

天海融合防务装备技术股份有限公司

关于 2025 年度证券与衍生品投资情况的专项报告

根据《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，天海融合防务装备技术股份有限公司（以下简称“公司”）董事会对公司 2025 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、2025 年度证券与衍生品投资审议批准情况

公司于 2025 年 4 月 25 日召开第六届董事会第十一次会议、第六届监事会第八次会议，审议通过了《关于 2025 年度继续开展套期保值业务的议案》，同意公司及下属子公司 2025 年继续开展商品期货套期保值业务、外汇套期保值业务。商品期货交易品种只限于在境内期货交易所交易的焦炭，投入保证金金额最高不超过（即授权有效期内任一时点都不超过）1,000 万元人民币；外汇衍生品交易品种包括但不限于外汇期货、远期结售汇、外汇掉期、外汇期权、利率互换、货币互换、利率掉期、利率期权等产品业务，投资金额不超过（即授权有效期内任一时点都不超过）等值 3,000 万美元。期限自公司董事会审议通过之日起至 2025 年年度董事会召开前有效，在上述额度范围内，资金可循环使用。

二、2025 年度证券与衍生品投资情况

1、期货套期保值业务执行情况如下：

公司未开展期货套期保值业务。

2、外汇衍生品业务执行情况如下：

交易类型	币种	获批额度	起始日期	终止日期	报告期内单日最高余额	报告期末占用额度	是否超过额度
远期结售汇、 外汇掉期	美元	3,000 万	2025-01-01	2025-12-31	2,600 万	0	否

三、开展外汇套期保值业务的风险分析

公司及控股子公司开展外汇套期保值业务遵循合法、谨慎、安全和有效的原则，不做投机性、套利性的交易操作，但外汇套期保值业务操作仍存在一定的风险：

1、汇率波动风险：在汇率波动较大的情况下，银行结售汇汇率报价可能偏离公司实际收付时的汇率，造成汇兑损失。

2、交易违约风险：交易对手方出现违约时，不能按照约定支付公司套期保值盈利从而无法对冲公司实际的汇兑损失，将造成公司损失。

3、其它风险：在开展交易时，如操作人员未按规定程序进行外汇套期保值交易操作或未能充分理解外汇套期保值信息，将带来操作风险；因相关法律发生变化或交易合同条款不明确，将可能面临法律风险。

四、外汇套期保值业务的风险控制措施

1、公司已制定《外汇套期保值业务管理制度》，对外汇套期保值业务的操作原则、审批权限、责任部门及责任人、内部操作流程、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序、信息披露等作了明确规定。公司将严格按照制度的规定进行操作，保证制度有效执行，严格控制业务风险。

2、公司开展外汇套期保值业务将以规避和防范汇率风险为目的，遵循合法、审慎、安全、有效的原则，不进行投机和套利交易，在签订合同时严格基于公司外汇收支的预测金额进行交易。

3、公司财务部门持续关注套期保值业务的市场信息，跟踪套期保值业务公开市场价格或公允价值的变化，适时调整操作策略，最大限度的避免汇兑损失。

4、公司内审部定期对外汇套期保值业务的决策、管理、执行等工作的合规性进行监督检查。

5、公司将审慎审查与金融机构签订的合约条款，严格执行风险管理制度，以防范法律风险。

天海融合防务装备技术股份有限公司

董事会

2026年3月27日