

上海海立(集团)股份有限公司 关于 2024 年度开展外汇衍生品交易业务的公告

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：

● 交易目的：鉴于国际金融环境的不确定性，为了有效控制和规避外汇市场风险，提高公司应对外汇波动风险的能力，防范及降低外汇汇率及利率波动带来的经营风险，增强公司财务稳健性，公司拟开展外汇衍生品交易业务。

● 交易币种及业务品种：限于与公司出口业务及境外经营业务相关的结算币种，包括但不限于美元、日元、欧元等。业务品种主要包括远期结售汇、外汇掉期、货币互换等以防范汇率波动风险为目的的外汇衍生品及产品组合。

● 交易工具：远期合约、期权合约、外汇掉期等。

● 交易场所：经监管机构批准、具有外汇衍生品交易业务经营资质的商业银行等金融机构。

● 交易金额：最高交易余额不超过等值 1.5 亿美元，在有效期内滚动使用；有效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）不超过等值 1.5 亿美元。

● 已履行及拟履行的审议程序：本事项经公司第十届董事会第五次会议、第十届监事会第五次会议审议通过，尚需提交公司 2023 年年度股东大会审议。

● 特别风险提示：公司开展外汇衍生品交易遵循锁定汇率风险的原则，不以投机为目的，但进行外汇衍生品交易仍可能存在汇率波动风险、内部控制风险、流动性风险和履约风险等。敬请广大投资者注意投资风险。

上海海立（集团）股份有限公司（以下简称“公司”）于 2024 年 4 月 26 日召开第十届董事会第五次会议、第十届监事会第五次会议，审议通过了《2024 年度开展外汇衍生品交易业务及可行性分析报告的议案》。因经营需要，公司 2024 年计划开展外汇衍生品交易，该议案尚须提请公司股东大会审议。具体内

容如下：

一、交易情况概述

（一）交易目的

鉴于国际金融环境的不确定性，为了有效控制和规避外汇市场风险，提高公司应对外汇波动风险的能力，防范及降低外汇汇率及利率波动带来的经营风险，增强公司财务稳健性，公司拟开展外汇衍生品交易业务。

公司拟开展的外汇衍生品交易，是为满足公司出口业务及境外经营业务的需要，不进行以投机为目的的外汇交易，不做投机性、套利性的交易操作，只限于与公司出口业务及境外经营业务相关的结算币种。

（二）交易金额

根据公司出口业务及境外经营业务的规模，2024 年度拟开展外汇衍生品交易的最高交易余额不超过等值 1.5 亿美元，在有效期内滚动使用。有效期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）不超过等值 1.5 亿美元。

（三）资金来源

资金来源于公司自有资金，不涉及募集资金。

（四）交易方式

公司开展外汇衍生品交易将选择远期外汇、外汇掉期、货币互换等结构简单透明、流动性强、风险可认知、市场有公开参考价格、不超过 12 个月的外汇衍生工具，并只限于与公司出口业务及境外经营业务相关的结算币种，包括但不限于美元、日元、欧元等。交易场所为经监管机构批准、具有外汇衍生品交易业务经营资质的商业银行等金融机构。

（五）交易期限

本次授权额度的有效期自股东大会审议通过之日起 12 个月。

二、交易风险分析

1、汇率波动风险：外汇波动具有双向性，在远期汇率走势中，可能出现远期外汇交易汇率锁定价格低于结售汇当期公司的记账汇率，造成公司汇兑损失。

2、内部控制风险：远期结售汇交易专业性、时效性较强，可能会由于内控

制度不完善而造成风险。

3、流动性风险：如外汇远期保值业务安排不合理，在到期交割时没有足够的资金供清算，可能引发公司资金流动性风险。

4、履约风险：开展外汇衍生品交易业务存在合约到期无法履约造成违约带来的风险。

三、公司采取的风控措施

公司进行的外汇衍生品交易业务遵循锁定汇率风险的原则，不做投机性、套利性的交易操作，并积极采取相关风险控制措施：

1、公司财务运营部制定了《金融衍生品交易管理办法》，规定了公司的外汇衍生品交易业务以正常生产经营为基础，以有效控制和规避汇率风险为目的，不得进行以投机为目的的外汇交易。要求相关子公司设立外汇风险管理机构，并建立岗位责任制，确保办理不相容岗位相互分离、制约和监督。要求制定预警、止损机制，如遇重大市场及汇率变化时，应及时进行汇总分析，并及时向公司汇报。

2、公司风控管理部监督外汇衍生品交易，将不定期对外汇衍生品交易业务的决策、管理、执行等工作的合规性进行专项审计。

3、为防止资金流动性风险，公司高度重视应收款项的管理，积极催收应收账款，并为出口货款购买了信用保险，从而降低客户拖欠货款引起的流动性风险。

4、公司所有的外汇衍生品交易业务均以真实的经营业务为基础，外汇衍生品合同的外币金额不超过对外汇收支金额的谨慎预测。

四、交易对公司的影响及相关会计处理

公司按照决策、执行、监督职能相分离的原则建立健全相关交易的审批和执行程序，确保相关事宜的有效开展和规范运行，确保资金安全。在符合国家法律法规，并确保不影响公司主营业务正常开展的前提下进行外汇衍生品交易业务，不会影响公司业务的正常开展，有利于提升公司整体抵御风险能力，增强财务稳健性。

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》等相关规

定及其指南，对开展的外汇衍生品交易业务进行核算处理，反映资产负债表及损益表相关项目，具体以年度审计结果为准。

本事项尚需提请股东大会审议。为及时开展外汇衍生品交易，同时提请股东大会授权公司董事会、并同意董事会转授权经营管理层在最高余额范围内决策具体实施情况，签署相关协议及办理相关手续。

特此公告。

上海海立（集团）股份有限公司董事会

2024年4月30日