

上海电力股份有限公司

关于全资子公司开展日元贷款汇率套期保值业务的公告

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法律责任。

一、外汇套期保值情况概述

（一）外汇套期保值的目的

为规避外汇市场风险，降低汇率波动对公司业绩的影响，公司全资子公司上海电力能源发展（香港）有限公司（以下简称“香港公司”）拟开展日元贷款汇率套期保值业务。

（二）套保方案

1. 交易主体

香港公司。

2. 套保工具（包括交易方式）

美元兑日元远期合约，全额交割。

3. 套保规模

不超过 170 亿日元。

4. 套保期限

至 2025 年 7 月 22 日。

二、审议程序

公司于 2022 年 11 月 25 日召开第八届第六次董事会会议，审议通过了《关于开展上海电力香港公司 170 亿日元贷款汇率套期保值业务的议案》。

三、风险管控

（一）资金占用

本次业务采用银行信用交易，无保证金，不存在补仓而产生的流动性风险。

（二）违约风险

本次业务的衍生品交易银行拟选择渣打银行和德意志银行。《ISDA 协议》加强了香港公司的风险控制能力，有助于降低衍生品交易银行违约风险所带来的不利影响。

（三）亏损预警线设置

在套保期间内，该业务是完全对冲的套期保值交易，不存在单边亏损的风险，因此不设置亏损预警线。

（四）合规管理

在方案履行完审批程序后方可进行操作，并及时做好交易凭证及单据审核、财务文件归档等工作。

（五）操作风险

在方案授权的交易价格内进行操作，满足关闭美元兑日元外汇风险敞口。

（六）风控措施

在上海电力外汇风险管理小组的指导下，香港公司成立外汇工作小组，严格按照上海电力《外汇风险管理办法》开展工作，实时跟踪美元兑日元汇率曲线趋势变动，充分掌握市场状况的前提下开展工作，确保交易的规范性和安全性。

本次交易严格执行前、中、后台分离原则。香港公司财务部承担前台操作职责，负责与交易银行签订合同，具体交易由财务部资金及外汇管理岗位负责执行，实时跟踪美元兑日元汇率变动开展交易。上海电力法律企管部承担中台监督职责，负责业务风险、合规性审核及业务后评估等工作，确保风险可控。上海电力计财部承担后台管理职责，及时跟踪掌握业务信息，按月度对香港公司业务开展情况进行检查，切实保障资金安全。

（七）应急措施

对重大事件风险制定应急预案。比如，由于市场剧幅波动、突发政治事件等不可抗力事件导致套保交易无法完成时，由上海电力法律企管部启动并组织实施应急预案，计财部牵头各相关部门提供风险事件发生原因、管控进展及影响，编制重大风险台账进行跟踪管理。

四、开展日元贷款汇率套期保值业务对公司的影响

公司开展日元贷款汇率套期保值业务是以正常企业经营为基础，以减少、规

避汇率风险为目的，符合公司生产经营需要，有利于防范汇率波动风险，降低汇率波动对公司的影响。公司开展外汇套期保值业务不会影响公司主营业务的发展，资金使用安排合理，不存在损害公司和全体股东的利益。

五、独立董事意见

公司关于开展日元贷款汇率套期保值业务的相关审议程序符合国家相关法律、法规及《公司章程》的规定。公司本次开展套期保值业务是公司应对汇率波动风险采取的主动管理策略，可有效规避外汇风险，且风险可控，不会对公司经营情况及财务状况产生重大不利影响，不会损害公司及中小股东的利益，同意公司全资子公司香港公司开展 170 亿日元贷款汇率套期保值业务。

特此公告。

上海电力股份有限公司董事会

二〇二二年十一月二十九日