

# 上海永利带业股份有限公司

## 2022 年度证券与衍生品投资情况专项报告

根据《深圳证券交易所创业板上市公司自律监管指南第 1 号——业务办理》《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》等有关规定的要求，上海永利带业股份有限公司（以下简称“公司”）董事会对公司 2022 年度证券与衍生品投资情况进行了核查，现将相关情况说明如下：

### 一、证券与衍生品投资审议批准情况

公司于 2022 年 7 月 21 日召开了第五届董事会第十一次会议，审议通过了《关于开展外汇套期保值业务的议案》，随着公司海外业务的发展，外币结算需求不断上升，为有效规避和防范汇率大幅波动对公司经营造成的不利影响，控制外汇风险，增强财务稳健性，同意公司及子公司在不超过 2 亿元人民币或等值外币额度内与银行等金融机构开展外汇套期保值业务。投资期限为自公司董事会审议通过之日起 12 个月。

### 二、2022 年度衍生品投资的具体情况

本报告期，公司下属全资子公司百汇精密塑胶模具（深圳）有限公司在董事会授权范围内开展外汇套期保值业务，新增远期结售汇合约 300 万美元，截至本报告期末未到期，本期公允价值变动损益为-458,340.41 元。

### 三、外汇套期保值业务的风险分析

公司进行外汇套期保值业务遵循稳健的原则，不进行以投机为目的的外汇交易，所有外汇套期保值业务均以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，以规避和防范汇率风险为目的。但是进行外汇套期保值业务也会存在一定的风险：

1、汇率波动风险：在外汇汇率走势与公司判断发生大幅偏离的情况下，公司开展外汇套期保值业务支出的成本可能超过预期，从而造成公司损失。

2、内部控制风险：外汇套期保值业务专业性较强，复杂程度较高，可能会由于员工操作失误、系统故障等原因导致在办理外汇套期保值业务过程中造成损失。

3、交易违约风险：外汇套期保值交易对手出现违约，不能按照约定支付公司套期保值盈利从而无法对冲公司实际的汇兑损失，将造成公司损失。

4、法律风险：因相关法律发生变化或交易对手违反相关法律制度可能造成

合约无法正常执行而给公司带来损失。

#### **四、外汇套期保值业务的风控措施**

1、公司已制定《外汇套期保值业务管理制度》，建立严格有效的风险管理制度，利用事前、事中及事后的风险控制措施，预防、发现和降低各种风险。该制度符合监管部门的有关要求，满足实际操作的需要，所制定的风险控制措施切实有效。

2、为控制汇率大幅波动风险，公司将加强对汇率的研究分析，实时关注国际国内市场环境变化，适时调整经营、业务操作策略，最大限度地避免汇兑损失。

3、为防范内部控制风险，公司财务部门负责统一管理公司外汇套期保值业务，所有的外汇交易行为均以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，不得进行投机和套利交易，并严格按照《外汇套期保值业务管理制度》的规定进行业务操作，有效地保证制度的执行。公司审计部定期对外汇套期保值业务的实际操作情况、资金使用情况及盈亏情况进行审计，稽核交易及信息披露是否根据相关内部控制制度执行。

4、为控制交易违约风险，公司仅与具有相关业务经营资质的银行等金融机构开展外汇套期保值业务，保证公司外汇衍生品交易管理工作开展的合法性。

#### **五、独立董事关于公司 2022 年度证券与衍生品投资情况的独立意见**

根据深圳证券交易所的有关规定，我们对公司 2022 年度证券与衍生品投资情况进行了认真核查。经核查，2022 年公司未进行证券投资，仅开展了外汇套期保值业务。我们认为，公司用于外汇套期保值业务的资金来源于公司的自有资金，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外汇套期保值业务，履行了相应的审批程序，未出现违反相关法律法规及规章制度的行为，不存在损害公司及中小股东利益的情形。

上海永利带业股份有限公司

董事会

2023 年 4 月 27 日