

宁波均胜电子股份有限公司

关于开展金融衍生品交易业务的可行性分析报告

一、公司开展衍生品交易业务的背景和目的

作为业务遍布全球主要汽车市场所在地区/国家的汽车一级零部件供应商，宁波均胜电子股份有限公司（以下简称“公司”）在日常经营过程中涉及外币业务，并持有有一定数量的外币资产及外币负债，从而在利率及汇率端形成风险敞口。为有效规避和防范汇率及利率大幅波动对公司造成的不利影响，增强公司财务稳健性，在保证日常运营资金需求的情况下，公司计划在 2024 年与经营稳健、资信良好，具有金融衍生品交易业务资格的境内外银行等金融机构开展金融衍生品交易业务。

二、公司开展的金融衍生品交易业务概述

以日常生产经营活动为基础，公司拟开展的金融衍生品交易业务包括但不限于远期结售汇、外汇掉期、利率互换等，以管理汇率及利率风险为目的，不进行以投机为目的的外汇交易。上述金融衍生品交易业务为简单金融衍生品业务，其种类、规模及期限均与需管理的风险敞口相匹配，以遵循公司合法、谨慎、稳健、安全有效的风险管理原则。

三、公司开展金融衍生品交易的主要条款

- 1、交易工具：远期结售汇、外汇掉期、利率互换等；
- 2、合约期限：与公司基础业务交易期限相匹配；
- 3、交易对手：经营稳健、资信良好，具有金融衍生品交易业务经营资格的境内外银行等金融机构，不涉及公司关联方；
- 4、交易金额：2024 年度公司拟开展的金融衍生品交易业务的最高合约价值总额度不超过人民币 45 亿元（含等值外币），交易期限内任一时点的交易金额（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）将不超过已审议的总额度，在授权期限内可循环使用；
- 5、交易期限：本次授权的金融衍生品交易规模有效期至董事会审议新的授

权为止，且相关授权期限不超过 12 个月。

6、流动性安排：金融衍生品交易业务以正常外汇资产、负债为依据，预计不会对公司流动性造成影响；

7、资金来源：资金来源为公司自有资金或自筹资金，不涉及募集资金。

四、公司开展金融衍生品交易的风险分析

遵循合法、谨慎、稳健、安全和有效的原则，公司金融衍生品业务以日常生产经营活动为基础，不进行以投机为目的的外汇交易，但金融衍生品交易仍存在一定的风险：

1、市场风险：金融衍生品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。

2、违约风险：开展金融衍生品交易业务存在因合约到期交易对方无法履约造成违约而带来的风险。

3、流动性风险：因市场流动性不足而无法完成交易的风险。

4、法律风险：公司开展金融衍生品交易业务时，存在交易人员未能充分理解交易合同条款和产品信息，导致经营活动不符合法律规定或者因外部法律事件而造成的交易损失。

五、公司开展金融衍生品交易采取的风险控制措施

1、公司已制定《均胜电子期货和衍生品交易管理制度》，制定了严格的决策程序、报告机制和监控措施，明确了工作职责、审批权限、操作要点和信息披露等具体要求。公司在开展衍生品交易业务时，将严格按照相关内部控制制度执行。

2、公司开展的金融衍生品交易业务以实际业务需求为基础，以锁定成本、规避和防范汇率及利率风险为目的，禁止任何风险投机行为。

3、公司将审慎核查与具有合法资质的金融机构签订的合约条款，严格执行风险管理制度，防范法律风险。

4、公司实时关注金融衍生品交易业务各项风险因素，市场波动有较大影响时及时预警并制定应对方案。

六、公司开展金融衍生品交易的可行性分析结论

公司拟开展的金融衍生品交易是围绕公司实际外汇收支业务进行的，以具体经营业务为依托，以锁定成本、规避和防范外汇汇率、利率波动风险为目的，是出于公司稳健经营的需求而定，有利于提升公司外汇风险和利率风险的管控能力，符合公司及全体股东利益，该业务的开展具有必要性。

公司已根据相关法律法规的要求建立《均胜电子期货和衍生品交易管理制度》，落实风险防范措施，所采取的针对性风险控制措施切实可行，因此公司开展外汇及利率金融衍生品交易具有可行性。

宁波均胜电子股份有限公司

2024年3月27日