

证券代码: 601016
债券代码: 113051
债券代码: 137801
债券代码: 115102
债券代码: 242007
债券代码: 242008
债券代码: 242932

证券简称: 节能风电
债券简称: 节能转债
债券简称: GC 风电 01
债券简称: GC 风电 K1
债券简称: 风电 WK01
债券简称: 风电 WK02
债券简称: 25 风电 K2

公告编号: 2025-095

关于中节能风力发电股份有限公司 利率掉期业务的公告

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：

● 交易主要情况

交易目的	<input type="checkbox"/> 获取投资收益 <input checked="" type="checkbox"/> 套期保值 (合约类别: <input type="checkbox"/> 商品; <input type="checkbox"/> 外汇; <input checked="" type="checkbox"/> 其他: 利率掉期) <input type="checkbox"/> 其他: _____	
交易品种	利率掉期	
交易金额	预计动用的交易保证金和权利金上限 (单位: 澳元) 预计任一交易日持有的最高合约价值 (单位: 澳元)	不适用 80,000,000
资金来源	<input checked="" type="checkbox"/> 自有资金 <input type="checkbox"/> 借贷资金 <input type="checkbox"/> 其他: _____	
交易期限	本次利率掉期业务期限与实际融资贷款期限保持一致	

● 履行及拟履行的审议程序

本次交易事项已于 2025 年 12 月 5 日经中节能风力发电股份有限公司 (以下简称“公司”) 召开的第六届董事会第五次会议审议通过。

● 特别风险提示

公司进行的利率掉期业务遵循合法、审慎、安全、有效的原则，不以投机为目的，所有利率掉期业务均以具体业务为基础，但仍会存在一定的市场风险、交割风险、履约风险、法律风险等，敬请投资者注意投资风险。

一、交易情况概述

（一）交易目的

按照澳大利亚商业惯例，项目融资通常以项目未来现金流作为还款来源，贷款银行对项目未来现金流的可靠性、稳定性要求较高。公司下属全资子公司中节能风电（澳大利亚）控股有限公司（以下简称“节能澳洲”）的控股子公司白石风电场所有权有限公司（以下简称“白石公司”）为防范利率波动带来的影响，按照项目贷款银行要求，开展利率掉期业务，以降低因利率波动带来的风险敞口，有效控制项目经营成本。

（二）交易金额

利率掉期业务的金额为白石公司境外再融资贷款总额 1.6 亿澳元中的 50%（即 8000 万澳元）。该利率掉期业务不涉及保证金、权利金。

（三）资金来源

本次利率掉期业务资金来源为公司自有资金，不涉及募集资金。

（四）交易方式

本次利率掉期业务交易场所为场外交易，主要结算货币为澳元。

（五）交易期限

本次利率掉期业务期限与实际融资贷款期限保持一致。

二、审议程序

本次交易事项已于 2025 年 12 月 5 日经公司召开的第六届董事会第五次会议审议通过。具体内容详见公司于 2025 年 12 月 6 日在上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）披露的《中节能风力发电股份有限公司第六届董事会第五次会议决议公告》（公告编号：2025-090）。

三、交易风险分析及风控措施

公司进行的利率掉期业务遵循合法、审慎、安全、有效的原则，不以投机为目的，所有利率掉期业务均以具体业务为基础，但仍会存在一定的风险：

（一）市场风险

受市场价格参数变动影响，利率掉期产品交易敞口的市场价值发生变动。如报告期末利率掉期的公允价值较报告期初发生变动，将会对公司当期损益产生影响。

（二）交割风险

利率掉期业务不涉及本金交换，交易双方依据合约约定的名义本金交换利息额，交割风险仅限于应付利息部分。

（三）履约风险

交易对手不能履行合同义务支付掉期收益而对公司造成的风险。该风险主要源于交易对手信用状况恶化、市场波动导致的现金流压力。

（四）法律风险

因相关法律发生变化或交易对手违反相关法律、制度可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失。

三、利率掉期业务的风险控制措施

1、公司制定了《套期保值业务管理制度》，对公司套期保值业务的基本原则、审批权限、管理及内部操作流程、信息保密、内部风险报告制度及风险处理程序等方面做出了明确规定。

2、公司合理选择交易对手，选择规模大、实力强、信誉好的公司进行交易。

3、公司定期开展相关人员的专业知识培训，提高套期保值从业人员的专业素养。

4、公司加强对已开展套期业务的研究分析，实时关注国内外市场环境变化，适时调整业务策略。

5、公司严格遵守国家有关法律法规的规定，防范法律风险，定期对套期保值业务的规范性、有效性进行监督检查，按相关规则要求履行信息披露义务。

四、交易对公司的影响及相关会计处理

公司开展利率掉期业务有利于规避和防范汇率大幅波动带来的风险，增强公司财务稳健性。公司将根据《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 24 号——套期会计》《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》的相关规定及其指南，对利率掉期业务进行相应核算和披露。

套期保值业务是否符合《企业会计准则第 24 号——套期会计》适用条件	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
拟采取套期会计进行确认和计量	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否

利率掉期业务金额为白石公司境外再融资贷款总额 1.6 亿澳元中的 50% (即 8000 万澳元)，根据《上海证券交易所上市公司自律监管

指引第 5 号——交易与关联交易》的有关规定，本次交易金额在董事会审批权限内，无须提交股东会审批。

特此公告。

中节能风力发电股份有限公司

董事 会

2025 年 12 月 6 日