



## 上海吉祥航空股份有限公司

### 关于开展外汇及利率套期保值业务的公告

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。

上海吉祥航空股份有限公司（以下简称“吉祥航空”或“公司”）于 2021 年 1 月 15 日召开第四届董事会第四次会议，审议通过了《关于公司开展外汇及利率套期保值业务的议案》，公司拟有计划地开展外汇及利率套期保值业务，现将有关情况公告如下：

#### 一、交易的品种

公司及控股子公司开展外汇及利率套期保值业务，币种为公司经营过程中使用的货币，包括美元、港元、欧元、日元、英镑等，业务品种包括但不限于远期结售汇、外汇货币掉期、外汇期权、利率掉期等产品及上述产品的组合。

#### 二、套期保值的目的

公司有计划地根据目前发展状况、金融市场环境，在自然对冲的基础上叠加开展套期保值业务，可以更好地降低公司风险敞口，增强公司业绩的稳定性和可持续性。

公司开展外汇及利率套期保值是以降低风险、锁定成本、保证公司业绩的稳定性和可持续性为目的，不进行投机和套利交易。

#### 三、拟投入资金及业务期间

自董事会审议通过之日起12个月内，公司及控股子公司全年外汇及利率套期保值业务的额度累计不超过最近一期经审计净资产40%（即人民币51亿元）。任一时点，公司套期保值交易累计总额不得超出已经审批的金额，超出部分应按照审批权限履行相应审批手续。

#### 四、风险分析及风险控制措施

##### 1. 风险分析

（1）市场风险：远期、期货、期权等合约及其他衍生产品行情变动幅度较

大，可能产生价格波动风险，造成交易损失。

(2) 内部控制风险：套期保值业务专业性强，复杂程度高，可能会由于内控体系不完善，交易员主观臆断或不完善的操作等造成损失。

(3) 技术风险：从交易到资金设置、风险控制，到与交易对手的联络，存在着因系统崩溃、程序错误、信息风险、通信失效等可能导致交易无法成交的风险。

(4) 违约风险：因交易对手违约，不能按照交易合同约定进行交割的风险。

## 2. 风险控制措施

(1) 业务管理制度：公司制定了《外汇及利率套期保值业务管理制度》，对套期保值业务审批权限、操作规定、业务流程、保密制度、风险处置等方面进行明确规定，公司将严格遵守管理制度开展套期保值业务，按制度对各环节进行控制。

(2) 业务管理机构：公司成立套期保值领导小组、工作小组和风控小组，配备投资决策、业务操作、风险控制等专业人员，明确相应人员的职责。

(3) 以生产经营为基础：公司所有套期保值交易均以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，不进行投机和套利交易。

(4) 业务审计：公司审计部定期对套期保值业务的实际操作情况、资金使用情况及盈亏情况进行审计，对稽核交易及信息披露是否根据相关内部控制制度执行进行监督。

(5) 交易对手：公司仅与具有相关业务经营资质的银行和具有良好资信和业务实力、运作规范的期货经纪公司或银行等金融机构开展套期保值业务。

(6) 研究分析：公司将加强对外汇市场的研究分析，实时关注国际国内市场环境变化，适时调整策略，最大限度地避免交易损失。

## 五、外汇及利率套期保值业务的可行性分析

公司开展外汇及利率套期保值业务，以规避和防范风险为目的，减少汇率及利率大幅波动对公司财务收支带来的不利影响，保证公司经营业绩的稳定性和可持续性，并不以投机和套利交易为目的。

公司已建立了较为完善的外汇及利率套期保值业务内部控制和风险控制制度，具有与拟开展外汇及利率套期保值业务交易保证金相匹配的自有资金。



公司将严格按照《上海证券交易所股票上市规则》和公司《外汇及利率套期保值业务管理制度》的要求，落实风险防范措施，审慎操作。

综上所述，公司开展外汇及利率套期保值业务是切实可行的，有利于公司生产经营。

## 六、独立董事意见

1、公司拟开展与公司生产经营相关的外汇及利率套期保值业务的相关审批程序等符合相关法律法规和《公司章程》的有关规定。

2、公司已制定《外汇及利率套期保值业务管理制度》，建立健全了组织机构、业务操作流程、审批流程及风险控制措施。

3、公司及控股子公司根据目前发展状况、金融市场环境做出必要的调整及应对，在自然对冲的基础上叠加开展外汇及利率套期保值业务，有利于有效防范公司业务的外汇及利率风险，减少汇率及利率大幅波动对公司财务收支带来的不利影响，保证经营成本的相对稳定，降低其对公司正常经营的影响，增强公司业绩的稳定性和可持续性。

综上，我们同意公司开展外汇及利率套期保值业务。

特此公告。

上海吉祥航空股份有限公司董事会

2021年1月16日