

## 安徽凤凰滤清器股份有限公司

### 关于公司拟开展远期结售汇等外汇衍生产品业务的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、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法律责任。

#### 一、业务目的

因公司部分客户为国外客户，主要以美元或者欧元进行结算。为适应外汇市场变化，降低汇率波动对公司造成的不利影响，公司拟开展远期结售汇、外汇期权组合等外汇衍生产品业务，充分利用远期结售汇的套期保值功能及期权类产品外汇成本锁定功能，实现以规避风险为目的的资产保值，降低汇率波动对公司的影响。

#### 二、业务品种

公司 2024 年度开展的远期结售汇、外汇期权等外汇衍生产品业务，主要指远期、掉期（互换）、期权等产品或上述产品的组合。公司根据业务情况，在金融机构办理的规避和防范汇率或利率风险的外汇衍生产品交易业务。

#### 三、预计开展的业务情况

用于以上远期结售汇、外汇期权等外汇衍生产品业务的合约外币金额分别 USD2,000 万，EUR1,000 万可滚动使用，开展交割期与预测回款期一致。期限自 2023 年年度股东大会审议通过之日起一年有效。公司董事会授权管理层签署上述远期结售汇等外汇衍生产品业务相关协议文件，并在上述额度范围和业务期限内负责远期结售汇等外汇衍生产品业务的具体办理事宜。

#### 四、外汇衍生产品业务的风险分析

公司开展的远期结售汇等外汇衍生产品业务遵循锁定汇率风险、套期保值的原则，不做投机性、套利性的交易操作，但远期结售汇等外汇衍生产品操作仍存在一定的风险：

（一）汇率波动风险：在汇率行情变动较大的情况下，会造成金融衍生工具较大的公允价值波动；若汇率走势偏离公司锁定价格波动，存在造成汇兑损失增加的风险。

（二）客户违约风险：客户应收账款发生逾期，货款无法在预测的回款期内收回，会造成延期交割导致公司损失。

（三）回款预测风险：业务部门根据客户订单和预计订单进行回款预测，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，导致延期交割风险。

## 五、公司采取的风险控制措施

（一）为避免汇率大幅波动风险，公司会加强对汇率的研究分析，实时关注国际市场环境变化，适时调整经营策略，最大限度的避免汇兑损失。

（二）公司制定了《远期结售汇及外汇期权交易管理制度》，建立严格有效的风险管理制度，利用事前、事中及事后的风险控制措施，预防、发现和降低各种风险。该制度符合监管部门的有关要求，满足实际操作的需要，所制定的风险控制措施切实有效。

（三）为避免内部控制风险，公司财务部、审计部作为相关责任部门均有清晰的管理定位和职责，通过分级管理，形成监督机制，从制度上杜绝单人或单独部门操作的风险，以有效地控制风险的措施提高对风险的应对速度。

（四）为控制交易违约风险，公司仅与经国家外汇管理局和中国人民银行批准、具有远期结售汇及外汇期权交易经营资格的金融机构开展远期结售汇业务，并密切关注国内外相关政策法规，保证交易管理工作开展的合法性。

（五）公司进行远期结售汇业务必须基于公司的外币收（付）款的谨慎预测，远期结售汇业务的交割日期需与公司预测的外币收款、存款时间或外币付款时间相匹配。交易合约的外币金额不得超过外币收款或外币付款预测金额。

（六）公司内控将定期对远期结售汇业务的实际操作情况、资金使用情况

及盈亏情况进行审查。

## 六、远期结售汇业务对公司的影响

目前全球经贸关系及经济发展趋势存在较大不确定性，外汇汇率波动较大，开展此项业务有利于公司规避汇率波动风险，尽可能降低因外币汇率变动产生的不利影响。该项业务是为满足公司自身实际业务需要，符合公司的整体利益和长远发展，不存在损害公司股东利益的情形。

## 七、审议情况

2024年4月25日，公司第四届董事会第二次会议、第四届监事会第二次会议审议通过了《关于公司拟开展远期结售汇等外汇衍生产品业务的议案》，上述事项尚需提交2023年年度股东大会审议。

## 八、备查文件

- （一）《安徽凤凰滤清器股份有限公司第四届董事会第二次会议决议》
- （二）《安徽凤凰滤清器股份有限公司第四届监事会第二次会议决议》

安徽凤凰滤清器股份有限公司

董事会

2024年4月26日