

股票代码：002202

股票简称：金风科技

公告编号：2018-002

新疆金风科技股份有限公司 关于全资子公司 Stockyard Hill Wind Farm Pty Ltd. 开展项目融资利率掉期和外汇套期保值业务的公告

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。

新疆金风科技股份有限公司（以下简称“金风科技”或“公司”）第六届董事会第十四次会议审议通过了《关于全资子公司 Stockyard Hill Wind Farm Pty Ltd. 开展项目融资利率掉期和外汇套期保值业务的议案》，同意对其所属的 Stockyard Hill 风电场项目开展利率掉期和外汇套期保值业务，具体情况如下：

一、项目概述

Stockyard Hill Wind Farm Pty Ltd. 为金风科技的子公司金风国际控股（香港）有限公司的全资子公司，其所属 Stockyard Hill 风电场项目规划容量约为 527.5MW，位于澳大利亚维多利亚州，距墨尔本西部约 140 公里，建成后将成为澳洲最大的风电场，可满足约 40 万户维多利亚家庭的用电需求。项目计划采用不超过 149 台金风科技 GW3.0MW(S) 直驱永磁机组。

Stockyard Hill 风电场项目总投资超过 10 亿澳元，其中银行贷款 6.80 亿澳元。

二、利率掉期情况介绍

1、开展利率掉期业务的目的

Stockyard Hill 风电场项目投资币种为澳元。为减少金融市场上的利率波动对项目建设成本和运营成本的影响，拟对该项目贷款期限内的基准利率做掉期锁定，确保项目还款现金流的稳定性。

2、利率掉期方案

在项目融资关闭的合适窗口期，完成利率掉期，掉期利率按照当时的市场利率而定，项目贷款金额为 6.80 亿澳元，为了减少利率风险，贷款方为项目融资提供 10 年的掉期方案，具体方案为：

(1)在建设期内，利率掉期的交易金额为不少于贷款总额的 90%，不超过贷款总额的 100%；

(2)在运营期内，利率掉期的交易金额为不少于贷款总额的 75%，不超过贷款总额的 100%。

3、利率掉期的会计核算原则

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。

三、 外汇套期保值情况介绍

1、开展外汇套期保值业务的目的

Stockyard Hill 风电场项目投资币种为澳元。在项目建设期，项目公司将随项目建设进度支付建设成本。为保证项目建设期成本固

定，根据融资关闭的需要，在合适交易窗口，完成澳元/美元汇率、澳元/人民币汇率的外汇套期保值业务，减少汇兑损失，保证项目收益。

2、套期保值业务品种

公司此次实施的套期保值业务只限于外汇套期保值。

3、拟投入资金金额及业务期间

根据融资关闭的需要，在合适交易窗口，完成 3,200 万美元和 21 亿元人民币的澳元/美元汇率、澳元/人民币汇率的套期保值业务，分别用于海运费、机组及塔架款。

4、外汇套期保值业务的会计核算原则

公司根据财务部《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——套期保值》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》等相关规定及其指南，对外汇套期保值业务进行相应核算和披露。

四、风险分析及风险控制措施

1、风险分析

通过利率掉期锁定利率风险是银行基于国际惯例的融资要求，本次利率掉期成本已计算在投资成本中，对项目投资时所做的评估成本没有增加。同时此利率掉期为基本的利率波动风险金融管理工具，其目的是将贷款利率中的浮动利率锁定为固定利率，不包含任何其它的复杂金融衍生工具，故风险相对较低。

此次外汇套期保值业务的目的是锁定项目建设成本。远期购入的人民币和美元为项目将实际使用的币种，故风险相对较低。

2、风险控制措施

公司制定了《金风科技外汇套期保值管理制度》，对公司开展外汇套期保值、利率掉期等业务的审批程序、管理及操作流程、风险控制、内部报告等制度进行了规范。由公司外汇套期保值业务领导小组统一监督管理所有外汇套期保值、利率掉期等业务，持续跟进上述业务的交易并做好内部监控。

特此公告。

新疆金风科技股份有限公司

董事会

2018年2月7日