期保值》、《企业会计准则第39号-公允价值计量》对利率掉期合约公允价值予以确定，根据《企业会计准则第37号-金融工具列报》对利率掉期予以列示和披露。

2、公司已投资金融衍生品的公允价值减值与用于风险对冲的资产（如有）价值变动加总，导致合计亏损或浮动亏损金额每达到或超过公司最近一年经审计的归属于上市公司股东净利润10%且亏损金额达到或超过1,000万元人民币的，应及时上报董事长，并抄送董事会秘书。

3、公司将在定期报告中对已经开展的衍生品投资相关信息予以披露。

八、独立董事意见

公司独立董事认为：公司以规避汇率或利率波动风险为目的拟开展的外汇衍生品交易业务，与公司日常经营需求紧密相关，降低汇率波动对公司业绩的影响，有利于股东利益最大化，符合有关法律、法规的规定，且公司已制定了《金融衍生品交易业务内部控制制度》，加强了风险管理和控制。《关于同意全资子公司进行外汇掉期业务的议案》的审议、表决程序符合《公司法》、《深圳证券交易所股票上市规则》等有关法律、法规和《公司章程》的规定，表决结果合法有效。

九、备查文件

- 1、公司第七届董事会第九次会议决议；
- 2、公司第七届监事会第九次会议决议；
- 3、独立意见。

特此公告。

安徽华信国际控股股份有限公司董事会

二〇一七年八月二十四日