

证券代码：300032

证券简称：金龙机电

公告编号：2022-020

金龙机电股份有限公司

关于公司 2021 年度证券与衍生品投资情况的专项报告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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》、《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》等有关规定的要求，金龙机电股份有限公司（以下简称“公司”）董事会对公司 2021 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 2021 年 4 月 22 日、2021 年 5 月 13 日召开的第四届董事会第二十二次会议、2020 年度股东大会审议通过了《关于开展外汇套期保值的议案》，同意公司及子公司在不影响正常经营资金需求及风险可控的前提下，开展外汇套期保值业务，投入额度合计不超过等值 8 亿元人民币的外币金额，业务期间为 2020 年度股东大会审议通过之日起至 2021 年度股东大会召开之日止。具体内容详见公司于 2021 年 4 月 23 日在巨潮资讯网披露的《关于开展外汇套期保值业务的公告》（公告编号：2021-025）。

二、2021 年度证券与衍生品投资情况

公司 2021 年度证券及衍生品投资情况如下：

单位：人民币万元

交易类型	获批的额度	报告期内单日最高余额	期末余额	是否超过获批额度
远期外汇合约	80,000.00	18,581.74	16,677.48	否
合计	80,000.00	18,581.74	16,677.48	否

三、外汇套期保值的风险分析

1、汇率大幅波动风险：在外汇汇率波动较大时，公司判断汇率大幅度波动方向与外汇套期保值合约方向不一致时，将造成汇兑损失；若汇率在未来发生波动时，与外汇套期保值合约偏差较大也将造成汇兑损失；

2、交易违约风险：公司因美元准备不足而导致不能按照约定进行交割带来的违约风险及合约期间美元不能交割带来的机会成本；外汇套期保值交易对手出现违约，不能按照约定交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、内部控制风险：外汇套期保值业务专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内部评审不完善而造成风险。

四、公司采取的风险控制措施

1、公司及其全资子公司开展外汇套期保值业务将遵循以锁定汇率风险目的进行套期保值的原则，不进行投机和套利交易，在签订合同时必须基于公司的外汇收支预测金额进行交易。

2、为避免汇率大幅度波动风险，公司会加强对汇率的研究分析，实时关注市场变化，适时调整经营策略，最大限度的避免汇兑损失。

3、公司制定有《外汇套期保值业务管理制度》，公司将严格按照制度对外汇套期业务进行审批和管理，自公司有权审批机构审议通过后，并经公司总经理、董事长审批同意后，由公司财务总监负责组织实施。公司财务部及时分析和跟踪项目进展情况，如发现存在可能影响公司资金安全的风因素，将及时采取相应措施，控制风险。

五、独立董事关于公司 2021 年度证券与衍生品投资情况的意见

经核查，公司 2021 年度未开展证券投资，仅开展了外汇套期保值业务。公司开展外汇套期保值业务遵循以锁定汇率风险目的进行套期保值的原则，不进行投机和套利交易，开展业务的资金来源为自有资金，未影响公司主业经营的开展。公司严格按照相关法律、法规及《公司章程》、《外汇套期保值业务管理制度》等的有关规定开展业务，并履行了相应的审批程序，未出现违反相关法律法规及公司规章制度的行为，不存在损失公司及股东利益的情形。

特此公告。

金龙机电股份有限公司

董 事 会

2022年4月28日