

上海汽车集团股份有限公司 关于 2024 年度开展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：随着公司海外业务快速拓展，为锁定成本，降低汇率风险，公司拟根据具体情况，通过衍生品交易适度开展外汇套期保值。
- 交易品种：外汇远期。
- 交易金额：公司拟开展的外汇衍生品交易额度为 110 亿美元或等值其他货币，额度使用期限自该事项获董事会审议通过之日起至 2025 年董事会批准新的议案取代本次议案时止。上述额度在期限内可循环滚动使用。
- 已履行的审议程序：经公司董事会审计委员会 2024 年第一次会议事先审议通过后，公司召开第八届董事会第十九次会议，审议通过了《关于 2024 年度开展外汇衍生品交易业务的议案》，以及《关于开展外汇衍生品交易业务的可行性分析报告》。
- 风险提示：衍生品交易业务将面临政策风险、市场风险、交割风险等，敬请投资者注意投资风险。

一、交易情况概述

（一）交易目的

随着公司海外业务快速拓展，外汇收支规模亦同步增长，为锁定成本，降低汇率风险，公司拟通过衍生品交易适度开展外汇套期保值。

（二）交易金额

公司拟开展的外汇衍生品交易额度为 110 亿美元或等值其他货币，额度使用期限自该事项获董事会审议通过之日起至 2025 年董事会批准新的议案取代本次议案时止。上述额度在期限内可循环滚动使

用。

2024 年公司外汇衍生品交易预计动用的交易保证金和权利金不超过 9.4 亿美元或等值其他货币。

（三）资金来源

公司用于开展外汇衍生品业务的资金来源主要为自有资金，不使用募集资金开展外汇衍生品交易。

（四）交易方式

1. 交易类型：公司开展的外汇衍生品交易类型为外汇远期。外汇远期合约是交易双方约定未来买入和卖出货币币种、金额、汇率和期限，到期时按照该协议的约定履行自身义务的合约。

2. 交易对手：为具有外汇衍生品交易业务经营资格、经营稳健且信用良好的国内和国际金融机构、上海汽车集团财务有限责任公司和上汽香港国际金融有限公司。

3. 交割方式：外汇衍生品交易业务到期采用全额交割或净额交割的方式。

4. 交易场所：在外汇敞口所在企业之所在地进行交易：中国境内及自贸区、中国香港、印度、印尼和泰国。

5. 流动性安排：外汇衍生品交易业务以正常外汇资产、负债为依据，业务金额和业务期限与预期收支计划相匹配。

（五）交易期限

投资期限与基础资产期限相匹配，一般不超过 12 个月。

二、审议程序

经公司董事会审计委员会 2024 年第一次会议事先审议通过后，公司召开第八届董事会第十九次会议，以 8 票同意、0 票反对、0 票弃权，审议通过了《关于 2024 年度开展外汇衍生品交易业务的议案》，以及《关于开展外汇衍生品交易业务的可行性分析报告》。同意公司及合并报表范围内子公司为锁定成本、降低风险，在本年度内开展外汇衍生品交易，交易总额不超过 110 亿美元或等值其他货币，预计动用的交易保证金和权利金不超过 9.4 亿美元或等值其他货币。议案的有效期自董事会批准之日起，至 2025 年董事会批准新的议案取代本

议案时止。

三、交易风险分析及风控措施

（一）风险分析

1. 市场风险：远期合约汇率与到期日实际汇率的差异将产生交易损益。

2. 交割风险：实际经营过程中，可能出现终端销售情况恶化导致不能按时回收货款，而引发生衍生品交易缺乏资金交割的风险。

（二）风险防控措施

1. 公司在境内外开展的套期保值业务均有真实的交易背景，仅以锁定风险敞口为目的，与实际外汇收支相匹配，不从事任何形式或实质上的投机性交易。

2. 目前大部分境内外企业套保上限设置在 50%左右，最高不超过 80%。因此，如果有部分应收账款无法按期收回，也不会对套保交易产生交割风险。

3. 境内外衍生品交易企业也会加强对应收账款的管理，积极催收货款，避免或减少应收账款逾期情况发生。如果发生应收账款逾期，将及时对相应衍生品交易进行展期。

四、交易对公司的影响

公司开展远期外汇业务能够规避和防范汇率风险，增强公司应对外汇市场风险的能力，尽可能降低因外汇汇率变动对公司经营造成的不利影响，增强公司财务的稳健性。本次开展外汇衍生品交易业务以正常外汇资产、负债为依据，业务金额和业务期限与预期收支计划相匹配，不进行以投机为目的的交易，不进行超出经营实际需要的复杂衍生品交易，不存在损害公司及股东利益，特别是中小股东权益的情况。

特此公告。

上海汽车集团股份有限公司

董事会

2024 年 3 月 30 日