

网宿科技股份有限公司

2021 年度证券与衍生品投资情况的专项说明

根据《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》及《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》等相关法律法规的规定，网宿科技股份有限公司（以下简称“网宿科技”或“公司”）董事会对 2021 年度证券与衍生品投资情况进行了核查，现将相关说明如下：

一、证券与衍生品投资审议批准情况

2021 年 2 月 22 日，公司召开的第五届董事会第八次会议、第五届监事会第六次会议审议通过《关于开展金融衍生品交易业务的议案》。经审议，同意公司根据海外业务的发展情况，在不超过人民币 5 亿元或等值外币的额度内开展金融衍生品交易业务，上述额度自董事会审批通过后 12 个月内有效，可循环滚动使用。同时，授权公司总经理在余额不超过上述额度范围内行使金融衍生品交易业务的审批权限、签署相关文件并由财务部具体实施衍生品交易业务的相关事宜。

公司于 2022 年 2 月 21 日召开的第五届董事会第二十次会议及 2022 年 2 月 25 日召开的第五届董事会第二十一次会议分别审议通过《关于增加金融衍生品交易额度并延长投资期限的议案》、《关于调整金融衍生品交易授权期限的议案》。经审议，同意将用于金融衍生品交易业务的资金额度由原来不超过人民币 5 亿元或等值外币，调整为不超过人民币 10 亿元或等值外币，授权期限为自第五届董事会第二十次会议审议通过之日起十二个月内有效，上述额度在授权期限内可循环滚动使用。同时，公司董事会授权总经理在余额不超过上述额度范围内行使金融衍生品交易业务的审批权限并由财务部具体实施衍生品交易业务的相关事宜。

二、2021 年度证券与衍生品投资情况

1、衍生品投资情况

为了降低汇率、利率波动对公司经营业绩的影响，公司开展了以套期保值为目的的金融衍生品交易业务，交易资金来源于公司自有资金。2021 年，金融衍生品投资的具体情况如下：

交易类型	币种	2021 年获批的额度	报告期内单日最高余额	期末余额	期末余额占公司报告期末净资产的比例
远期结汇	美元	人民币 5 亿元或等值外币	7,250 万美元	6,800 万美元	4.90%

2、证券投资情况

截至报告期末，公司直接或间接持有的股票期末账面价值为 230,257,758.27 元，主要为公司于 2017 年通过兴全-网宿联通定增特定客户资产管理计划以自有资金认购的中国联合网络通信股份有限公司股票。

三、开展金融衍生品交易的风险分析

(1) 价格波动风险：可能产生因标的利率、汇率、市场价格等波动而导致交易亏损的市场风险。

(2) 流动性风险：因市场流动性不足而无法完成交易的风险。

(3) 履约风险：开展金融衍生品业务存在合约到期交易对手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

(1) 明确金融衍生品交易原则：金融衍生品交易以规避和防范汇率、利率风险为目的，禁止任何风险投机行为。

(2) 制度建设：公司已制定《金融衍生品交易业务管理制度》，对金融衍生品交易业务的操作规范、审批权限、管理流程、信息隔离措施、内部风险报告制度及信息披露和档案管理做出了明确规定，能够有效规范金融衍生品交易行为，控制金融衍生品交易风险。

(3) 产品选择：在进行金融衍生品交易前，在多个交易对手与多种产品之间进行比较分析，选择最适合公司业务背景、流动性强、风险可控的金融衍生工具开展业务。

(4) 交易对手管理：充分了解办理金融衍生品的金融机构的经营资质、实施团队、涉及的交易人员、授权体系，慎重选择信用良好且与公司已建立长期业务往来的银行等金融机构。必要时可聘请专业机构对衍生品的交易模式、交易对手进行分析比较。

(5) 专人负责：设专人对持有的金融衍生品合约持续监控，在市场波动剧烈或风险增大情况下，或导致发生重大浮盈浮亏时及时报告公司决策层，并及时制订应对方案。

五、独立董事意见

经核查，报告期内，公司开展了远期结汇业务，未进行重大证券投资。公司开展远期结汇业务遵循套期保值原则，用于开展远期结汇业务的资金为自有资金，未影响公司主营业务的开展。公司严格按照相关法律法规、《公司章程》以及相关制度的要求开展外汇套期保值业务，进而有效地防范风险，未出现违反相关法律法规及规章制度的行为，不存在损害公司及中小股东利益的情形。

特此说明。

网宿科技股份有限公司董事会

2022年4月22日