

中联重科股份有限公司董事会

关于公司 2017 年证券投资情况的专项说明

根据《深圳证券交易所主板上市公司规范运作指引》、深圳证券交易所《主板信息披露业务备忘录第 1 号—定期报告披露相关事宜》等有关规定的要求,中联重科股份有限公司(以下简称“公司”)董事会对公司 2017 年度证券投资情况进行了核查,现将相关情况说明如下:

一、证券投资审议批准情况

1、关于委托理财事项

经公司 2017 年 3 月 30 日召开的第五届董事会第五次会议,及 2017 年 6 月 27 日召开的 2016 年年度股东大会审议通过《公司关于授权进行低风险投资理财业务的议案》,为提高资金使用效率,合理利用公司资金周转中产生的闲置资金,授权公司在不超过 40 亿元人民币的额度内进行低风险投资理财。

经公司 2017 年 8 月 30 日召开的第五届董事会第六次会议,及 2017 年 11 月 1 日召开的 2017 年度第一次临时股东大会、A 股类别股东大会和 H 股类别股东大会审议通过《公司关于调增低风险投资理财业务额度的议案》,调增低风险投资理财额度至不超过 100 亿元人民币,在该额度内,资金可滚动使用。

2、关于金融衍生品事项

经公司 2017 年 3 月 30 日召开的第五届董事会第五次会议,及 2017 年 6 月 27 日召开的 2016 年年度股东大会审议通过《公司关于授权开展金融衍生品业务的议案》,为满足公司及其控股子公司进行套期保值业务的需要,授权公司开展金融衍生品业务,名义本金不超过人民币 90 亿元,在该额度内循环操作。

二、2017 年度公司证券投资情况

1、委托理财的情况

2017 年公司以闲置资金购买了中短期银行理财产品、债券型基金及券商集合资产管理计划。2017 年度公司使用闲置资金购买投资理财产品的本金累计 94.8 亿元，获得收益约 9337 万元，明细如下：

单位：万元

受托人名称	是否关联交易	产品类型	委托理财金额	报酬确定方式	本期实际收回本金金额	计提减值准备金额	预计收益	报告期实际损益金额	报告期损益实际收回情况
中国银行	否	银行浮动收益非保本型理财	45,000	非保本浮动收益	45,000	未有计提	1,591	1,591	1,591
中国银行	否	银行浮动收益非保本型理财	17,000	非保本浮动收益	17,000	未有计提	503	503	503
光大银行	否	银行浮动收益非保本型理财	30,000	非保本浮动收益		未有计提	608	516	
工商银行	否	银行浮动收益非保本型理财	40,000	非保本浮动收益		未有计提	1,458	668	
中信银行	否	银行浮动收益非保本型理财	30,000	非保本浮动收益	30,000	未有计提	481	481	481
工商银行	否	银行浮动收益非保本型理财	30,000	非保本浮动收益		未有计提	1,492	497	
工商银行	否	银行浮动收益非保本型理财	30,000	非保本浮动收益		未有计提	822	497	
中国银行	否	银行浮动收益非保本型理财	30,000	非保本浮动收益		未有计提	1,538	507	
中国银行	否	银行浮动收益非保本型理财	20,000	非保本浮动收益		未有计提	411	332	
中国银行	否	银行浮动收益非保本型理财	30,000	非保本浮动收益		未有计提	567	497	
中国银行	否	银行浮动收益非保本型理财	30,000	非保本浮动收益		未有计提	559	497	
邮储银行	否	银行浮动收益非保本型理财	30,000	非保本浮动收益		未有计提	1,492	481	
邮储银行	否	银行浮动收益非保本型理财	15,000	非保本浮动收益		未有计提	383	163	
南京银行	否	银行浮动收益非保本型理财	20,000	非保本浮动收益	20,000	未有计提	176	176	176
中国银行	否	银行浮动收益非保本型理财	50,000	非保本浮动收益	50,000	未有计提	194	194	194

中信银行	否	银行浮动收益 非保本型理财	50,000	非保本浮 动收益	50,000	未有 计提	221	221	221
浦发银行	否	银行浮动收益 非保本型理财	50,000	非保本浮 动收益	50,000	未有 计提	195	195	195
浦发银行	否	银行浮动收益 非保本型理财	50,000	非保本浮 动收益		未有 计提	641	363	
光大银行	否	银行浮动收益 非保本型理财	30,000	非保本浮 动收益	30,000	未有 计提	25	25	25
民生银行	否	银行浮动收益 非保本型理财	30,000	非保本浮 动收益		未有 计提	453	184	
南京银行	否	银行浮动收益 非保本型理财	20,000	非保本浮 动收益		未有 计提	529	113	
光大银行	否	银行浮动收益 非保本型理财	30,000	非保本浮 动收益		未有 计提	389	111	
光大银行	否	银行浮动收益 非保本型理财	30,000	非保本浮 动收益	30,000	未有 计提	49	49	49
浦发银行	否	银行浮动收益 非保本型理财	50,000	非保本浮 动收益		未有 计提	1,314	174	
邮储银行	否	银行浮动收益 非保本型理财	20,000	非保本浮 动收益		未有 计提	467	64	
邮储银行	否	银行浮动收益 非保本型理财	50,000	非保本浮 动收益		未有 计提	906	118	
建设银行	否	银行浮动收益 非保本型理财	9,000	非保本浮 动收益		未有 计提	153	16	
建设银行 4751	否	银行浮动收益 非保本型理财	30,000	非保本浮 动收益		未有 计提	1,440	24	
光大银行	否	银行浮动收益 非保本型理财	30,000	非保本浮 动收益		未有 计提	664	13	
财富证券	否	集合资产管理 计划	2,000	非保本浮 动收益		未有 计提	26	4	
嘉实基金	否	债券型基金	20,000	非保本浮 动收益		未有 计提	229	60	
合计			948,000		322,000		19,969	9,337	3,436
委托理财资金来源			自有资金						
逾期未收回的本金和收益累计金额			0						
涉诉情况（如适用）			不适用						
委托理财审批董事会公告披露日期 （如有）			2017年3月30日、2017年8月30日						
委托理财审批股东会公告披露日期 （如有）			2017年6月27日、2017年11月1日						
未来是否还有委托理财计划			是						

2、金融衍生品的情况

衍生品投资操作方名称	关联关系	是否关联交易	衍生品投资类型	衍生品投资初始投资金额	起始日期	终止日期	期初投资金额	报告期内购入金额	报告期内售出金额	计提减值准备金额(如有)	期末投资金额	期末投资金额占公司报告期末净资产比例	报告期实际损益金额
银行	无	否	远期外汇合约	520,823.85	2017-1-1	2017-12-30	520,823.85	52,665.53	520,823.85	无	52,665.53	1.38%	10,146.89
合计				520,823.85	--	--	520,823.85	52,665.53	520,823.85	无	52,665.53	1.38%	10,146.89
衍生品投资资金来源				公司自有资金									
涉诉情况(如适用)				不适用									
衍生品投资审批董事会公告披露日期(如有)				2017年3月30日									
衍生品投资审批股东会公告披露日期(如有)				2017年6月27日									
报告期衍生品持仓的风险分析及控制措施说明(包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、操作风险、法律风险等)				<p>1、市场风险：集团及成员企业开展的金融衍生品业务，主要为与主营业务相关的套期保值类业务，存在因标的利率、汇率等市场价格波动导致金融衍生品价格变动而造成亏损的市场风险；</p> <p>2、流动性风险：因开展的衍生品业务均为通过金融机构操作的场外交易，存在因各种原因平仓斩仓损失而须向银行支付价差的风险；</p> <p>3、其他风险：在具体开展业务时，如发生操作人员未按规定程序报备及审批，或未准确、及时、完整地记录金融衍生品业务信息，将可能导致衍生品业务损失或丧失交易机会。同时，如交易人员未能充分理解交易合同条款和产品信息，将面临因此带来的法律风险及交易损失。</p>									
已投资衍生品报告期内市场价格或产品公允价值变动的情况，对衍生品公允价值的分析应披露具体使用的方法及相关假设与参数的设定				报告期末已投资未到期衍生品投资公允价值为 385.81 万元，该产品公允价值根据报告期末金融机构衍生品公允价值评估报告判定。									
报告期公司衍生品的会计政策及会计核算具体原则与上一报告期相比是否发生重大变化的说明				否									

三、内控制度执行情况

1、委托理财的情况

公司制定了《理财产品管理制度》，对理财产品的管理机构、实施流程、信息保密措施等方面进行了规定，中联重科集团财务有限公司（简称“财务公司”）作为

理财产品业务的具体经办机构，制定了财务公司《授权管理办法》、《资金管理办法》等内部管理制度及流程，对投资理财业务流程、审批权限、风险评估、档案管理等进行了明确的规定，有效防范投资风险，确保资金安全。

2017年，公司严格按照相关法律法规、《公司章程》、《理财产品管理制度》及财务公司《授权管理办法》及《资金管理办法》等相关规章制度的要求进行投资理财产品的购买，未发现违反相关法律法规及规章制度的行为。

2、金融衍生品的情况

(1) 中联重科集团财务有限公司负责统一代理集团成员企业管理金融衍生品业务，加强对汇率及利率的研究分析，实时关注国际市场环境变化，严格按照《金融衍生品业务内部控制制度》的规定进行业务操作，保证有效执行，最大限度避免汇兑损失。

(2) 公司已制定《金融衍生品业务内部控制制度》及其他相关流程制度，针对公司的金融衍生品业务交易额度、品种范围、审批权限、内部流程、责任部门、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序、信息披露及档案管理等做出了明确规定；

(3) 交易对手管理：从事金融衍生业务时，慎重选择与实力较好的境内外大型商业银行开展外汇套期保值业务，密切跟踪相关法律法规，规避可能产生的法律风险。

(4) 加强对银行账户和资金的管理，严格遵守资金划拨和使用的审批程序。

(5) 当市场发生重大变化或出现重大浮亏时要成立专门工作小组，及时建立应急机制，积极应对，妥善处理。

(6) 选择恰当的风险评估模型和监控系统，持续监控和报告各类风险，在市场波动剧烈或风险增大情况下，增加报告频度，并及时制订应对预案。

四、独立董事关于公司 2017 年证券投资情况的意见

根据深圳证券交易所的有关规定，我们对公司 2017 年度证券投资情况进行了认真核查。经核查，2017 年公司除开展委托理财和金融衍生品业务，未进行其他证券投资。我们认为，公司用于证券投资的资金来源于公司的闲置资金，未影响公司主营业务的开展。公司严格按照相关法律法规、《公司章程》以及公司相关制度的要求开展证券投资业务，决策程序合法合规，内控制度严格落实，资金安全能够得到保障，未出现违反相关法律法规及规章制度的行为。公司利用闲置资金开展证券投资业务，有利于提高公司资金的使用效率和收益，符合公司利益，不存在损害公司及中小股东利益的情形。

中联重科股份有限公司
董 事 会
二〇一八年四月二十七日