

证券代码：000027 证券简称：深圳能源 公告编号：2026-033

公司债券代码：149676	公司债券简称：21 深能 01
公司债券代码：149677	公司债券简称：21 深能 02
公司债券代码：149927	公司债券简称：22 深能 02
公司债券代码：149984	公司债券简称：22 深能 Y2
公司债券代码：148628	公司债券简称：24 深能 Y1
公司债券代码：148687	公司债券简称：24 深能 01
公司债券代码：524032	公司债券简称：24 深能 Y2
公司债券代码：524352	公司债券简称：25 深能 YK01
公司债券代码：524705	公司债券简称：26 深能 Y1
公司债券代码：524744	公司债券简称：26 深能 Y2
公司债券代码：524972	公司债券简称：26 深能 Y3
公司债券代码：524973	公司债券简称：26 深能 Y4

深圳能源集团股份有限公司 关于燃气控股公司使用外汇远期工具开展 外汇套期保值业务的公告

公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、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. 交易目的、交易品种、交易工具、交易场所及交易金额：为有效防范汇率波动风险，深圳能源集团股份有限公司（以下简称：公司）控股子公司深圳能源燃气投资控股有限公司（以下简称：燃气控股公司）拟使用外汇远期结售汇工具开展外汇套期保值业务，仅限于与具有外汇套期保值业务经营资格的金融机构进行交易，自董事会审议通过后12个月内燃气控股公司套期保值业务总规模（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）拟不超过6亿美元（或等值外币），且任

一交易日交易金额拟不超过2亿美元（或等值外币）。

2. 已履行的审议程序：本次开展外汇套期保值业务事项已经 2026 年 9 月 11 日召开的董事会审计与风险管理委员会 2026 年第六次会议及 2026 年 9 月 14 日召开的董事会八届五十四次会议审议通过。根据公司《章程》，本次开展外汇套期保值业务事项不需提交公司股东会审议。

3. 风险提示：本次开展外汇套期保值业务事项严格遵循非盈利原则，仅对冲实需付汇敞口，不影响公司主业发展，但在外汇套期保值业务开展过程中仍存在一定的风险，包括但不限于信用风险、汇率波动风险、内部控制风险、流动性风险、经济、法律及政策风险、操作风险等。

一、投资情况概述

（一）投资目的

燃气控股公司主要从事天然气大宗物资进出口贸易以及燃气项目开发、投资、建设和运营管理，其国际天然气采购业务合同结算外币以美元为主。随着燃气控股公司业务规模持续拓展壮大，外汇收支规模逐年攀升，叠加国际外汇市场波动加剧及汇率不确定性持续增大影响，燃气控股公司亟须规范开展外汇套期保值业务，以有效防范化解汇率波动带来的经营风险。外汇远期合约是套期工具，天然气进出口贸易合同预期收付汇及手持外币资金是被套期项目。套期工具的公允价值或现金流量变动能够降低汇率风险引起的被套期项目公允价值或现金流量的变动程度，从而达到风险相互对冲的经济关系，实现套期保值的目的。

燃气控股公司拟开展的套期保值业务旨在锁定其生产经营的收入、成本或风险敞口，与燃气控股公司实际业务、资金实力、交易处理能力和人员专业能力相匹配，不以投机为目的。本次开展套期保值业务严格遵循非盈利原则，围绕天然气贸易主业进行风险对冲，所有操作均服务于主业稳健经营、锁定经营成本与收入，不会影响公司主营业务正常发展；资金安排合理合规，资金使用与业务规模、风险承受能力相匹配，不占用额外非正常资金，符合公司资金管理要求。

（二）交易金额

本次开展外汇套期保值业务事项只涉及授信占用，不存在实际动用交易保证金和权利金的情况，预计占用金融机构的授信额度不超过 1 亿美元（或等值外币）；

本次开展外汇套期保值业务总规模（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）不超过 6 亿美元（或等值外币），且任一交易日交易金额不超过 2 亿美元（或等值外币）。

（三）交易方式

本次燃气控股公司拟采用与具有外汇套期保值业务经营资格的金融机构签订外汇远期合约的方法开展场外交易，交易品种为外汇远期结售汇。

（四）交易期限

自公司董事会审议通过之日起 12 个月止。

（五）资金来源

燃气控股公司自有资金，不涉及使用募集资金或银行信贷资金。

二、审议程序

本次开展外汇套期保值业务事项已经 2026 年 9 月 11 日召开的董事会审计与风险管理委员会 2026 年第六次会议及 2026 年 9 月 14 日召开的董事会八届五十四次会议审议通过。根据公司《章程》，本次开展外汇套期保值业务事项不需提交公司股东会审议。

三、交易风险分析及风控措施

（一）交易风险

外汇套期保值业务开展过程中存在一定的风险，包括但不限于信用风险、汇率波动风险、内部控制风险、流动性风险、经济、法律及政策风险、操作风险等。

（二）针对交易风险，拟采取风险控制措施如下：

1. 公司将选择经政府部门批准、具备相关业务资质、信用良好的金融机构合作，交易外汇远期产品，降低履约风险。

2. 公司坚持远期汇率与实际业务相匹配的原则，以锁定交易采购业务成本为目的，坚持风险中性原则，以减少汇率波动对公司正常经营业务影响为主要目的，所有的外汇交易行为均以确定性订单为基础，禁止进行投机或套利交易。

3. 完善内部控制风险管理体系。公司制定了《外汇交易管理标准》，燃气控股公司已制定《外汇套期保值业务管理标准》，对外汇套期保值业务的审批权限、

组织机构设置及职责划分、授权管理、执行流程和风险管理等予以明确规定，在业务操作过程中，将严格按照前述制度执行；确定相关业务部门作为外汇套期保值业务的经办部门，负责外汇套期保值业务的管理，包括计划制订、资金筹集、日常管理等；将设置内部审计人员应对外汇套期保值交易业务的实际操作情况，定期评估各类风险，对资金使用情况及盈亏情况进行审查，并将审查情况向公司报告。

4. 单笔交易授信占用不超过授信总额度的 50%；建立动态监控系统，实时跟踪可用授信余额并预留 20%流动性缓冲；定期开展极端汇率压力测试，预判资金缺口；与合作银行积极拓展授信规模，确保紧急融资渠道畅通，保障业务稳健运行。

5. 加强业务人员外汇套期保值业务法律法规及相关政策的培训及研究，提升团队专业技能和业务水平，提高业务人员风险意识和应对能力。制定科学合理的评价标准，重点考核业务人员是否按照规定的制度、流程和外汇套期保值策略操作。

四、交易相关会计处理

公司将按照《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》等相关规定及其指南，对本次外汇套期保值业务进行相应的核算处理及披露。

五、董事会审议情况

（一）同意《关于深圳能源燃气投资控股有限公司开展外汇套期保值业务的可行性分析报告》。

（二）同意燃气控股公司使用外汇远期结售汇工具开展外汇套期保值业务，任一时点开展外汇套期保值业务总规模（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）不超过6亿美元（或等值外币），且任一交易日交易金额不超过2亿美元（或等值外币），额度使用期限自公司董事会审议通过之日起12个月止。交易币种仅限于与燃气控股公司经营所使用的主要结算货币相同的币种，主要外币币种为美元。

六、备查文件

- （一）经与会董事签字并加盖公章的公司董事会八届五十四次会议决议；
- （二）董事会审计与风险管理委员会2026年第六次会议审议证明文件；
- （三）《关于深圳能源燃气投资控股有限公司开展外汇套期保值业务的可行性分析报告》。

深圳能源集团股份有限公司 董事会

二〇二六年九月十五日