

## 珠海格力电器股份有限公司

### 关于2023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。

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年开展大宗材料期货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，同时授权公司经营管理层在额度范围内行使相关决策权、签署相关合同文件。额度有效期自公司股东大会审议通过之日起12个月。本议案尚需提交股东大会审议。本次开展大宗材料期货套期保值业务不构成关联交易。具体情况如下：

#### 一、开展大宗材料期货保值业务的基本情况

**1、投资目的：**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。公司拟开展大宗材料期货套期保值业务，主要为充分利用期货市场的套期保值功能，有效控制市场风险，规避或减少因大宗材料价格发生不利变动引起的损失，降低大宗材料价格变动对公司生产经营的影响，提升整体抵御风险能

力，增强财务稳健性，促进公司健康稳定发展。公司开展的套期保值业务不会影响公司主营业务的发展，资金使用安排合理。

2、投资金额：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。

3、投资方式：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。

4、投资额度使用期限：额度有效期自公司股东大会审议通过之日起12个月。

5、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。

6、交易对手：大宗材料生产商、期货经纪公司、银行。

7、流动性保障安排：等值人民币12亿元。

8、资金来源：资金为公司自有闲置资金，未涉及使用募集资金。

9、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。

## 二、审议程序

本次拟开展的大宗材料期货套期保值业务已经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，同时授权公司经营管理层在额度范围内行使相关决策权、签署相关合同文件。本议案尚需提交股东大会审议。本次开展大宗材料期货套期保值业务不构成关联交易。

## 三、开展大宗材料期货套期保值业务的风险分析及风控措施

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。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、部门设置与人员配备、内部风险报告、风险管理等作出了明确的规定。但大宗材料市场仍存在一定的风险：

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。

#### **四、开展大宗材料期货套期保值业务对公司的影响**

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。

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。

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。

#### **五、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《公司章程》等规定。

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《公司章程》《期货套期保值业务管理办法》等规定。

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2023年开展大宗材料期货套期保值业务的议案》。

## 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年开展大宗材料期货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