

证券代码：301222

证券简称：浙江恒威

公告编号：2024-020

## 浙江恒威电池股份有限公司 2023 年度证券与衍生品投资情况的专项报告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

根据《深圳证券交易所上市公司自律监管指南第 1 号——业务办理：定期报告披露相关事宜》、《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》等有关法律法规及规范性文件的要求，浙江恒威电池股份有限公司（以下简称“公司”）董事会对 2023 年度证券与衍生品投资情况进行了核查，现将有关情况报告如下：

### 一、证券与衍生品投资的审批情况

公司于 2023 年 4 月 3 日召开第二届董事会第十三次会议和第二届监事会第十三次会议，审议通过了《关于开展外汇套期保值业务的议案》，同意公司开展总额不超过人民币 30,000.00 万元或等值外币的外汇套期保值业务，并授权公司董事长审批日常外汇套期保值业务，在使用期限及额度范围内，资金可以滚动使用。具体内容详见公司于 2023 年 4 月 4 日在巨潮资讯网上披露的《关于开展外汇套期保值业务的公告》（公告编号：2023-010）。

公司于 2024 年 4 月 3 日召开第三届董事会第五次会议和第三届监事会第四次会议，审议通过了《关于开展外汇套期保值业务的议案》，同意公司开展总额不超过人民币 4 亿元或等值外币的外汇套期保值业务，并授权公司董事长或其授权的人员审批日常外汇套期保值业务，在使用期限及额度范围内，资金可以滚动使用。具体内容详见公司于 2024 年 4 月 3 日在巨潮资讯网上披露的《关于开展外汇套期保值业务的公告》（公告编号：2024-010）。

### 二、2023 年度开展衍生品交易的具体情况

2023 年，公司开展的套期保值衍生品交易业务，具体情况如下：

衍生品 投资类型	获批额度 (万元)	2023年度内单日最 高余额(万美元)	期末余额 (万美元)	是否在获批额 度内开展业务	是否处于获批 额度使用期限
期货套期 保值	30,000	1,000	400	是	是

### 三、开展套期保值业务的风险分析

公司外汇套期保值业务遵循稳健原则，不进行以投机为目的的外汇及利率交易，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，以规避和防范汇率及利率风险为目的。但是进行外汇套期保值业务也会存在一定的风险：

#### 1、汇率、利率波动风险

在外汇汇率及利率走势与公司判断汇率及利率波动方向发生大幅偏离的情况下，公司锁定汇率后支出的成本可能超过不锁定时的成本支出，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，可能会由于内控制度不完善而造成风险；

#### 3、交易违约风险

在外汇套期保值交易对手方出现违约的情况下，公司将无法按照约定获取套期保值盈利以对冲公司实际的汇兑及利息损失，从而造成公司损失；

#### 4、客户违约风险：

客户应收账款发生逾期、客户调整订单等情况将使货款实际回款情况与预期回款情况不一致，可能使实际发生的现金流与已操作的外汇套期保值业务期限或数额无法完全匹配，从而导致公司损失。

### 四、公司采取的风险控制措施

1、公司制定了《外汇套期保值业务管理制度》，对外汇套期保值业务操作规范、审批权限、管理流程、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序等做出了明确规定。

2、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，有效保证制度的执行。

3、公司内部审计部负责定期审查监督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等，并向董事会审计委员会报告审查情况。

4、公司仅与具有合法资质的大型银行等金融机构开展外汇套期保值业务，财务部门及时跟踪交易变动状态，严格控制交割违约风险的发生。

5、公司进行外汇套期保值业务必须基于公司的外币收（付）款的谨慎预测，外汇套期保值业务的交割日期需与公司预测的外币收款、存款时间或外币付款时间相匹配，或者与对应的外币银行借款的兑付期限相匹配。

## **五、保荐机构核查意见**

经核查，保荐机构招商证券认为：公司证券与衍生品投资情况未有违反《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》以及公司相关制度的规定，决策程序合法、合规。

## **六、备查文件**

- 1、第三届董事会第六次会议决议；
- 2、第三届监事会第五次会议决议；
- 3、《招商证券股份有限公司关于浙江恒威电池股份有限公司 2023 年度证券与衍生品投资情况的核查意见》；
- 4、深交所要求的其他文件。

特此公告

**浙江恒威电池股份有限公司**

**董事会**

**2024 年 4 月 26 日**