

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。

山河智能装备股份有限公司（以下简称“公司”）于2019年4月24日召开的第六届董事会第二十八次会议审议通过了《关于开展金融衍生品业务的议案》，该议案尚需提交股东大会批准。现将相关情况公告如下：

当前国际经济环境错综复杂，国际外汇市场波动加剧，公司自收购 Avmax Group Inc. 股权后，国际化程度进一步深化，公司运营资金外币使用占比增加，公司经营面临较大外汇风险。

为满足公司及其控股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《股票上市规则》、《中小板上市公司规范运作指引》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：

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，与主营业务密切相关的简单金融衍生产品，且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。

二、业务额度

业务名义本金不超过外汇实际业务需求额度且不超过人民币3亿元，在该额度内循环操作。

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。

公司在开展金融衍生品业务时，不进行场外市场的商品期货套期保值业务。

四、业务期限

单一金融衍生品期限不超过其所对应基础资产期限。

五、风险分析

1、市场风险：集团及成员企业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、授权事项

股东会授权本公司董事长及其授权人员在上述额度内行使金融衍生品投资决策权并签署相关合同协议。本授权自股东会决议通过之日起一年内有效。

八、独立董事独立意见

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。公司董事会的决策程序符合相关法律、法规及《公司章程》的规定。同意《关于开展金融衍生品业务的议案》。

九、备查文件

- 1、第六届董事会第二十八次会议决议；
- 2、独立董事关于相关事项的独立意见。

特此公告。

山河智能装备股份有限公司

董事会

二〇一九年四月二十六日