



厚普清洁能源股份有限公司

关于公司 2021 年度外汇衍生品投资情况的专项报告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

根据《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 2 号——创业板上市公司规范运作》《深圳证券交易所创业板上市公司自律监管指南第 1 号——业务办理》等有关规定的要求，厚普清洁能源股份有限公司（以下简称“公司”）董事会对公司 2021 年度衍生品投资情况进行了核查，现将相关情况说明如下：

一、衍生品投资审议批准情况

公司于 2021 年 8 月 18 日召开了第四届董事会第十一次会议、第四届监事会第十次会议，审议通过了《关于开展外汇衍生品交易业务的议案》，同意公司使用自有资金与银行等金融机构开展不超过 2,000 万美元或其他等值币种的外汇衍生品交易业务。投资期限自公司董事会审议通过之日起 12 个月内有效，上述额度在审批期限内可循环滚动使用。

二、2021 年外汇衍生品投资的具体情况

公司对报告期内衍生品投资损益情况进行了确认，报告期内未产生公允价值变动收益，未产生投资收益。公司报告期内衍生品交易金额在董事会审议的额度范围内。

三、外汇衍生品交易的风险分析

公司开展外汇衍生品交易业务遵循合法、审慎、安全、有效的原则，不进行以投机为目的的外汇交易，所有外汇衍生品交易业务均以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，以规避和防范外汇汇率大幅变动而带来汇兑损益或外汇利率风险为目的，不得从事超出经营实际需要的复杂外汇衍生品交易，不得以套期保值为借口从事外汇衍生品投机。但外汇衍生品交易业务的交易操作仍存在以下风险：

1、汇率波动风险：在外汇汇率走势与公司判断汇率波动方向发生大幅偏离的情况下，公司锁定汇率后支出的成本可能超过不锁定时的成本支出，从而造成公司损失。

2、内部控制风险：外汇衍生品交易业务专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内部制度不完善而带来的风险。

3、交易违约风险：外汇衍生品交易对手出现违约，不能按照约定支付公司衍生品盈利从而无法对冲公司实际的汇兑损失，将造成公司损失。

四、拟采取的风险控制措施

1、为最大程度规避和防范汇率波动带来的风险，公司授权相关部门和人员将密切关注和分析市场环境变化，适时调整操作策略。

2、公司将对外汇衍生品交易业务的审批权限、业务流程、风险管理制度、报告制度及保密制度等作出明确规定，将有效规范外汇衍生品交易业务行为。

3、公司仅与经国家外汇管理局和中国人民银行批准、具有相应业务经营资格的金融机构进行交易，外汇衍生品交易业务必须基于公司的外币收（付）款的谨慎预测，外汇衍生品交易业务的交割期间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，或者与对应的外币银行借款的兑付期限相匹配。

4、公司审计部负责对外汇衍生品交易的实际操作情况、资金使用情况及盈亏情况进行审查。

5、公司已制定了《外汇衍生品交易业务管理制度》，对外汇衍生品交易业务操作规定、审批权限、管理及内部操作流程、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序等做出了明确规定。

五、独立董事的独立意见

经核查，公司 2021 年度未进行证券投资，仅开展了外汇衍生品交易，公司已制定《外汇衍生品交易业务管理制度》并经董事会审议通过，相关交易履行了相应的决策程序，能够有效规范衍生品交易行为，控制衍生品交易风险。另外，公司用于外汇衍生品投资的资金来源于公司自有资金，以规避和防范公司因进出口业务带来的潜在汇率风险为目的，不存在动用募集资金的情形，亦不存在影响公司主营业务开展，不存在损害公司及股东利益的情形。

特此公告。

厚普清洁能源股份有限公司 董事会

二零二二年三月二十四日