

安徽金春无纺布股份有限公司

关于 2023 年度证券与衍生品投资情况的专项说明

根据《深圳证券交易所上市公司自律监管指南第 1 号——业务办理：定期报告披露相关事宜》、《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，安徽金春无纺布股份有限公司（以下简称“公司”）董事会对 2023 年度证券与衍生品投资情况进行了核查，现将有关情况说明如下：

一、证券与衍生品投资审议批准情况

（一）关于证券投资事项

经公司 2023 年 8 月 28 日召开第三届董事会第十六次会议和第三届监事会第十三次会议审议通过了《关于使用闲置自有资金进行证券投资的议案》，同意公司及下属子公司在保障日常生产经营资金需求，有效控制风险的前提下使用不超过（含）1.2 亿元人民币的闲置自有资金进行证券投资。在上述额度内，资金可以滚动使用，但期限内任一时点的证券投资金额（含前述投资的收益进行再投资的相关金额）不得超过投资额度。上述额度自公司董事会审议通过之日起 12 个月内有效。

（二）关于商品期货套期保值事项

公司于 2023 年 12 月 11 日召开第三届董事会第十九次会议及 2023 年 12 月 27 日召开的 2023 年第二次临时股东大会审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》，同意公司及子公司使用自有资金开展期货套期保值业务，保证金总额每年最高不超过（即授权有效期内任一时点都不超过）人民币 5,000 万元，在该额度范围内可以循环使用，上述额度自公司股东大会审议通过之日起 12 个月内有效。

二、2023 年度公司证券与衍生品投资情况

（一）证券投资

截至 2023 年 12 月 31 日，公司证券投资情况具体如下：

单位:万元

证券品种	证券代码	证券简称	最初投资成本	期初账面价值	本期公允价值变动损益	本期购买金额	本期出售金额	报告期损益	期末账面价值
股票	300119	瑞普生物	2,688.50	2,605.40	-706.86	5,077.74	2,605.40	-442.94	4,370.89
股票	300344	立方数科	808.61	802.23	-	321.76	1,123.99	97.43	-
可转债	123049	维尔转债	-	-	-1.03	42.91	-	-1.03	41.88
可转债	123128	首华转债	-	-	0.72	46.98	-	0.72	47.70
可转债	127047	帝欧转债	-	-	-4.43	33.31	-	-4.43	28.87
可转债	128035	大族转债	-	-	-0.01	47.19	-	-0.01	47.18
可转债	128105	长集转债	-	-	0.30	50.84	-	0.30	51.15
可转债	128108	蓝帆转债	-	-	0.20	30.80	-	0.20	31.00
可转债	128124	科华转债	-	-	-0.58	51.09	-	-0.58	50.51
可转债	113013	国君转债	-	-	0.15	29.95	30.10	0.18	-
可转债	113616	韦尔转债	-	-	0.12	7.34	-	0.12	7.45
可转债	113610	灵康转债	-	-	-0.75	33.52	-	-0.75	32.78
可转债	113054	绿动转债	-	-	-0.09	11.13	8.43	-0.12	2.61
可转债	123113	仙乐转债	-	-	-0.73	43.54	-	-0.73	42.81
可转债	113033	利群转债	-	-	0.58	33.76	-	0.58	34.34
可转债	123076	强力转债	-	-	2.70	33.56	-	2.70	36.26
可转债	113584	家悦转债	-	-	0.32	12.83	-	0.32	13.16
合计			3,497.11	3,407.63	-709.38	5,908.24	3,767.92	-348.04	4,838.57

(二) 商品期货套期保值

截至2023年12月31日,公司商品期货套期保值情况具体如下:

单位:万元

衍生品投资类型	初始投资金额	期初金额	本期公允价值变动损益	报告期内购入金额	报告期内售出金额	期末金额
涤纶短纤期货合约	-	-	442.29	34,570.57	34,570.57	0
合计	-	-	442.29	34,570.57	34,570.57	0

三、报告期内执行证券投资内控制度情况

公司制定了《证券投资管理制度》、《期货套期保值业务管理制度》规范公司证券投资、商品套期保值行为,明确相关内部决策程序、业务操作流程、风险控制措施等,能有效防范风险。2023年度,公司严格按照上述制度相关规定进行证券投资和开展套期保值业务,未有违反相关法律法规及规范性文件规定之情形。

四、证券与衍生品投资对公司的影响

在保证日常经营运作资金需求，有效控制投资风险前提下，利用自由暂时闲置资金进行证券与衍生品投资，未影响公司主营业务的发展，符合公司和全体股东的利益。

五、董事会意见

2024年04月18日公司召开第三届董事会第二十二次会议审议通过了《关于2023年度证券与衍生品投资情况的专项说明的议案》，2023年度公司严格按照相关法律法规、《公司章程》及相关内控制度的要求，在保证日常经营运作资金需求，有效控制投资风险前提下，使用自有闲置资金开展证券投资及衍生品交易，未出现违反相关法律法规及规章制度的行为，不存在损害公司及股东利益的情形。

六、监事会意见

2024年04月18日公司召开第三届监事会第十八次会议审议通过了《关于2023年度证券与衍生品投资情况的专项说明的议案》，经审核，监事会认为：2023年度，公司的证券投资及衍生品交易严格遵循《公司章程》及相关内控制度的规定，不存在违反法律法规及规范性文件规定的情形。

七、保荐机构核查程序及核查意见

保荐机构查阅了公司股东大会、董事会、监事会等会议记录以及独立董事意见。核查公司证券账户交易记录、资金支付凭证及募集资金账户对账单；查阅《公司章程》、《证券投资管理制度》等制度，与相关管理人员就证券投资的投资情况、实施流程、风险控制措施进行沟通。

经核查，保荐机构认为：公司2023年度证券及衍生品投资资金来源为自有资金，未有违反《深圳证券交易所创业板股票上市规则（2023年修订）》、《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、《证券投资管理制度》的规定，决策程序合法、合规，鉴于公司本次投资范围属于高风险投资，保荐机构提请公司董事会和投资者充分重视证券与衍生品投资事项对公司带来的潜在风险。

安徽金春无纺布股份有限公司

董事会

二〇二四年四月二十日