

上海海立(集团)股份有限公司

关于 2026 年度开展外汇衍生品交易的公告

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：

● 交易主要情况

交易目的	<input type="checkbox"/> 获取投资收益 <input checked="" type="checkbox"/> 套期保值（合约类别： <input type="checkbox"/> 商品； <input checked="" type="checkbox"/> 外汇； <input type="checkbox"/> 其他：_____） <input type="checkbox"/> 其他：_____	
交易品种	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	
交易金额	预计动用的交易保证金和权利金上限（单位：万元）	人民币4,500万元
	预计任一交易日持有的最高合约价值（单位：万元）	25,000万美元或等值外币
资金来源	<input checked="" type="checkbox"/> 自有资金 <input type="checkbox"/> 借贷资金 <input type="checkbox"/> 其他：___	
交易期限	自公司2025年年度股东会审议通过之日起12个月	

● 已履行及拟履行的审议程序

上海海立（集团）股份有限公司（以下简称“公司”）于2026年4月3日召开第十届董事会第十八次会议，审议通过了《2026年度开展外汇衍生品交易业务及可行性分析报告的议案》，该议案尚需提交公司2025年年度股东会审议。

● 特别风险提示

公司开展外汇衍生品交易业务系基于实际发展需要，遵循合法、谨慎、安全和有效的原则，不进行投机性、套利性交易。但由于汇率变动的复杂性

和不可预测性，业务开展中依然会存在一定的风险，包括市场风险、内部控制风险、流动性风险、履约风险等。敬请广大投资者注意投资风险。

一、交易情况概述

（一）交易目的

当前全球地缘政治冲突持续、美联储货币政策调整节奏存在不确定性，国际外汇市场波动加剧，对公司出口业务及境外经营的营收核算、汇兑损益产生直接影响。为进一步强化汇率风险中性管理，有效规避和控制公司出口收汇、境外经营衍生的外汇资产与负债面临的汇率、利率波动风险，增强公司财务抗风险能力，公司拟结合日常经营资金需求与外汇收支节奏，择机与合规金融机构开展外汇衍生品交易业务。

（二）交易金额

结合公司出口业务及境外经营业务的规模，本次拟开展外汇衍生品交易业务的最高余额不超过等值 2.5 亿美元，在此额度内滚动使用；有效期限内任一时点的合约金额(含前述交易的收益进行再交易的相关金额)不超过等值 2.5 亿美元。预计动用的交易保证金和权利金上限不超过人民币 4,500 万元。

（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

公司及子公司将严格遵循汇率风险中性原则，根据外汇收支合同需求，选择期限不超过 12 个月、结构透明、流动性强、市场价格公开的外汇衍生工具，不开展投机性、套利性交易。

交易币种只限于与公司及子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。交易对手为经监管机构批准、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会审议通过之日起 12 个月。

二、审议程序

公司已于 2026 年 4 月 3 日召开第十届董事会第十八次会议，审议通过了《2026 年度开展外汇衍生品交易业务及可行性分析报告的议案》，同意公司开展外汇衍生品交易业务。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，公司拟开展外汇衍生品交易业务的最高余额不超过等值 2.5 亿美元，在此额度内滚动使用；有效期限内任一时点的合约金额（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）不超过等值 2.5 亿美元。预计动用的交易保证金和权利金上限不超过人民币 4,500 万元。该议案尚须提请公司股东会审议。

三、交易风险分析及风控措施

（一）交易风险分析

公司进行的外汇衍生品交易业务遵循合法、谨慎、安全和有效的原则，坚持汇率中性管理理念，不做投机性、套利性的交易操作，所有外汇衍生品交易业务均以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，以规避和防范汇率风险为目的。但是进行外汇衍生品交易业务也会存在一定的风险，主要包括：

1、市场风险：若人民币汇率出现超出预期的大幅单边波动，可能导致公司已锁定的汇率与市场实时汇率产生偏离，从而形成汇兑损益波动；同时外汇衍生品存续期内的公允价值变动，可能对当期财务报表产生阶段性影响。

2、内部控制风险：外汇衍生品交易对专业研判、操作时效要求较高，若内部流程管控不到位，可能出现操作失误、决策滞后或信息传递不及时的风险。

3、流动性风险：外汇衍生品以公司外汇资产、负债为依据，与实际外汇收支相匹配，如业务安排不合理，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：若交易对手出现经营风险或履约能力下降，可能导致合约无法正常交割，引发交易违约风险。

（二）风控措施

为尽可能降低外汇衍生品交易业务的上述风险，公司将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、强化应收账款管理与资金调度，通过出口信用保险降低货款拖欠风险，提前规划交割资金，避免流动性风险。

4、公司所有的外汇衍生品交易业务均以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，不得进行投机和套利交易，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，有助于公司锁定汇率成本，降低汇兑损益波动，提升财务稳健性与抗风险能力。

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》及《企业会计准则第 39 号—公允价值计量》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。

套期保值业务是否符合《企业会计准则第 24 号——套期会计》适用条件	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
拟采取套期会计进行确认和计量	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否

本事项尚需提请股东会审议。为及时开展外汇衍生品交易，同意提请股东会授权公司董事会、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
2026年4月8日