

浙江浙能电力股份有限公司

关于子公司开展外汇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法律责任。

重要内容提示：

● 交易种类：为降低汇率风险，增强财务稳健性，浙江浙能电力股份有限公司（以下简称“公司”）下属子公司拟根据实际经营情况，适度开展外汇套期保值业务。

● 交易金额：外汇套期保值业务规模总额不超过 70 亿元人民币（或等值外币），且任一时点的交易金额均不超过 70 亿元人民币（或等值外币），有效期自 2023 年年度股东大会审议通过之日起 12 个月。

● 已履行及拟履行的审议程序：公司于 2024 年 4 月 28 日召开第四届董事会第三十次会议，审议通过了《关于子公司 2024 年度开展外汇套期保值业务的议案》，该议案需提交股东大会审议。

一、交易情况概述

为降低汇率风险，增强财务稳健性，公司下属子公司拟开展的外汇套期保值业务的具体方式主要包括远期结售汇、外汇掉期、外汇远期合约及其他外汇衍生产品业务，交易币种只限于与公司生产经营所使用的主要结算货币相同的币种，主要外币币种为美元、欧元等。

拟进行的外汇套期保值业务规模总额不超过 70 亿元人民币（或等值外币），且任一时点的交易金额均不超过 70 亿元人民币（或等值外币），有效期自 2023 年年度股东大会审议通过之日起 12 个月。资金来源不涉及募集资金。

公司下属上市子公司苏州中来光伏新材股份有限公司及其下属子公司开展外汇交易按照深圳证券交易所相关规定履行审议和披露程序。

二、审议程序

公司于 2024 年 4 月 28 日召开第四届董事会第三十次会议，审议通过了《关于子公司 2024 年度开展外汇套期保值业务的议案》，同意公司下属子公司开展

外汇套期保值业务，并同意将该议案提交股东大会审议。

三、交易风险分析及风控措施

（一）交易风险分析

公司下属子公司进行外汇套期保值业务遵循稳健原则，不进行以投机为目的的外汇交易，所有外汇套期保值业务均以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，以规避和防范汇率风险为目的，但进行外汇套期保值业务也存有一定风险：

1. 汇率波动风险：在外汇汇率波动较大时，判断汇率大幅波动方向与外汇套期保值合约方向不一致时，将造成汇兑损失；若汇率在未来发生波动时，与外汇套期保值合约偏差较大也将造成汇兑损失。

2. 内部操作风险：外汇套期保值业务专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内控制度执行不到位而造成风险。

3. 履约风险：在合约期限内合作金融机构出现倒闭、市场失灵等重大不可控风险情形或其他情形，导致合约到期时不能以合约价格交割原有外汇合约，即合约到期无法履约而带来的风险。

（二）风险控制措施

1. 公司下属子公司制定了相关管理制度，明确了开展套期保值业务的组织机构、审批及权限、业务流程、风险控制、应急处理、合规检查等相关内容。

2. 为避免汇率大幅度波动风险，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，最大限度地避免汇兑损失。

3. 为避免内部控制风险，所有的外汇交易行为均以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，不得进行投机和套利交易，并严格按照相关制度的规定进行业务操作，有效地保证制度的执行。

4. 为控制交易违约风险，只允许与经国家外汇管理局和中国人民银行等监管机构或所在国家及地区金融外汇管理当局批准、具有外汇衍生品交易经营资格的金融机构进行交易，不得与金融机构之外的其他组织或个人进行交易，保证公司外汇衍生品交易管理工作开展的合法性，严格控制交割违约风险的发生。

5. 加强对公司银行账户和资金的管理，严格遵守资金划拨和使用的审批程序。

四、交易对公司的影响及相关会计处理

公司下属子公司进行外汇衍生品交易业务以正常生产经营为基础，以真实的

交易背景为依托，进行风险对冲操作，不涉及杠杆和风险投资，不存在损害公司及中小股东利益的情形。

公司根据财政部《企业会计准则第 22 号-金融工具确认和计量》《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》《企业会计准则第 39 号-公允价值计量》等相关规定及其指南，对拟开展的外汇套期保值业务进行相应的核算处理，反映资产负债表及损益表相关项目。

特此公告。

浙江浙能电力股份有限公司董事会

2024 年 4 月 30 日