

证券代码：000651

证券简称：格力电器

公告编号：2023-016

珠海格力电器股份有限公司

关于2023年开展外汇衍生品套期保值业务的公告

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：预计动用的交易保证金和权利金上限（包括为交易而提供的担保物价值、预计占用的金融机构授信额度、为应急措施所预留的保证金等）不超过5亿美元（含等值外币），预计任一交易日持有的最高合约价值不超过80亿美元（含等值外币）。期限内任一时点的交易金额（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）将不超过已审议额度。

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。

珠海格力电器股份有限公司（以下简称“公司”）于2023年4月28日召开了第十二届董事会第十二次会议、第十二届监事会第十次会议，审议通过了《关于2023年开展外汇衍生品套期保值业务的议案》，同意公司根据资金管理模式和日常业务需要，2023年继续开展外汇衍生品交易业务。同时授权公司资金运营管理中心新根据实际需要，在授权期限和额度范围内负责办理相关事宜。本议案尚需提交股东大会审议。本次开展外汇衍生品交易事项不构成关联交易。具体情况如下：

一、开展外汇衍生品交易业务的基本情况

1、投资目的：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) 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3年。

4、交易对手：具备外汇衍生品交易资质的银行。

5、交易金额：预计动用的交易保证金和权利金上限（包括为交易而提供的担保物价值、预计占用的金融机构授信额度、为应急措施所预留的保证金等）不超过5亿美元（含等值外币），预计任一交易日持有的最高合约价值不超过80亿美元（含等值外币）。期限内任一时点的交易金额（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）将不超过已审议额度。

6、授权期限：授权期限为自股东大会审议通过之日起12个月内。

7、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。

二、审议程序

本次公司开展外汇衍生品交易业务已经2023年4月28日召开的第十二届董事会第十二次会议、第十二届监事会第十次会议审议通过，同意公司根据资金管理模式和日常业务需要，2023年继续开展外汇衍生品交易业务。同时授权公司资金运营管理中心根据实际需要，在授权期限和额度范围内负责办理相关事宜。本议案尚需提交股东大会审议。本次开展外汇衍生品交易事项不构成关联交易。

三、开展外汇衍生品套期保值业务的风险分析及风险控制措施

公司拟开展的外汇衍生品交易业务遵循合法、谨慎、稳健、安全和有效的原则，不进行投机性和单纯的套利交易，但外汇衍生品交易操作仍存在一定的风险：

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。

公司依据《远期外汇交易业务内部控制制度》等相关制度开展外汇衍生品交易业务。公司资金运营管理中心依据股东大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。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。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。

四、开展外汇衍生品交易业务对公司的影响

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。

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。

公司根据财政部《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24号——套期会计》《企业会计准则第37号——金融工具列报》相关规定及其指南，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。

五、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《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《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》《远期外汇交易业务内部控制制度》等规定。

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 2023 年开展外汇衍生品套期保值业务的议案》，并同意将该议案提交股东大会审议。

六、备查文件

- 1、第十二届董事会第十二次会议决议；
- 2、第十二届监事会第十次会议决议；
- 3、独立董事关于公司第十二届董事会第十二次会议相关事项的独立意见；
- 4、关于 2023 年开展外汇衍生品套期保值业务的可行性分析报告。

特此公告。

珠海格力电器股份有限公司董事会

二〇二三年四月二十九日