

株洲旗滨集团股份有限公司

关于 2020 年度开展金融衍生品业务的公告

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。

重要内容提示：

●株洲旗滨集团股份有限公司（以下简称“公司”）于 2020 年 3 月 24 日召开第四届董事会第十二次会议和第四届监事会第十二次会议，分别审议通过了《关于公司 2020 年度开展金融衍生品业务的议案》，同意公司根据实际情况和业务发展的需要，将原有的远期结售汇业务扩展为金融衍生品业务，2020 年度开展的金融衍生品业务累计交易金额不超过 75,000 万元人民币（含等值外币，按照金融衍生品合同约定的币种、汇率计算）。

●该事项无须提交公司股东大会审议。

一、开展金融衍生品业务的目的

随着中国汇率市场化改革的深入推进，人民币定价机制趋于透明，人民币双向波动已成为常态，且波动的幅度和频率不断加大。2019 年 8 月，美元兑人民币汇率一举突破 7.0，最高逼近到 7.2。目前，公司及国内控股子公司部分原燃料及设备的采购需自国外进口，上述业务主要采用美元等外币进行结算；另外，公司海外控股子公司因生产经营或项目建设需要，办理了长（短）期美元外币借款，部分借款利率随 LIBOR 美元浮动，上述事项当汇率、利率出现较大波动时，会对公司的经营业绩会造成一定影响。2020 年，预计公司持续面临的汇率或利率波动风险将进一步加大，为规避和对冲经营及融资所产生的上述汇率、利率风险，降低汇率波动对公司成本和利润的影响，使公司专注于主业生产经营，经审慎考虑，公司拟开展金融衍生品业务。公司开展金融衍生品业务以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，以外汇、利率保值为手段，来规避和防范汇率、

利率风险，锁定或降低成本。

二、金融衍生品业务概述

金融衍生品是指远期、互换、期权等产品或上述产品的组合。衍生品的基础资产或指数包括汇率、利率、货币，适用于外汇和人民币；既可采取实物交割，也可采取现金差价结算；既可采用保证金或担保进行杠杆交易，也可采用无担保、无抵押的信用交易。

公司开展的金融衍生品交易是指为满足正常生产经营需要，在具有相关业务经营资质的银行等金融机构开展的用于锁定成本、规避和防范汇率、利率风险的金融衍生品业务，包括远期结售汇、外汇掉期、外汇期权、利率互换、利率期权、结构性远期等。

三、金融衍生品业务的可行性分析

公司第四届董事会第十二次会议审议通过了《关于 2020 年度开展金融衍生品业务的议案》，董事会认为公司在授权额度内开展与银行的金融衍生品业务，是出于从锁定汇率、利率成本的角度考虑，降低汇率、利率波动对公司生产经营的影响，合理控制采购成本和外币贷款付息成本，符合公司未来经营发展需要，风险可控，无损害公司和中小股东的利益行为。

四、预计开展的金融衍生品业务额度、期限和授权情况

2020 年度公司预计进口原燃料金额约 5 亿元。同时，截止本公告日控股子公司旗滨集团（马来西亚）有限公司、南方节能（马来西亚）有限公司原币为美元的借款本金余额合计为 5,389 万美元。

为降低汇率、利率波动对公司造成的影响，公司（包括下属子公司）预计 2020 年度拟开展的金融衍生品业务累计交易金额不超过 75,000 万元人民币（含等值外币，按照金融衍生品合同约定的币种、汇率计算）。在上述额度范围内授权公司管理层负责具体办理实施，具体交易情况以公司的实际经营需求及实时交易交割为准，授权期限自董事会审议通过之日起未来 12 个月内有效。公司开展金融衍生品交易业务，每笔业务期限原则上应控制在 12 个月内。如单笔交易的存续期超过授权期限，则授权期限自动顺延至该笔交易业务终止时止，但公司应

确保任意时点的金融衍生品业务交易余额不得超过经授权的年度累计交易总金额。因公司自身借款的剩余期限大于 12 个月等情况，确需开展金融衍生品交易业务的存续期限超过 12 个月的，需经公司总裁办公会议审议批准后方可实施。

五、独立董事意见及监事会意见

（一）独立董事意见

公司独立董事同意公司开展金融衍生品业务，同意该业务的 2020 年度累计交易额度，并发表独立意见如下：

公司开展金融衍生品业务是为控制进口原燃料成本及外币贷款利息费用，规避汇率、利率波动风险而采取的合理措施，有利于保证公司盈利的稳健性，符合公司生产经营和战略发展需要。公司制定了《株洲旗滨集团股份有限公司金融衍生品业务内部控制制度》，提出了相应的风险控制措施，对金融衍生品业务的操作环节和流程作了明确规定，可以有效控制业务操作风险。公司本次开展金融衍生品业务，公司董事会已经履行了必要的决策程序，符合法律、法规及《公司章程》的规定。融衍生品业务符合公司的业务需要，该事项不存在损害公司及全体股东特别是中小股东利益的情形。

（二）监事会意见

公司监事会同意公司开展金融衍生品业务，监事会认为：公司开展与银行等金融机构开展的金融衍生品业务是为规避汇率、利率波动风险，锁定降低采购成本和资金成本而采取的措施，有利于确保公司年度经营目标的实现，符合公司未来经营发展需要，风险可控，不存在损害公司及全体股东特别是中小股东利益的情形。公司本次开展金融衍生品业务履行了相关审批程序，符合公司章程及有关规定。我们同意公司开展该业务，同意公司制定的 2020 年度累计交易额度。

六、金融衍生品业务风险分析

公司开展金融衍生品业务遵循锁定汇率、利率风险的原则，不做投机性、套利性的交易操作。开展金融衍生品业务交易可以在汇率、利率发生大幅波动时，部分抵消或降低汇率、利率波动对公司的影响，使公司专注于生产经营，但开展金融衍生品业务交易也可能存在如下风险：

1、汇率、利率波动风险：在汇率、利率行情变动较大情况下，会造成金融

衍生工具较大的公允价值波动；若汇率、利率走势偏离公司锁定价格波动，存在造成损失增加的风险。

2、专业判断失误风险：金融衍生品交易专业性要求高，业务操作性较强，必须对未来汇率、利率的走势作出正确的判断预期，如专业判断失误，可能造成实际的成本支出，高于不进行锁价的成本。

3、内部控制风险：金融衍生品复杂程度高，可能会由于内控制度不完善而造成风险。

七、公司采取的风险控制措施

1、公司制定了《株洲旗滨集团股份有限公司金融衍生品内部控制制度》，对金融衍生品业务的操作原则、审批权限、审批部门及责任人、内部操作流程、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序等作了明确规定，公司将严格按照该制度相关规定，确保开展金融衍生品业务的风险可控。

2、设置管理机构和专人负责。公司相关人员成立金融衍生品领导小组，加强对金融衍生品业务管理职责，负责外汇金融衍生品交易前的风险评估，分析交易的可行性及必要性，负责交易的具体操作办理；并按规定建立异常情况及时报告制度，当市场发生重大变化时及时上报风险，评估变化情况，并提出可行的应急止损措施，形成高效的风险处理程序。

3、在签订金融衍生品业务合约时严格按照公司根据实际业务的相关事项进行交易，确保所有金融衍生品业务均有真实的贸易背景。

4、强化对公司参与金融衍生品业务的人员，特别是交易操作人员的业务培训，充分了解和掌握金融衍生品业务的特点及风险，严格执行金融衍生品交易业务的操作规定和风险管理制度，密切关注市场走势，并结合市场情况适时调整操作策略，提高保值效果。

5、公司只与具有合法经营资格的金融机构开展金融衍生品业务，不与非正规的机构进行交易。

6、公司财务管理部密切关注金融衍生品交易合约涉及的市场情况，定期向管理层报告进展情况；内控审计部加强金融衍生品的监督和审计，核实盈亏和资金使用情况；法务部门参与审核把关，确保与银行等金融机构的交易合约条款清晰，严格对照风险管理制度和流程进行操作，以防范法律风险和内控风险。

八、备查文件

- 1、第四届董事会第十二次会议决议；
- 2、第四届监事会第十二次会议决议；
- 3、独立董事意见；
- 4、监事会意见。

特此公告！

株洲旗滨集团股份有限公司

二〇二〇年三月二十五日