

天津长荣科技集团股份有限公司

关于公司 2024 年度证券与衍生品投资情况的专项报告

根据《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 2 号——创业板上市公司规范运作》《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》等有关规定的要求，董事会对天津长荣科技集团股份有限公司及下属子公司（以下统称“公司”）2024 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

公司分别于2024年03月13日、2024年03月29日召开了第六届董事会第六次会议、2024 年第二次临时股东大会，审议通过了《关于开展外汇套期保值业务的议案》，同意公司及控股子公司开展最高原始合约价值不超过5000万美元（含本数）或等值人民币，预计动用的交易保证金和权利金上限（包括为交易而提供的担保物价值、预计占用的金融机构授信额度、为应急措施所预留的保证金等）不超过人民币2500万元（含本数）或等值外币的外汇套期保值业务，自股东大会审议通过之日起12个月内有效，期间可循环滚动使用。

二、2024年度公司证券与衍生品投资情况

2024 年，公司未开展证券投资，仅开展了外汇衍生品交易业务，具体业务情况如下：

单位：万元

衍生品投资类型	初始投资金额	期初金额	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	报告期内购入金额	报告期内售出金额	期末金额	期末投资金额占公司报告期末净资产比例
普通远期+期权组合-A	0	416.88	113.56	0	0	530.44	0	0.00%
普通远期+期权组合-B	0	0	-56.1	0	0	0	-56.1	0.00%
合计	0	416.88	57.46	0	0	530.44	-56.1	0.00%

三、交易风险分析

外汇衍生品交易可以在汇率发生大幅波动时，降低汇率波动对公司及控股子公司的影响，但是也可能存在一定的风险：

1、市场风险：因外汇行情变动较大，可能产生因标的利率、汇率等市场价格波动引起外汇衍生品价格变动，造成亏损的市场风险。

2、内部控制风险：外汇衍生品交易专业性较强，属于内控风险较高的业务，可能会由于内控制度不完善而造成风险。

3、履约风险：开展外汇衍生品交易存在合约到期无法履约造成违约而带来的风险。

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、公司采取的风险控制措施

为了应对开展外汇衍生品业务带来的上述风险，公司通过如下途径进行风险控制：

1、公司及控股子公司开展的外汇衍生品交易以锁定成本、规避和防范汇率、利率风险为目的，禁止任何风险投机行为。

2、公司及控股子公司将严格遵循《金融衍生品交易业务管理制度》，控制交易风险。

3、公司及控股子公司将审慎审查与交易对手方签订的合约条款，严格执行风险管理制度，以防范法律风险。

4、财务部门设置专门人员持续跟踪外汇衍生品公开市场价格及公允价值变动，及时评估外汇衍生品交易的风险敞口变化情况，并定期向公司管理层报告，发现异常情况及时上报，提示风险并执行应急措施。

5、审计部门对外汇衍生品交易的决策、管理、执行等工作的合规性进行监督检查。

天津长荣科技集团股份有限公司

董事会

2025年04月28日