

# 中铝国际工程股份有限公司关于 2024 年开展货币类金融衍生业务可行性分析报告

## 一、开展金融衍生业务的基本情况

### （一）业务开展背景

近两年以来，人民币兑美元汇率波动较大，中铝国际工程股份有限公司（以下简称中铝国际或公司）境外工程业务收款以美元为主、支付以境内人民币进行支付，存在外汇敞口，需依靠金融衍生品工具来对美元敞口进行管理。为更好地运用金融衍生工具对冲汇率市场风险、管理及控制、境外项目成本，中铝国际拟申请办理 2024 年度远期锁汇业务。

### （二）拟开展业务的基本情况

1. 业务品种：美元远期结汇。
2. 业务期限：董事会审议通过之日起至 2024 年 12 月 31 日。
3. 业务额度：在上述业务期限内，中铝国际及子公司美元汇率保值额度合计不超过 0.575 亿美元。

## 二、开展金融衍生业务的风险及防控措施

### （一）风险分析

公司开展货币类金融衍生业务将遵循合法、审慎、安全、有效的原则，但金融市场受宏观经济的影响较大，不排除因受到政策风险、市场风险、信用风险、流动性风险、信息传递风险、不可抗力风险等因素影响而出现交易损失，公司将根据经济形势及金融市场的变化适时适量介入，力争将交易

风险降至可承受范围内。

## （二）风险防控措施

1. 严格遵守相关法律、法规、公司内部规章制度及内控流程，按照相关规定开展金融衍生业务。

2. 开展金融衍生业务的子公司已具备完善的业务管理办法和操作流程，明确机构和不相容岗位设置，确定相关责任人，防范操作风险。

3. 开展金融衍生业务的子公司针对自身经营状况、交易处理能力和财务承受能力，合理确定保值额度、价格区间和保值期限。

4. 审慎选择交易对手，选择评级较高、资产规模较大、信誉较好的境内外金融机构。

5. 公司财务资产部、内审部将对金融衍生业务的交易过程和结果进行监督、评价和评估，并向董事会进行汇报。

## 三、开展金融衍生业务对公司的影响

公司及子公司开展货币类金融衍生业务，是在最大程度保证资金安全和正常生产经营的前提下进行的，不存在投机和套利交易行为，不会影响日常经营资金的正常周转和公司主营业务的开展；同时，开展货币类金融衍生业务可在一定程度上规避汇率波动风险，保持企业利润平稳。

综上所述，公司开展货币类金融衍生业务风险可控，具有可行性。

中铝国际工程股份有限公司

2024年3月28日