

协创数据技术股份有限公司

关于公司 2023 年度证券与衍生品投资情况的专项报告

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，协创数据技术股份有限公司（以下简称“公司”）董事会对公司 2023 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 2023 年 4 月 7 日、2023 年 4 月 17 日召开的第三届董事会第八次会议、2022 年度股东大会审议通过了《关于开展外汇套期保值业务的议案》，同意公司及子公司开展外汇套期保值业务，预计任一交易日持有的最高合约价值不超过人民币 16 亿元或等值外币，在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）将不超过上述额度（上述额度包括公司已开展的外汇套期保值业务）；预计动用的交易保证金和权利金上限（包括为交易而提供的担保物价值、预计占用的金融机构授信额度、为应急措施所预留的保证金等）不超过任一交易日所持有最高合约价值的 10%。交易期限为自公司股东大会审议通过之日起十二个月，前述额度在交易期限内可以循环使用，具体内容详见公司于 2023 年 4 月 7 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》。

二、2023 年度证券与衍生品投资情况

公司 2023 年度证券及衍生品投资情况如下：

单位：人民币万元

投资情况	获批的额度	交易类型	期末占用额度金额	报告期内单日最高余额是否超过获批额度
外汇套期保值	160,000	远期合约、 期权合约、 掉期合约	10,297.75	否

三、外汇套期保值的风险分析

公司及子公司开展的外汇套期保值业务遵循合法、审慎、安全、有效的原则，不从事以投机为目的的衍生品交易，但也会存在一定的风险，主要包括：

- 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：开展套期保值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、操作风险：在开展交易时，如操作人员未按规定程序进行外汇衍生品交易操作或未能充分理解衍生品信息，将带来操作风险。
- 5、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《外汇套期保值制度》，对外汇套期保

值业务的审批权限、业务管理及操作流程、后续管理及信息披露、内部风险控制措施以及信息保密和隔离措施等做出明确规定，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。

5、人员搭建：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管理层，并及时制订应对方案。

五、保荐机构关于公司 2023 年度证券与衍生品投资情况的核查意见

经核查，保荐机构认为：公司 2023 年度证券与衍生品投资情况不存在违反《深圳证券交易所创业板股票上市规则》《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》等相关法律法规及规范性文件规定的情形，符合《公司章程》、

《外汇套期保值制度》的规定，决策程序合法、合规。保荐机构对公司 2023 年度证券与衍生品投资情况的专项报告无异议。

特此公告。

协创数据技术股份有限公司

董事会

2024 年 3 月 26 日