

香港交易及結算所有限公司及香港聯合交易所有限公司對本公告的內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示，概不對因本公告全部或任何部份內容而產生或因倚賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。



長城汽車股份有限公司 GREAT WALL MOTOR COMPANY LIMITED*

(於中華人民共和國註冊成立的股份有限公司)

(股份代號：2333)

海外監管公告

此海外監管公告是根據香港聯合交易所有限公司證券上市規則第13.10B條發出。以下為長城汽車股份有限公司於上海證券交易所網站（www.sse.com.cn）所刊發之「長城汽車股份有限公司關於開展2022年外匯衍生品交易業務的公告」。

承董事會命
長城汽車股份有限公司
公司秘書
徐輝

中國河北省保定市，2022年8月19日

於本公告日期，董事會成員如下：

執行董事：魏建軍先生、趙國慶先生及李紅栓女士。

非執行董事：何平先生。

獨立非執行董事：樂英女士、李萬軍先生及吳智傑先生。

* 僅供識別

证券代码：601633

证券简称：长城汽车

公告编号：2022-120

转债代码：113049

转债简称：长汽转债

长城汽车股份有限公司

关于开展 2022 年外汇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：

- 投资种类

包括但不限于远期结售汇业务、外汇NDF业务、外汇掉期业务、外汇期权、结构性远期。

- 核心原因和目的

集团外汇衍生品业务交易均以正常生产经营日常贸易项下及资本项下需求为基础，以具体经营业务为依托，遵循合法、审慎、安全、有效的原则，不进行以投机为目的的外汇交易，不进行超出经营实际需要的复杂外汇衍生品交易，聚焦主业，以“保值”而非“增值”为核心，尽可能降低汇率波动对主营业务以及集团财务的负面影响。

- 投资金额

长城汽车股份有限公司（以下简称“本公司”）及其子公司（以下简称“本集团”）为保证经营需要，根据《外汇衍生品交易业务管理制度》规定，开展外汇衍生品交易如下：

本集团2022年度开展外汇衍生品名义金额累计不超过人民币186亿元或等值其他货币（约占本公司最近一期经审计净资产的29.94%）的外汇衍生品交易业务。在以上额度范围内，授权财务总监李红栓女士在上述额度和期限内，行使决策权并签署相关文件。

- 履行的审议程序

本事项已经公司第七届董事会第四十六次会议和第七届监事会第四十一次会议审议通过，无需提交股东大会审议。

- 特别风险提示

本集团拟开展的外汇衍生品交易业务将遵循合法、审慎、安全、有效的原则，不以投机为目的，所有外汇衍生品交易将以正常跨境业务为基础，但进行外汇衍生品交易仍会存在价格波动风险、履约风险、流动性风险、内部控制风险和法律风险等可能存在的风险。

2022年8月19日，本公司召开第七届董事会第四十六次会议和第七届监事会第四十一次会议，审议通过了《关于开展外汇衍生品交易业务的议案》，同意本集团2022年度外汇衍生品名义金额累计不超过186亿元人民币（或等值其他货币），开展外汇衍生品交易，同时授权财务总监李红栓女士管理外汇衍生品交易业务。具体情况如下：

一、开展外汇衍生品交易业务的目的

本集团开展的外汇衍生品交易与公司业务紧密相关，能进一步提高公司应对外汇波动风险的能力，更好地规避和防范公司所面临的外汇汇率波动风险，增强公司财务稳健性。集团外汇衍生品业务交易均以正常生产经营日常贸易项下及资本项下需求为基础，以具体经营业务为依托，遵循合法、审慎、安全、有效的原则，不进行以投机为目的的外汇交易，不进行超出经营实际需要的复杂外汇衍生品交易，聚焦主业，以“保值”而非“增值”为核心，尽可能降低汇率波动对主营业务以及集团财务的负面影响。

二、开展外汇衍生品交易业务的品种

本集团开展的外汇衍生品交易品种均为与基础业务密切相关的外汇衍生产品或组合，主要包括远期结售汇、外汇NDF、外汇掉期、外汇期权、结构性远期等。

三、开展外汇衍生品交易业务的交易额度、期限及授权

本集团 2022 年度外汇衍生品名义金额累计不超过人民币 186 亿元或等值其他货币（约占本集团最近一期经审计净资产的 29.94%）的外汇衍生品交易业务。公司外汇衍生品必须以本集团的名义进行购买。公司董事会授权财务总监李红栓女士在上述额度和期限内，行使决策权并签署相关文件。

四、外汇衍生品交易业务的风险分析及风险控制措施

（一）外汇衍生品交易业务的风险分析

本集团开展外汇衍生品交易业务遵循合法、谨慎、安全和有效的原则，不得进行投机性和单纯的套利交易，但外汇衍生品交易操作仍存在一定风险：

- 1、市场风险：因外汇行情变动较大，可能产生因标的利率、汇率等市场价格波动引起外汇衍生品价格变动，造成亏损的市场风险。
- 2、流动性风险：因市场流动性不足而无法完成交易的风险。
- 3、内部控制风险：外汇衍生品交易业务专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内控制度不完善而造成风险。
- 4、履约风险：开展外汇衍生品业务存在合约到期无法履约造成违约而带来的风险。
- 5、其它风险：在开展交易时，如交易合同条款不明确，将可能面临法律风险。

（二）公司采取的风险控制措施

- 1、选择交易结构简单、流动性强、风险可控的外汇衍生品，禁止任何风险投机行为。
- 2、公司财务部门将持续跟踪外汇衍生品公开市场价格或公允价值变动，及时评估外汇衍生品交易的风险敞口变化情况，并定期向公司管理层报告，发现异常情况及时上报，提示风险并执行应急措施。
- 3、公司仅与具有合法资质的大型银行等金融机构开展外汇衍生品交易业务，规避可能产生的法律风险。

五、外汇衍生品交易的会计政策及核算原则

公司根据《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37号——金融工具列报》相关规定及其指南，对拟开展的外汇衍生品交易业务进行相应的核算与会计处理，反映资产负债表及损益表相关项目。

六、专项审核意见

（一）独立董事意见

公司独立董事发表独立意见认为：本集团开展的外汇衍生品交易与公司业务紧密相关，能进一步提高公司应对外汇波动风险的能力，更好地规避和防范公司所面临的外汇汇率波动风险，增强公司财务稳健性。本公司已制定了《长城股份有限公司外汇衍生品交易业务管理制度》及相关风险控制措施，有助于保障外汇衍生品交易的风险管控。公司履行了必要的审议，决策程序和信息披露义务，不存在损害公司及全体股东，特别是中小股东利益的情形。因此，我们同意本集团开展外汇衍生品交易业务。

（二）监事会意见

公司监事会认为：本集团开展外汇衍生品交易业务是根据公司实际经营需求提出的，目的是为了规避和防范汇率与利率波动风险，保障公司及全体股东利益。公司董事会在审议上述事项时，相关审议程序符合法律法规和《公司章程》等的规定。因此，我们同意本集团开展外汇衍生品交易业务。

长城汽车股份有限公司董事会

2022年8月19日