

三一重能股份有限公司

关于开展外汇衍生品交易业务的可行性分析报告

一、开展外汇衍生品交易业务的背景

随着公司及子公司国际业务的不断拓展，外汇收支规模亦同步增长。为降低汇率、利率风险，三一重能股份有限公司（以下简称“公司”或“三一重能”）及合并报表范围内子公司（以下简称“子公司”）拟根据具体情况，通过外汇衍生品交易适度开展外汇套期保值。公司进行适当的外汇衍生品交易业务能够提高公司积极应对外汇波动风险的能力，更好的规避公司所面临的外汇汇率、利率风险，增强公司财务稳健性。

公司及子公司拟开展的外汇衍生品交易将遵循合法、谨慎、安全、有效的原则，所有外汇衍生品交易以套期保值、规避和防范利率、汇率风险为目的，不影响公司正常生产经营，不进行投机和套利交易。

二、开展外汇衍生品交易业务的基本情况

（一）交易金额

公司及子公司拟开展外汇衍生品交易业务，预计动用的交易保证金和权利金任一交易日不超过 3 亿元人民币或其他等值外币，任一交易日持有的最高合约价值不超过 65 亿元人民币或其他等值货币。开展期限内任一时点的交易金额（含前述外汇套期保值业务的收益进行再交易的相关金额）不超过前述额度范围。公司及子公司开展外汇衍生品交易业务期限为自公司董事会会议审议通过后 12 个月内，在上述期限内，资金可循环滚动使用。

董事会同时授权公司管理层在授权额度和期限内，审批公司日常外汇衍生品交易具体操作方案、签署相关协议及文件。

（二）资金来源

公司及子公司拟开展外汇衍生品交易业务的资金来源为公司自有资金，不涉

及使用募集资金的情形。

（三）交易方式

公司及子公司拟开展的外汇衍生品交易业务，主要为金融机构提供的远期业务、掉期业务（货币掉期、利率掉期）、互换业务（货币互换、利率互换）、期权业务（外汇期权、利率期权）等及以上业务的组合。交易对手方应为经营稳健、资信良好且具有金融衍生品交易业务经营资格的银行等金融机构，与公司不存在关联关系。

（四）交易期限

公司及子公司本次开展外汇衍生品交易业务期限为自公司董事会会议审议通过 12 个月内。公司及子公司可在上述额度及审批期限内循环滚动使用资金额度。

三、开展外汇衍生品交易业务的必要性和可行性

为防范汇率大幅波动对公司造成不良影响，公司有必要根据具体情况适度开展外汇衍生品业务。公司开展的外汇衍生品业务与公司业务紧密相关，基于公司外汇资产状况及外汇收支业务情况，能进一步提高公司应对外汇波动风险的能力，更好地规避和防范公司所面临的外汇汇率、利率波动风险，增强公司财务稳健性。

四、开展外汇衍生品交易业务的风险分析

公司及子公司开展外汇衍生品交易业务遵循合法、谨慎、安全和有效的原则，不得进行投机性和单纯的套利交易，但外汇衍生品交易仍存在包括但不限于以下风险：

- 1、市场风险：因外汇行情变动较大，可能产生因标的利率、汇率等市场价格波动引起外汇衍生品价格变动，造成亏损的市场风险。
- 2、流动性风险：因市场流动性不足而无法完成交易的风险。
- 3、操作风险：外汇衍生品交易业务专业性较强，复杂程度较高，可能带来

因交易或管理人员的人为错误或系统故障、控制失灵而造成的操作风险。

4、履约风险：开展外汇衍生品业务存在合约到期无法履约造成违约而带来的风险。

5、其它风险：因相关法律发生变化或交易对手违反相关法律制度可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失。

五、公司对外汇衍生品交易业务采取的风险控制措施

1、公司及子公司进行外汇衍生品交易业务遵循合法、谨慎、安全和有效的原则，不进行单纯以盈利为目的的外汇交易，所有外汇衍生品交易业务均以正常生产经营为基础，以真实交易背景为依托，以规避和防范汇率或利率风险为目的。

2、公司及子公司开展外汇衍生品交易业务只允许与经监管机构批准、具有外汇衍生品交易业务经营资格且经营稳健、资信良好的银行等金融机构进行交易，不得与前述金融机构之外的其他组织或个人进行交易。

3、公司财务部门将持续跟踪外汇衍生品公开市场价格或公允价值变动，及时评估外汇衍生品交易的风险敞口变化情况，并定期向公司管理层报告，发现异常情况及时上报，提示风险并执行应急措施。

4、公司已制定衍生品交易管理制度，对衍生品交易的操作原则、审批权限、管理和实施、风险管理和报告、信息披露等进行了明确规定，以控制交易风险。

六、公司开展外汇衍生品交易业务可行性分析结论

公司及子公司在充分保障日常经营性资金需求、不影响正常经营活动并有效控制风险的前提下，开展外汇衍生品交易业务，有利于提高应对外汇波动风险的能力，防范汇率波动对公司经营的不利影响，符合公司稳健经营的要求。此外，公司已制定《外汇衍生品交易业务管理制度》并明确风险应对措施，交易业务风险可控，不存在损害公司和股东利益的行为。因此，公司及子公司开展外汇衍生品交易业务具有必要性和可行性。

三一重能股份有限公司董事会

2026年4月1日