

一汽解放集团股份有限公司

关于开展金融衍生品套期保值交易业务的公告

本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. 一汽解放集团股份有限公司（以下简称“公司”）及所属部分子公司根据业务发展需要，为降低汇率波动风险、锁定海外销售利润、保持公司财务稳健和经营稳定，拟使用自有资金开展总额度不超过22.5亿元人民币或等值外币的金融衍生品业务交易，涉及品种为远期、期权。使用期限自公司董事会审议通过之日起12个月内有效。在前述额度及决议有效期内，可循环滚动使用，期限内任一时点的金融衍生品投资余额不得超过审议额度。

2. 本次拟开展的金融衍生品套期保值交易业务已通过公司第十届董事会第三十五次会议审议，无需提交公司股东会审议批准。

3. 公司开展金融衍生品交易须遵循合法谨慎、安全有效原则，不开展任何形式的投机交易，但金融衍生品交易存在一定的市场风险、流动性风险、履约风险、政策风险等。敬请投资者注意投资风险。

公司于2026年3月26日召开第十届董事会第三十五次会议，审议通过了《关于开展金融衍生品套期保值交易业务的议案》，具体内容如下：

一、投资情况概述

1. 投资目的：随着海外业务不断拓展，全球产业布局的稳步推进，公司结算币种逐渐丰富、结算量日渐增加、外汇敞口不断扩大，为有效降低外汇市场汇率波动的风险、锁定海外销售利润、增强公司财务稳健性，公司及所属部分子公司为满足正常经营需要，根据具体业务实际情况，拟通过远期、期权对实货经营产生的外汇风险敞口开展套期保值业务，进行风险对冲，降低汇兑损益波动。目前，外汇市场波动幅度加大，公司主营业务利润受汇率波动影响较大，导致公司经营不确定因素增加。为锁定销售利润、防范汇率波动风险，公司有必要根据具

体情况，适度开展金融衍生品交易，增强财务韧性。

2. 交易金额：公司拟使用自有资金开展总额度不超过**22.5**亿元人民币或等值外币的金融衍生品业务交易，前述额度在期限内可循环滚动使用，但期限内任一时点的投资余额（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）不得超过**22.5**亿元人民币或等值外币。

3. 交易方式：公司拟开展的金融衍生品交易类型包括：远期、期权。交易场所为具有金融衍生品交易资格、经营稳健且资信良好的金融机构。

4. 交易期限：自公司董事会审议通过之日起**12**个月内，上述额度在期限内可循环滚动使用。如单笔交易的存续期超过了决议的有效期限，则决议有效期限自动顺延至该笔交易终止。同时，董事会授权公司财经委员会在额度范围内和有效期内行使决策权并明确有交易权限的人员名单。

5. 资金来源：公司主要以自有资金开展业务，不涉及使用募集资金、拆入资金或银行及非银行金融机构提供的借款从事衍生品业务。

二、审议程序

（一）董事会审议情况

2026年3月26日，公司召开第十届董事会第三十五次会议，审议通过了《关于开展金融衍生品套期保值交易业务的议案》。根据《深圳证券交易所股票上市规则》《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》等相关规定，本次金融衍生品交易业务事项无需提交公司股东会审议，该事项不构成关联交易。

（二）董事会审计与风险控制委员会审议情况

经审议，公司董事会审计与风险控制委员会认为：公司及所属部分子公司开展金融衍生品交易符合公司实际经营的需要，有利于降低汇率波动带来的风险，不存在损害公司及股东利益的情形。公司已制定金融衍生品交易相关管理制度，有利于加强金融衍生品交易的风险管理和控制，同意公司及所属部分子公司使用自有资金开展总额度不超过**22.5**亿元人民币或等值外币的金融衍生品业务交易。同意本次开展金融衍生品套期保值交易业务并提交董事会审议批准。

三、交易风险分析及风险措施

（一）交易风险分析

1. 市场风险

金融衍生品交易合约的汇率与到期日实际汇率的差异将产生交易损益，在金融衍生品的存续期内，每一会计期间将产生重估损益，至到期日重估损益的累计值等于交易损益。

2. 流动性风险

开展金融衍生品业务存在因市场流动性不足而无法完成交易的风险。

3. 履约风险

开展金融衍生品业务存在合约到期交易对手无法履约造成违约而带来的风险。

4. 政策风险

交易市场的法律法规等政策如发生重大变化，可能引起市场波动或无法交易而带来的风险。

5. 其他风险

金融衍生品交易业务专业性较强，复杂程度较高，开展业务时，若相关业务人员未及时、充分地理解衍生品信息或未按规定操作而带来的风险。

（二）风险防控措施

1. 公司开展的金融衍生品交易品种均为与基础业务密切相关的简单金融衍生品，且该类衍生品与基础业务在品种、规模、方向、期限等方面相互匹配。公司开展业务坚持风险中性原则，不得开展单纯以盈利为目的的投机和套利交易，从而影响公司主营业务的发展，确保开展该业务所使用的资金安排合理。

2. 公司已制定严格的《金融衍生品交易业务管理制度》，对金融衍生品交易的基本原则、审批权限、部门设置与人员配备、内部操作流程、内部风险报告制度及风险处理程序、信息保密及隔离措施等作了明确规定，并成立专业外汇管理团队，配备专业人员进行衍生品交易，规避操作风险。

3. 公司开展金融衍生品交易对手均为信用良好且与公司建立长期业务往来的金融机构，履约风险低。公司将审慎审查与符合资格的金融机构签订的合约条款，严格执行风险管理制度，防范法律风险。

4. 公司内部审计部门负责定期对金融衍生品交易情况进行审查和评估。

四、交易相关会计处理

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》等相关规定及其指南，选择合适的会计准则对金融衍生品交易业务进行会计处理及账务核算。

五、备查文件

1. 董事会决议及公告；
2. 可行性分析报告；
3. 相关内控制度；
4. 深交所要求的其他文件。

特此公告。

一汽解放集团股份有限公司

董 事 会

2026 年 3 月 28 日