

江苏神马电力股份有限公司

关于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。

江苏神马电力股份有限公司（以下简称“公司”）于2020年3月11日召开了第三届董事会第二十二次会议，审议通过了《关于开展金融衍生品业务的议案》，现将相关事宜公告如下：

一、开展金融衍生品业务目的

随着公司海外销售规模的不断扩大，产品出口结算货币主要是美元和欧元，因此当外汇汇率出现较大波动时，会产生汇兑损益，对公司经营业绩产生一定影响。为了降低外汇市场的风险，减少汇率波动对公司利润的影响，实现稳健经营，公司拟选择适合的市场时机开展金融衍生品业务，利用外汇衍生交易的套期保值功能规避汇率风险。

二、拟开展金融衍生品业务的基本情况

1、业务品种

公司拟开展的金融衍生品包括但不限于远期结售汇、结构性远期、外汇掉期、货币期权等产品以及上述产品的组合。

2、业务规模

根据2020年出口业务预测情况，公司拟开展的金融衍生品业务交易金额不超过3亿人民币（或等值外币，在交易额度范围内可滚动使用）。

3、决策授权

公司董事会授权总经理在不超出上述额度范围内行使金融衍生品交易业务

的审批权限并签署相关文件，公司财务部门负责具体实施相关事宜，授权期限为本次董事会审议通过之日起 12 个月。

三、金融衍生品业务的风险分析

1、汇率波动风险

在汇率波动较大的情况下，公司操作的金融衍生产品可能会带来较大公允价值波动；若市场价格优于公司锁定价格，将会造成汇兑损失。

2、内部控制风险

在开展金融衍生品交易业务时，如操作人员未按规定程序进行金融衍生品交易操作或未充分理解金融衍生品信息，将会对公司造成损失，甚至可能面临法律风险。

3、回款预测风险

公司根据客户订单和预计订单进行回款预测，但在实际执行过程中，客户可能会调整自身订单和预测，造成公司回款预测不准确，会导致已操作的汇率衍生品延期交割风险。

四、风险控制措施

1、公司开展金融衍生品交易业务严格遵循合法、审慎、安全、有效的原则，选择流动性强、风险可控的金融衍生品交易业务，不得进行投资和套利交易。

2、公司加强应收账款的风险管控，积极催收应收账款，严控海外逾期应收账款和坏账。

3、公司财务部负责对金融衍生品业务持续监控，定期向公司管理层报告。在市场剧烈波动或风险增大情况下，或导致发生重大浮盈、浮亏时第一时间报告给公司管理层以积极应对。

五、独立董事意见

公司独立董事对上述事项发表了同意的独立意见：公司开展金融衍生品业务以正常生产经营活动为基础，以稳健为原则，以货币保值和规避汇率风险为目的，

符合相关制度和法规要求，且履行了必要的审批程序，不存在损害公司和全体股东利益的情形，具体内容详见同日披露于上海证券交易所网站的《独立董事关于第三届董事会第二十二次会议相关事项的独立意见》。

特此公告。

江苏神马电力股份有限公司董事会

2020年3月12日