

深圳安培龙科技股份有限公司

2023 年度证券与衍生品投资情况的专项报告

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 2 号——创业板上市公司规范运作》等有关规定的要求，深圳安培龙科技股份有限公司（以下简称“公司”）董事会对公司 2023 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、证券与衍生品投资的审批情况

公司分别于 2023 年 3 月 28 日召开第三届董事会第十二次会议、于 2023 年 4 月 18 日召开 2022 年年度股东大会，审议通过了《关于 2023 年金融衍生品操作计划、交易授权及 2022 年至今金融衍生品开展情况的议案》，同意公司开展以套期保值为目的的金融衍生品交易业务，交易品种包括但不限于远期结售汇、期权、远期外汇买卖、掉期（包括货币掉期和利率掉期）、货币互换业务及上述产品的组合等。公司拟开展金融衍生品的交易资金来源于公司自有资金或银行信贷资金，不涉及募集资金，资金额度不得超过人民币 4,500 万元或等值外币（含前述投资的收益进行再投资的相关金额）。在授权期限内，资金可以循环滚动使用。股东大会授权董事长或其指定的授权代理人在额度范围内签署相关协议。

二、2023 年度证券与衍生品投资的具体情况

公司 2023 年度证券及衍生品投资情况如下：

投资情况	交易类型	交易保证金和权利金上限获批的额度	报告期内单日持有最高合约价值	2023 年发生数量	期末占用额度金额	报告期内单日最高余额是否超过获批额度	损益情况
外汇套期保值	货币互换	4500 万元人民币	246 万美元	1	0	否	385,643.75 元人民币

三、外汇套期保值业务的风险分析

公司及子公司开展的外汇套期保值业务遵循合法、审慎、安全、有效的原则，不从事以投机为目的的衍生品交易，但也会存在一定的风险，主要包括：

1、市场风险：可能产生因标的利率、汇率等市场价格波动而造成金融衍生品价格变动而造成亏损的市场风险。

2、操作风险：在开展交易时，如操作人员未按规定程序进行金融衍生品交易操作或未能充分理解衍生品信息，将带来操作风险。

3、履约风险：交易对手信用等级、履约能力及其他原因导致的到期无法履约风险。

4、内部控制风险：金融衍生品交易业务专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内部控制机制不完善而造成风险。

5、流动性风险：因市场流动性不足而无法完成交易的风险。

四、公司采取的风险控制措施

1、公司制定了《金融衍生品交易业务管理制度》，并将加强市场分析和品种调研，切实执行内部有关管理制度，严控风险，规范运作。

2、公司应建立台账管理，对资金运用的经济活动建立健全完整的会计账目，做好资金使用的财务核算工作；财务中心于发生投资事项应及时与银行核对账户余额，确保资金安全。

3、资金使用情况由公司内审部进行日常监督。在金融衍生品交易业务操作过程中，公司财务中心应根据在公司董事会或股东大会授权范围及批准额度内与相关金融机构签署的金融衍生品交易协议中约定的金额、汇率、利率等及交割期间，及时与其进行结算。

4、当相关产品的价格、汇率、利率等发生剧烈波动时，财务中心应及时进行分析，并将有关信息及时上报公司财务负责人，财务负责人经审慎判断后下达操作指令，防止风险进一步扩大。

5、当公司金融衍生品交易业务存在重大异常情况，并可能出现重大风险时，财务中心应及时提交分析报告和解决方案，并随时跟踪业务进展情况；公司管理层应及时商讨应对措施，提出切实可行的解决方案，实现对风险的有效控制。内部审计部门应认真履行监督职能，发现违规情况立即向董事会、监事会报告。

五、保荐人核查意见

经核查，保荐人认为：安培龙 2023 年度证券与衍生品投资情况不存在违反《深圳证券交易所创业板股票上市规则》《深圳证券交易所上市公司自律监管指

引第2号——创业板上市公司规范运作》等相关法律法规及规范性文件规定之情形，符合公司章程的规定，决策程序合法、合规。

深圳安培龙科技股份有限公司

董事会

2024年4月22日