

山河智能装备股份有限公司

关于开展金融衍生品业务的公告

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

山河智能装备股份有限公司（以下简称“公司”）于2024年4月26日召开第八届董事会第十五次会议和第八届监事会第十次会议，审议通过了《关于开展金融衍生品业务的议案》，为满足公司及下属子公司进行套期保值业务的需要，建立有效的风险防范机制、实现稳健经营，根据深圳证券交易所《深圳证券交易所股票上市规则》《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第1号——主板上市公司规范运作》等相关规定，公司拟依据以下原则持续开展金融衍生品业务，不涉及关联交易。本议案尚需公司2023年年度股东大会审议。现将有关情况公告如下：

一、业务目的

公司开展的金融衍生品业务，是以套期保值为目的，用于锁定成本、规避利率、汇率等风险，均匹配公司的国际业务，充分利用外汇衍生交易的套期保值功能，对冲国际业务中的汇率风险，降低汇率及利率波动对公司的影响。公司开展本业务不会影响公司主营业务发展，资金使用安排合理。

二、业务额度及业务资金

用于以上衍生金融产品的交易金额，均为对冲业务风险，业务额度不超过人民币20亿元，额度内可循环操作。开展金融衍生品业务将使用公司的自有资金，不涉及募集资金。

三、业务品种

公司拟操作的金融衍生品主要包括远期、期权、互换、期货等产品或上述产品

的组合，对应基础资产包括利率、汇率、货币、商品或上述资产的组合。

四、开展外汇衍生品交易的必要性

公司进出口业务主要结售汇币种是美元、欧元、日元，终端收款除美元、欧元外，还有大量境外各个国家的小币种，外币存在币种与收付汇时间的错配。随着公司国际业务的规模增长，公司面临的汇率敞口风险也随之增加。为防范利率及汇率波动风险，降低利率汇率波动对公司利润的影响，减少汇兑损失，降低财务费用，公司及控股子公司开展的金融衍生品交易是以日常经营需要和防范利率汇率风险为前提，目的是减少利率汇率大幅度变动导致的预期风险。

五、业务风险

1、市场风险：公司及其控股子公司开展的金融衍生品业务，主要为与主营业务相关的套期保值类业务，存在因标的利率、汇率等市场价格波动导致金融衍生品价格变动而造成亏损的市场风险；

2、流动性风险：因开展的衍生品业务均为通过金融机构操作的场外交易，存在因各种原因平仓斩仓损失而须向银行支付价差的风险；

3、其他风险：在具体开展业务时，如发生操作人员未按规定程序报备及审批，或未准确、及时、完整地记录金融衍生品业务信息，将可能导致衍生品业务损失或丧失交易机会。同时，如交易人员未能充分理解交易合同条款和产品信息，将面临因此带来的法律风险及交易损失。

六、风险控制措施

1、选择结构简单、流动性强、风险可控的金融衍生工具开展套期保值业务。

2、严格执行前、中、后台职责和人员分离原则，交易人员与会计人员不得相互兼任。

3、交易对手管理：从事金融衍生业务时，慎重选择代理机构和交易人员。

4、加强对银行账户和资金的管理，严格遵守资金划拨和使用的审批程序。

5、当市场发生重大变化或出现重大浮亏时要成立专门工作小组，及时建立应急机制，积极应对，妥善处理。

6、选择恰当的风险评估模型和监控系统，持续监控和报告各类风险，在市场波

动剧烈或风险增大情况下，增加报告频度，并及时制订应对预案。

七、对公司的影响

为规避汇率波动带来的风险，公司开展金融衍生品业务。该业务匹配公司的国际业务，充分利用外汇衍生品交易的套期保值功能，对冲国际业务中的汇率风险，降低汇率及利率波动对公司的影响，符合公司长远发展及公司股东的利益。

八、授权事项

股东大会授权本公司法定代表人及其授权人员在上述范围内行使金融衍生品投资决策权并签署相关合同协议。有效期自股东大会审议通过本事项之日起 12 个月内有效，业务额度在有效期内可以循环使用。

九、审计委员会意见

公司为规避汇率波动带来的风险，公司开展金融衍生品业务。该业务匹配公司的国际业务，充分利用外汇衍生品交易的套期保值功能，对冲国际业务中的汇率风险，降低汇率及利率波动对公司的影响，符合公司长远发展及公司股东的利益。

十、董事会意见

与主业业务密切相关的简单金融衍生产品与基础业务在品种、规模、方向、期限等方面相匹配，符合公司谨慎、稳健的风险管理原则。公司通过外汇资金业务的开展，进一步提升公司外汇风险管理能力，为外汇资产进行保值增值。通过上述衍生品的投资业务，有利于充分发挥公司竞争优势，公司开展金融衍生品业务是可行的，风险是可控的。

十一、备查文件

- 1、第八届董事会第十五次会议决议；
- 2、第八届董事会审计委员会第九次会议决议。

特此公告。

山河智能装备股份有限公司

董事会

二〇二四年四月三十日