

宁波均普智能制造股份有限公司

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

宁波均普智能制造股份有限公司（以下简称“公司”）提供成套装配与检测智能制造装备、工业机器人及工业数字化智能软件的研发、生产、销售和服务，为新能源智能汽车、医疗健康、消费品及工业机电等领域的全球知名制造商提供智能制造整体解决方案。公司在日常经营过程中涉及外币业务，并持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2026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：包括远期结售汇、人民币和其他外汇的掉期业务、远期外汇买卖、外汇掉期、外汇期权、利率互换、利率掉期、利率期权等业务及以上业务组合；

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：2026 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 5 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公司股东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《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，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业务与日常经营需求密切相关，以规避和防范汇率、利率风险为目的，降低汇率、利率波动对企业经营的影响为宗旨，增强公

司财务稳健性，有利于提升公司外汇风险和利率风险的管控能力，不进行以投机为目的的交易，不存在损害公司及股东利益的情形。此外，公司已根据相关法律法规的要求建立《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，因此公司开展金融衍生品交易业务具有必要性与可行性。

宁波均普智能制造股份有限公司

2026年2月11日