

晶澳太阳能科技股份有限公司 关于开展外汇衍生品交易的公告

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。

晶澳太阳能科技股份有限公司（以下称“公司”）于2020年1月7日召开的第五届董事会第二次会议审议通过了公司《关于开展外汇衍生品交易的议案》，该议案尚需提交2020年第一次临时股东大会审议。现将相关情况公告如下：

一、开展外汇衍生品交易的目的及必要性

鉴于公司出口业务的日益增加，外汇市场波动较为频繁，为防范并降低外汇汇率波动带来的经营风险，公司及控股子公司与境内外金融机构拟开展外汇衍生品交易业务，品种包括但不限于外汇远期结售汇（定期，择期）、外汇结构性远期等业务。

二、外汇衍生品交易品种

公司拟开展的外汇衍生品交易品种包括但不限于以下品种：

1、外汇远期结售汇（定期、择期）：拟与金融机构按约定的外汇币种、数额、汇率和交割时间，在约定的时间或时间范围内按照合同规定的交割方式完成的外汇交易。

2、结构性外汇远期合约：拟与金融机构对外汇远期、外汇期权等一般性远期产品在结构上进行组合，形成带有一定执行条件的外汇产品，以满足特定的保值需求。

三、外汇衍生品交易管理

外汇衍生品交易的开展将严格遵守相关国家法律法规和公司内部管理制度，交易额度、期限、保证金及资金来源如下：

1、交易额度：申请交易金额为任意时点最高余额不超过等值15亿美元。

2、交易期限：自股东大会审议通过之日起至 2020 年 12 月 31 日。

3、外汇衍生品交易需要缴纳一定比例的保证金，该保证金将使用自有资金或金融机构的授信额度。

4、保证金总额：保证金总额预计不超过等值 1 亿人民币。

5、授权公司管理层代表公司签署涉及的相关交易文件及其他有关的一切文件，并由上述被授权人或其指定的人员办理与交易文件所述之交易相关的一切必要事宜。

四、开展外汇衍生品交易的风险分析及应对策略：

1、市场风险：在外汇衍生品的存续期内，每一会计期间将产生重估损益，外汇衍生品到期或择期交割时，合约汇率与交割日市场汇率差异将形成实际交易损益并冲销重估损益的累计值形成投资损益。外汇衍生品交易以规避汇率波动带来的经营性风险为原则，不做投机性套利交易。

2、流动性风险：不合理的外汇衍生品购买会引发资金的流动性风险。交易方案将以外汇资产及负债为依据，严格审查相应的进出口采销合同，合理规划外汇资金计划并适时选择外汇衍生品，适当选择差额交割衍生品，以减少到期日现金流需求，保证在交割时拥有足额资金供清算，确保所有外汇衍生品交易均以正常的贸易业务背景为前提并加强应收账款的风险管控，严控逾期应收账款和坏账。

3、履约风险：不合理的交易方选择可能引发公司购买外汇衍生品的履约风险。因此，公司会对已有的拥有良好信用且与公司已建立长期业务往来的金融机构进行评估，降低履约风险。

4、其它风险：外汇衍生品交易合同条款不明确，将可能面临法律风险。公司将审慎审查与合作方签订的合约条款，严格执行风险管理制度，以防范法律风险。

特此公告。

晶澳太阳能科技股份有限公司

董事会

2020 年 1 月 7 日