

珠海格力电器股份有限公司

关于 2022 年开展外汇衍生品交易业务的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

重要内容提示：

1、投资种类：本次公司拟投资种类为外汇衍生产品，包括单边外汇远期、外汇期权、低风险收益锁定型存贷款和汇率产品组合、外汇掉期。

2、投资金额：本次公司拟使用总额不超过80亿美元开展各类外汇衍生品交易业务。

3、特别风险提示：外汇衍生品交易虽然存在一定风险，但公司基于真实贸易背景操作，相关风险可控。

根据有关规定，结合珠海格力电器股份有限公司（以下简称“公司”）外汇资金交易管理制度的要求，2022年公司拟继续开展外汇衍生品交易及相关组合业务，现将相关情况说明如下：

一、履行合法表决程序的说明

本次公司拟使用不超过80亿美元开展外汇衍生品交易业务已经2022年4月29日公司第十二届董事会第三次会议、第十二届监事会第二次会议审议通过，尚需提交股东大会审议。董事会提请股东大会授权公司董事会，并同意董事会授权资金运营管理中心具体实施。

根据有关规定，本次拟开展的外汇衍生品交易业务不构成关联交易。

二、拟开展的外汇衍生品交易业务基本情况

1、外汇衍生品交易必要性

公司 2021 年出口收汇金额约 25 亿美元，进口付汇金额约 5 亿美元，为规避上述两项业务的汇率风险，公司有必要开展外汇衍生品交易业务。公司开展外汇衍生品交易业务以进行外汇套期保值、管理进出口业务汇率风险和调剂资金余缺为目的，不存在任何投机性操作。开展外汇衍生品交易业务不会影响公司主营业务的发展。

2、外汇衍生品交易品种

(1) 单边外汇远期、外汇期权；

(2) 低风险收益锁定型存贷款和汇率产品组合（包含互换交易）；

(3) 外汇掉期。

3、合约期限：公司开展的外汇衍生品交易业务的期限均不超过两年。

4、交易对手：具备外汇衍生品交易资质的银行。

5、授权期限及额度：授权期限为自股东大会审议通过之日起 12 个月内，在授权期限内任一时点外汇衍生品交易业务余额上限为 80 亿美元。

6、资金来源：资金来源为公司自有资金或自筹资金，未涉及使用募集资金。

三、管理制度

依据公司《外汇金融衍生工具管理办法》等相关制度执行。

四、开展外汇衍生品交易业务可行性分析

公司开展外汇衍生品交易业务，以进出口贸易背景及未来外汇收支的合理估计为基础，根据公司出口业务的成本情况和进出口业务量开展结汇和外汇掉期业务，在市场波动情况下进行套期保值；根据公司现有外汇业务存量，操作结售汇外汇衍生品交易对冲汇率波动风险；互换交易匹配外汇资产负债需求，规避汇率及利率波动风险；以上外汇衍生品交易的开展存在合理的可行性。

五、外汇衍生品交易的风险提示

1、市场风险

汇率双向波动明显，远期及期权合约汇率与到期日当天实际汇率有差异的可能性，有可能产生亏损，公司以真实的进出口贸易背景及对未来外汇收支的合理估计

签订远期及期权合约，以“风险中性”思想和成本利润原则管理公司进出口业务及外汇头寸汇率风险。

2、违约风险

公司基于真实的进出口贸易背景及对未来外汇收支的合理预计签订上述外汇资金交易合约，不存在履约风险；公司的外汇交易合约选择资信好的商业银行，基本不需考虑其倒闭所带来的违约风险。

3、流动性风险

所有外汇资金交易将满足贸易真实性要求，相关外汇资金交易将采用银行授信的方式进行操作，不会影响公司的流动性。

六、风险管理措施

1、资金运营管理中心依据董事会批准的外汇衍生品交易业务基本情况，基于真实贸易背景及对未来外汇收支的合理估计和业务需求，提出合理评估和具体实施方案。

2、每笔外汇衍生品交易业务实行三级审批制度，即需资金运营管理中心外汇业务主管、资金运营管理中心负责人和公司财务负责人的审批同意后方可执行。

3、资金运营管理中心实时关注外汇衍生品交易业务各项风险因素，市场波动有较大影响时及时预警并制定应对方案。

七、公允价值分析

公司按照《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》进行确认计量，公允价值基本按照合约银行提供的价格厘定，公司每月均进行公允价值计量与确认。

八、会计政策及核算原则

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》相关规定及其指南，公司对已开展的外汇资金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。

九、对公司的影响

公司通过外汇衍生品交易业务，有利于进一步提升公司外汇风险管理能力，实现外汇资产保值增值。公司就相关业务建立了相应的管控制度，审批、执行合法合规，风险可控，符合公司及全体股东的利益。

十、独立董事意见

1、公司开展外汇衍生品交易业务的审批程序符合国家相关法律法规及《珠海格力电器股份有限公司章程》的规定。

2、公司已就外汇衍生品交易业务建立了健全的组织机构、业务操作流程、审批流程，制定了《珠海格力电器股份有限公司远期外汇交易业务内部控制制度》。

3、在保证正常生产经营的前提下，公司开展外汇衍生品交易业务旨在规避进出口业务所面临的汇率风险，整体业务规模与公司实际进出口业务量规模相适应，不存在任何投机性操作，不存在损害公司和全体股东利益的情形。

4、公司报告期内开展外汇衍生品交易业务，严格遵守国家相关法律法规及《公司章程》《珠海格力电器股份有限公司远期外汇交易业务内部控制制度》的规定。

综上，我们认为公司开展外汇衍生品交易业务，有利于进一步提升公司外汇风险管理能力，实现外汇资产保值增值。公司就相关业务建立了相应的管控制度，审批、执行合法合规，风险可控，符合公司及全体股东的利益。我们一致同意公司《关于2022年开展外汇衍生品交易业务的议案》，并同意将该议案提交股东大会审议。

十一、备查文件

- 1、第十二届董事会第三次会议决议；
- 2、第十二届监事会第二次会议决议；
- 3、独立董事关于公司第十二届董事会第三次会议相关事项的独立意见。

特此公告。

珠海格力电器股份有限公司董事会

二〇二二年四月三十日