

宁波拓普集团股份有限公司

关于开展金融衍生品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

作为业务遍及全球主要汽车市场的零部件供应商，宁波拓普集团股份有限公司（以下简称“公司”）在日常经营过程中涉及外汇业务，并持有有一定数量的外汇资产和外币负债。因受计价货币的汇率或利率变动，形成了外汇资产或外币负债敞口。

为减少外汇汇率、利率波动影响，增强公司（含子公司）财务稳健性，公司及子公司拟通过开展金融衍生品交易业务，借助金融工具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。

二、 公司开展的金融衍生品交易业务概述

公司以日常生产经营活动为基础开展金融衍生品交易业务，交易工具包括但不限于远期结售汇、人民币和其他外币的掉期业务、外币买卖、外币掉期、外币期权、利率互换、利率掉期、利率期权等产品或上述产品的组合。上述金融衍生品交易业务其种类、规模及期限均需与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：包括但不限于远期结售汇、人民币和其他外币的掉期业务、外币买卖、外币掉期、外币期权、利率互换、利率掉期、利率期权等产品或上述产品的组合；

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：根据公司及子公司实际生产经营情况，拟开展金融衍生品交易的最高合约价值总额度不超过1亿美元（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）不超过上述审议的总额度。在上述授权额度及期限内，资金可循环滚动使用；

5、交易期限：本次董事会审议通过之日起至2025年6月30日；

6、流动性安排：金融衍生品交易业务以正常外币资产、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

1、汇率波动风险：对于远期结汇等金融衍生品业务，如果到期日即期汇率大于远期结汇约定汇率，则该笔合约将产生亏损。

2、交割风险：实际经营过程中，市场情况可能会发生变化，可能会导致客户不能按时付汇，产生无法按时交割风险。

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，严格执行风险管理制度，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是围绕公司实际外汇收支业务进行的，以具体经营业务为依托，以锁定成本、规避和防范外汇汇率、利率波动风险为目的，是出于公司稳健经营的需求而决定，有利于提升公司外汇风险和利率风险的管控能力，符合公司及全体股东利益，该业务的开展具有必要性。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，因此公司开展外汇及利率金融衍生品交易具有可行性。

宁波拓普集团股份有限公司

2024年8月28日