

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，概不對因本公告全部或任何部分內容而產生或因倚賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。



中石化煉化工程(集團)股份有限公司
SINOPEC Engineering (Group) Co., Ltd.*

(於中華人民共和國註冊成立的股份有限公司)

(股份代號：2386)

公 告

2019 年度金融衍生工具業務年度方案

2019年3月8日，中石化煉化工程(集團)股份有限公司(簡稱「本公司」)召開第三屆董事會(簡稱「董事會」)第二次會議，審議通過了《關於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美元計價的資產，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美元資產匯率風險，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。

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，並經本公司第三屆董事會第二次會議審議批准。

二 業務品種

本公司開展金融衍生品業務，以套期保值為原則，擬僅選用遠期、掉期、期權等金融衍生產品或上述產品的適當組合作為金融衍生產品的業務品種。

三 業務規模

針對美元資產風險及本公司2018年末美元貨幣資金餘額情況，2019年業務規模不超過15億美元。

上述額度的設定，均依據美元貨幣資金風險敞口的測算，如需調整另行提請董事會審議批准。

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美元資產匯兌成本，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，如果不能與現有資產做到完全對沖，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人民幣匯率升值形成的匯兌損失。

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美元資產匯率風險的效用，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，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

本公司將嚴格遵照國際會計準則委員會發佈的《國際財務報告準則第9號》及其詮釋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。

本公司股東及潛在投資者請注意，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
中石化煉化工程(集團)股份有限公司
桑菁華
副總經理、董事會秘書

中國，北京
2019年3月11日

截至本公告日期止，本公司執行董事為陸東、向文武、孫麗麗(職工代表董事)及周羸冠(職工代表董事)；非執行董事為喻寶才、吳文信；以及獨立非執行董事為許照中、金涌及葉政。

本公告可於香港交易及結算所有限公司網站(www.hkex.com.hk)及本公司網站(www.segroup.cn)內瀏覽。

* 僅供識別