

证券代码：600031

证券简称：三一重工

公告编号：2024-024

三一重工股份有限公司 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。

2024年4月26日，三一重工股份有限公司（以下简称“公司”）召开的第八届董事会第十九次会议，审议通过《关于开展金融衍生品业务的议案》，具体情况如下：

一、业务目的

公司操作的上述外汇产品以及所涉及的币种，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。

由于公司经营中，外币收付汇、外币存贷款均金额较大，且汇率波动对公司经营成果的影响日益加大，为减少汇率波动带来的风险，公司及香港平台全资子公司操作普通远期外汇交易、利率掉期及货币互换、外汇期权等业务，从而规避汇率波动的风险。

公司操作的上述外汇产品以及所涉及的币种，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。

二、业务品种

普通远期外汇交易双方约定于未来某一特定日期，依照交易当时所定的币种、汇率以及金额进行交割。远期交易可以到期全额交割也可以反向平仓差额交割。公司针对欧元（日元）进口付汇，采取买欧元（日元）卖美元远期交易进行对冲。

利率掉期交易是双方按约定将同币种的贷款互相交换付息方式的交易，如以浮动利率交换固定利率或另一种浮动利率。公司通过利率掉期，将美元贷款浮动利率转换成固定利率，以对冲利率风险。

货币互换交易是指货币不同的贷款之间的调换，包括本金和利率的调换。公司通过货币互换交易，将美元贷款换成欧元（日元）贷款，以对冲贷款的汇率及利率风险。

外汇期权交易是期权买方在到期日以执行价格买入指定数量的货币并卖出另外一种货币的权利而非义务。相对于外汇普通远期，当市场价格更加有利时，企业可以选择不行权，直接在即期市场操作。购买外汇期权需要支付期权费。外汇期权交易仅作为以上外汇衍生品业务的补充。

三、业务额度及预计投入资金

用于以上衍生金融产品的交易金额，均为对冲业务风险，不超过公司国际业务量。公司所操作衍生金融产品均使用银行授信额度，不占用公司资金。

四、风险分析

1、汇率波动风险：在汇率波动较大的情况下，我司操作的衍生金融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，将造成汇兑损失。

2、流动性风险：因业务变动等原因需提前平仓或展期衍生金融产品，可能给公司带来一定损失，需向银行支付差价的风险。

3、操作性风险：在操作衍生金融产品时，如发生交易员未按规定程序审批及记录，将可能导致衍生金融产品损失或丧失交易机会；同时若交易员未充分理解业务信息及衍生金融产品条款，将带来法律风险及交易损失。

五、风险控制措施

1、严格执行公司《外汇风险管理制度》，对业务信息传递、交易审批权限、内部审核流程等做出明确规定。

2、选择具有合法经营资质的金融机构进行交易。

3、公司内部稽核部门、审计部门定期或不定期对交易流程及审批信息进行核查。

六、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。

特此公告。

三一重工股份有限公司董事会

2024年4月29日