

香港交易及結算所有限公司及香港聯合交易所有限公司對本公告之內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示概不就因本公告全部或任何部份內容而產生或因倚賴該等內容而引致之任何損失承擔任何責任。



中国神华能源股份有限公司

CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED

(在中華人民共和國註冊成立的股份有限公司)

(股份代碼：01088)

公告

2019年度金融衍生工具業務年度方案

2019年1月29日，中國神華能源股份有限公司(「本公司」)第四屆董事會第十七次會議審議通過了《關於中國神華能源股份有限公司2019年度金融衍生工具業務年度方案的議案》。本公司2019年度金融衍生工具業務年度方案(「金融衍生工具業務年度方案」)具體內容如下：

一、業務目的

因本公司存在並可能繼續發生以外幣計價的債務，在當前人民幣日趨國際化、市場化的宏觀環境下，為有效防範因人民幣匯率波動帶來的外幣債務匯率風險，根據本公司風險管控原則和策略，擬結合實際需要，選擇適合的市場時機開展外匯衍生工具交易業務。

同時，本公司境外建設和運營的項目，因項目貸款為浮動利率的美元貸款，為有效防範因美元利率波動帶來的利率風險，根據本公司風險管控原則和策略，擬結合項目實際需要，選擇適合的市場時機開展美元利率衍生工具交易業務。

此外，本公司擬通過辦理結構性存款提高存款收益。因結構性存款預期收益率與匯率、利率、大宗商品價格等因素掛鉤，為有效防範因匯率、利率、大宗商品價格等因素波動帶來的市場風險，根據本公司風險管控原則和策略，擬結合實際需要，選擇適合的市場時機開展相關金融衍生工具交易業務。

為提前做好相關籌劃和準備工作，以便在有利市場時機下迅速反應、完成交易，本公司制定了金融衍生工具業務年度方案，並經本公司第四屆董事會第十七次會議審議批准。

二．業務品種

本公司擬僅選用遠期、互換、期權，且易於估值的簡單型金融衍生產品作為金融衍生產品的業務品種。

三．業務規模

金融衍生工具業務額度如下：針對日元債務匯率風險，額度為不超過322.04億日元；針對現有美元債務匯率風險，額度為不超過3.17億美元；針對美元債務利率風險，額度為不超過10.69億美元；針對潛在結構性存款市場風險，額度為不超過等值人民幣100億元。

上述額度的設定，均依據對匯率及利率等風險敞口金額的測算，實際執行時將以屆時的風險敞口金額為上限。

本公司沒有任何使用槓桿工具放大上述業務交易規模的計劃。

四．風險分析

1. 市場風險：當市場匯率或利率走勢與預期發生較大偏離時，本公司利用金融衍生工具事先鎖定的外債融資成本，可能高於不進行保值交易情況下發生的成本，從而造成財務成本上的增加。此外，較大的匯率波動也會導致金融衍生工具本身產生大額公允價值變動，如果不能與現有債務做到完全對沖，可能會對本公司賬面損益造成一定影響。
2. 信用風險：如果選定的金融衍生工具交易對手出現信用違約，交割時不按照約定的價格或金額執行，可能導致本公司無法正常通過保值交易彌補對外幣債務還本付息時承擔的匯兌損失。
3. 操作性風險：在從事金融衍生工具業務過程中因人為操作失誤或內部控制機制不完善等主觀和客觀因素，導致交易執行上的不準確或不及時，從而造成交易損失。

五．風險控制措施

1. 明確金融衍生工具的使用目的和原則，堅持以套期保值為目的，充分利用金融衍生工具在對沖和轉移外幣債務風險方面的效用，杜絕一切具有投機目的的高風險交易。在交易工具的使用上嚴格遵循交易配比、反向對沖、平衡損益、簡單性和系統性等交易原則。
2. 根據國家有關法律法規、公司章程和公司授權手冊等相關規定，強化本公司外匯風險內部管控體系建設，建立健全金融衍生工具交易管理制度辦法和流程，清晰界定業務交易審批和執行層面的權責劃分，嚴格分離內控、交易、會計核算崗位人員，確保每一筆金融衍生工具業務交易的合規性和有效性。
3. 僅與具有合法經營資質、信用評級高的大型銀行開展金融衍生工具業務。

六. 會計核算原則

本公司將嚴格遵照中華人民共和國財政部發佈的《企業會計準則》及其指南中有關金融工具的核算規定，對所開展的金融衍生工具交易業務進行相應的核算處理。

請投資者注意，在本公司董事會批准金融衍生工具業務年度方案後，本公司可能在當前市場匯率及利率走勢和波動性預期下開展金融衍生工具交易業務，但是並不意味本公司一定會在2019年度內進行金融衍生工具業務交易。

承董事會命
中國神華能源股份有限公司
董事會秘書
黃清

北京，2019年1月29日

於本公告日期，董事會成員包括執行董事凌文博士、李東博士、高嵩先生及米樹華先生，非執行董事趙吉斌先生，獨立非執行董事譚惠珠博士、彭蘇萍博士、姜波博士、鍾穎潔女士及黃明博士。