

珠海格力电器股份有限公司

关于 2022 年开展大宗材料期货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：公司套期保值投资品种主要涉及铜、铝等与公司生产经营相关的大宗材料。

2、投资金额：授权期限内任一时点的持仓合约金额不超过人民币60亿元，流动性保障等值人民币12亿元。

3、特别风险提示：套期保值业务存在固有的价格波动风险、操作风险及流动性风险，公司将积极落实管控制度和风险防范措施，审慎执行套期保值操作，提醒投资者充分关注投资风险。

根据《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第7号——交易与关联交易》《珠海格力电器股份有限公司期货套期保值业务管理办法》等有关规定，结合珠海格力电器股份有限公司（以下简称“公司”）资金管理模式和日常业务需要，2022年公司拟继续开展大宗材料期货套期保值业务，套期保值业务的持仓合约金额不超过人民币60亿元，相关情况如下：

一、履行合法表决程序的说明

本次拟开展的大宗材料期货套期保值业务已经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，尚需提交公司股东大会审议。董事会提请股东大会授权公司管理层具体实施。

根据有关规定，本次拟开展的大宗材料期货套期保值业务不构成关联交易。

二、开展套期保值业务的必要性说明

随着国内期货市场的发展，大宗材料特别是铜、铝等现货的价格基本参照上海期货交易所的价格定价，冶炼商、贸易商、消费者都以交易所每日的金属价格走势作为定价的标准，企业通过期货市场套期保值已成为稳定经营的必要手段。

由于公司铜、铝等原材料需求量很大，材料的价格波动直接影响公司的经营业绩，因此，有必要在期货市场进行套期保值以辅助正常的生产经营活动，公司严格根据生产经营对大宗材料的需求规模确定开展套期保值的业务规模，同时公司建立期货风险测算系统，加强套期保值的风险管控。

三、开展套期保值业务的可行性说明

公司已制定《期货套期保值业务管理办法》，对套期保值业务范围的审核流程、审批权限、风险管理等作出了明确的规定。将套期保值业务与公司生产经营相匹配，合理选择保值月份，避免市场流动性风险。对于大宗原材料套期保值业务所需的保证金等资金调拨，以公司目前自有资金规模能持续且稳定提供其所需流动性。因此，公司大宗原材料开展套期保值业务是切实可行的。开展大宗原材料套期保值业务不会影响公司主营业务的发展。

四、拟开展的大宗材料套期保值业务概述

1、套期保值金额及品种：套期保值业务的持仓合约金额不超过人民币60亿元，期限内任一时点的交易金额（含前述投资的收益进行再投资的相关金额）不应超过该投资额度。公司拟开展的大宗材料套期保值品种为铜、铝，涉及的主要结算币种为人民币、美元。

2、套期保值额度使用期限：额度有效期自公司股东大会审议通过之日起 12 个月。

3、合约期限：公司所开展的所有大宗材料套期保值业务期限不超过1年。

4、交易对手：大宗材料生产商、期货经纪公司、银行。

5、流动性保障安排：等值人民币12亿元。

6、资金来源：资金为公司自有闲置资金，未涉及使用募集资金。

7、其他安排：公司拟开展的套期保值业务主要使用现汇，额度比例及交易的杠杆倍数一般在10以内，到期采用差额平仓或实物交割的方式。

五、套期保值业务风险应对

1、市场风险：为规避市场大宗材料价格波动带来的经营风险，作为大宗材料消费者，公司将根据生产经营的实际情况，选择合适的套期保值时机与恰当的保值数量比例，避免由于现货与期货基差变化异常或过度保值造成重大损失。

2、流动性风险：公司根据生产需求产生的大宗材料采购计划，适时在期货市场

进行保值，保值时考虑月份合约的流动性和月份合约间基差，尽量选择流动性好的期货合约，避免由于流动性差造成建仓成本和平仓成本提高。对远月有需求但远月合约流动性差，基差不合理的考虑利用近月合约保值再滚动移仓方式操作。

3、履约风险：由于国内大宗材料套期保值是在期货交易所交易系统进行电子化交易，各客户的保证金由证监会旗下的保证金监管中心监管，基本不存在履约风险。

4、强平风险：期货交易采取的是保证金收取制度，公司将对保证金与持仓之间的额度作出合理安排，避免由于持仓过大而市场反转时被强平造成损失。

六、风险管理策略的说明

公司套期保值业务仅限于各单位生产所需原材料保值、避险的运作，严禁以逐利为目的而进行的任何投机行为，保值数量控制在需求量的合理比例。针对已确定产品价格的订单，适时在期货市场对原料进行买入保值锁定原材料价格，针对未确定产品价格的订单，依据对整体金融与商品市场的深入分析，采取一定比例进行买入保值。

在制定套期保值计划同时制定资金调拨计划，防止由于资金问题造成机会错失或持仓过大保证金不足被强行平仓风险。

套期保值计划设定止损目标，将损失控制在一定的范围内，防止由于市场出现系统性风险造成严重损失。

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，公允价值基本按照银行、路透系统等定价服务机构等提供或获得的价格厘定，企业每月均进行公允价值计量与确认。

八、会计政策及核算原则

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37号——金融工具列报》相关规定及其指南，对已开展的衍生品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

公司开展大宗材料期货套期保值业务，主要为了规避大宗材料价格波动给公司带来的不利影响，有效管理生产成本，控制经营风险，保障经营利润，提高经营管理水平。同时，公司就套期保值业务建立了相应的管控制度和风险防范措施，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、公司开展大宗材料期货套期保值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、公司已就大宗材料期货套期保值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期货套期保值业务管理办法》。

3、在保证正常生产经营的前提下，公司大宗材料期货套期保值业务仅限于各单位生产所需原材料的保值、避险等运作，不存在以逐利为目的而进行的投机行为，有利于锁定公司的生产成本，提高公司抵御原材料价格波动的能力，控制经营风险，不存在损害公司和全体股东利益的情形。

4、公司报告期内开展大宗材料期货套期保值业务严格遵守国家相关法律法规及《珠海格力电器股份有限公司章程》《珠海格力电器股份有限公司期货套期保值业务管理办法》的规定。

综上，我们认为公司开展大宗材料期货套期保值业务，有利于锁定生产成本，控制经营风险，提高经营管理水平。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年开展大宗材料期货套期保值业务的议案》，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