

深圳长城开发科技股份有限公司 关于开展金融衍生品交易业务的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

重要内容提示：

1、交易品种：深圳长城开发科技股份有限公司（以下简称“公司”）及下属子公司开展的金融衍生品交易品种均为与公司实际业务密切相关的外汇及利率互换衍生品，包括但不限于远期结售汇、外汇掉期、平仓业务和利率互换等。

2、交易额度：根据公司实际业务情况，公司及下属子公司在净买入或净卖出余额不超过等值15亿美元（含等值外币）的额度范围内，开展外汇掉期和远期结售汇业务，及开展不超过等值5亿美元的额度范围内的利率互换业务；上述额度有效期为股东大会审议通过之日起12个月，有效期内可循环滚动使用。

3、交易履行的审议程序：本事项已经公司第十届董事会第十一次会议审议通过，尚需提交公司股东大会审议。

4、特别风险提示：公司及下属子公司开展金融衍生品交易业务是为了更好地应对汇率和利率波动风险，降低汇率和利率波动对公司利润的不利影响，减少汇兑损失，降低财务费用，不从事以投机为目的的衍生品交易，但衍生品交易业务操作过程中仍存在一定的市场风险、流动性风险、履约风险、操作风险以及法律风险等。

一、开展的衍生品业务概述

1、交易目的：公司及下属子公司在日常经营过程中涉及大量进出口业务，存在大量外币收付需求，同时也会产生大量存货、应收、预付等美元资产。近年来受国际政治、经济形势等因素影响，汇率和利率震荡幅度加大，外汇市场风险显著增加。因此公司拟通过开展金融衍生品交易锁定未来进口付汇成本和出口收汇利润，目的是降低汇率和利率波动对公司利润的不利影响，减少汇兑损失，降低财务费用。该业务不会影响公司日常经营和主营业务的发展，公司将根据实际情况合理安排资金的使用。

2、交易金额：根据公司实际业务情况，公司及下属子公司在任意时点开展外汇掉期和远期结售汇业务的净买入或净卖出余额不超过等值15亿美元（含等值外

币)及开展不超过等值5亿美元的额度范围内的利率互换业务。

预计动用的交易保证金(包括为交易而提供的担保物价值、预计占用的金融机构授信额度、为应急措施所预留的保证金等)不超过1.2亿美元。

3、交易方式:公司开展外汇衍生品交易业务和利率互换业务的交易对手为具有合法资质且信用级别高的大型商业银行。公司开展的金融衍生品交易品种主要包括远期结售汇、平仓和利率互换等,交易品种与公司实际业务在品种、规模、方向、期限、币种等方面紧密相关。

4、交易期限:有效期自股东大会审议通过之日起12个月内,有效期内交易金额及保证金额度可循环滚动使用。

5、资金来源:资金来源为公司自有资金,不存在使用募集资金或银行信贷资金的情形。

二、审议程序

1、2025年8月26日,公司第十届董事会第十一次会议审议通过了《关于开展金融衍生品交易业务的议案》,同意公司及下属子公司于股东大会审议通过相关事项之日起12个月内,在净买入或净卖出余额不超过等值15亿美元(含等值外币)的额度范围内开展外汇掉期和远期结售汇业务和开展不超过等值5亿美元的额度范围内的利率互换业务。

2、以上事项不构成关联交易,不需要履行关联交易表决程序,此议案需提请公司股东大会审议。

三、衍生品业务的风险分析

1、市场风险。公司开展的金融衍生品交易,存在因汇率波动导致金融衍生品价格变动而造成衍生品单边亏损的市场风险。

2、流动性风险。需保证在交割时拥有足额资金供清算,并通过平仓或展期交易控制风险,保障交易目标的实现。

3、履约风险。公司金融衍生品交易对手均为信用良好且与公司已建立长期业务往来金融机构,基本不存在履约风险。

4、其它风险。在开展业务时,如操作人员未按规定程序进行金融衍生品操作

或未充分理解金融衍生品业务信息，将带来操作风险；如交易合同条款不明确，将可能面临法律风险。

四、公司采取的风险管理措施

1、公司开展的远期结售汇业务、外汇掉期以及平仓交易以套期保值为目的，公司会考虑业务的报价等情况，总体业务达到一定的盈利水平的前提下才开展金融衍生品业务。

2、公司进行外汇衍生品交易必须基于公司外币收（付）款的谨慎预测，外汇衍生品交易合约的外币金额需与外币收（付）款的谨慎预测量相匹配。

公司的外币贷款规模须基于公司的外币付汇预测，故利率互换业务须基于公司的外币贷款预测，利率互换合同的外币金额不得超过外币贷款额度之内。

3、公司开展的远期结售汇业务、外汇掉期以及平仓交易的规模水平主要由公司主营业务所需要的结汇规模来决定。

4、公司已经制定了《深圳长城开发科技股份有限公司远期外汇交易业务内部控制制度》，对公司进行远期外汇交易业务的风险控制、审议程序、后续管理等作出了明确规定。根据该项制度公司成立了由财务总监等相关负责人组成的工作小组，负责具体金融衍生品业务。

5、公司参与金融衍生品业务的人员都已充分理解远期外汇交易业务及利率互换业务的特点及风险，严格执行金融衍生品的业务操作和风险管理制度。

五、交易相关会计处理

1、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—套期保值》《企业会计准则第37号—金融工具列报》等相关规定及其指南，对拟开展的外汇衍生品交易业务及利率互换业务进行相应的核算和列报；并按照《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》进行确认计量，公允价值基本按照交易对手提供的价格或公开市场可取得的价格确定。

2、公司也将在定期报告中对已开展的衍生品业务相关信息予以披露。

六、备查文件

- 1、第十届董事会第十一次会议决议；
- 2、公司出具的可行性报告；
- 3、公司远期外汇交易业务内部控制制度。

特此公告。

深圳长城开发科技股份有限公司

董事会

二〇二五年八月二十八日