

证券代码：600104  
债券代码：155709  
债券代码：155847

证券简称：上汽集团  
债券简称：19 上汽 01  
债券简称：19 上汽 02

公告编号：临 2022—026

## 上海汽车集团股份有限公司 关于 2022 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个别及连带责任。

### 重要内容提示：

- 衍生品交易范围：外汇远期、外汇掉期、利率掉期和货币掉期等
- 衍生品交易额度：72 亿美元或其他等值货币
- 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、衍生品交易业务概述

1、交易目的：为锁定成本、降低汇率和利率风险，公司及合并报表范围内子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，同时还拟通过利率掉期和货币互换锁定相关贷款的汇率和利率风险。

2、衍生品交易的范围：外汇远期、外汇掉期、利率掉期和货币掉期等。

3、衍生品交易年度额度：72 亿美元或其他等值货币（约占 2021 年营业总收入 5.89%）。

4、衍生品交易的期限：与基础资产交易期限或所对冲的敞口期限相匹配，一般不超过三年。

### 二、董事会审议和表决情况

2022 年 4 月 28 日，公司第八届董事会第八次会议，以 7 票同意、0 票反对、0 票弃权，审议通过了《关于 2022 年度开展衍生品交易业务的议案》，同意公司及合并报表范围内子公司在 72 亿美元或其他等值货币的额度内，开展外汇远期、外汇掉期、利率掉期和货币掉期

等衍生品交易，衍生品交易的期限为与基础资产交易期限或所对冲的敞口期限相匹配，一般不超过三年。议案的有效期限自董事会批准之日起，至 2023 年董事会批准新的议案取代本议案时止。

### **三、风险分析及应对措施**

受疫情、地缘政治、经济环境等因素影响，开展衍生品交易业务将面临政策风险、市场风险、交割风险等，公司开展衍生品交易业务，将遵循合法、审慎、安全、有效的原则。公司已建立《金融衍生工具管理》等内控制度，后续将持续健全和完善相关内控制度，控制投资风险，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，聚焦主业，以“锁风险”为核心，在具体实施中，公司及合并报表范围内子公司在各自衍生品交易范围和额度内，按照内控制度规定的衍生品交易审批流程进行操作，并将及时评估已交易衍生品的风险敞口变化情况。

### **四、对公司的影响**

公司及合并报表范围内子公司开展衍生品交易业务，是在保证资金安全和正常生产经营的前提下进行的，不进行以投机为目的的交易，不会影响公司日常资金的正常周转及公司主营业务的正常开展。公司及合并报表范围内子公司开展衍生品交易业务，以锁定成本、降低汇率和利率风险为目标，可以一定程度上规避汇率和利率风险，尽可能降低市场价格波动对主营业务以及财务报表的负面影响。公司将在相关事项实际发生后，结合实际情况履行信息披露义务。

### **五、独立董事意见**

公司及合并报表范围内子公司 2022 年度拟开展衍生品交易，公司充分评估开展交易的可行性与必要性，并已遵循合法、审慎、安全、有效的原则，建立健全内控制度，控制投资风险，相关事项及其审议、表决等程序符合有关法律法规和《公司章程》的规定，不存在损害公司和中小股东权益的情况。同意公司及合并报表范围内子公司在相关范围、额度和期限内开展衍生品交易业务。

特此公告。

上海汽车集团股份有限公司

董事会

2022年4月30日