

新乡市瑞丰新材料股份有限公司

关于2024年第一季度证券投资与衍生品交易情况的专项说明

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

根据《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第2号——创业板上市公司规范运作》《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》等有关规定的要求，公司董事会对公司2024年第一季度证券投资与衍生品交易情况进行了核查，现将相关情况说明如下：

一、证券投资与衍生品交易审议批准情况

公司于2023年10月23日召开的第三届董事会第十八次会议、第三届监事会第十六次会议审议通过了《关于开展证券投资及衍生品交易的议案》，同意公司及子公司在充分保障日常经营性资金需求并有效控制风险的前提下，使用自有资金不超过人民币5亿元（或等值外币）进行证券投资及衍生品交易，在该额度内可由公司及子公司在各投资产品间自由分配，共同循环使用，投资取得的收益可以进行再投资，再投资的金额包含在本次预计投资额度范围内。公司开展证券投资的业务范围为外部评级较高且公开发行、风险可控的债券。公司开展的衍生品业务主要包括远期结售汇、外汇掉期、外汇互换、外汇期货、外汇期权及其他衍生产品等业务，对应基础资产包括汇率、利率、货币等资产或上述资产组合。业务期间为自公司董事会审议通过之日起12个月内有效。具体内容详见公司于2023年10月24日在巨潮资讯网披露的《关于开展证券投资及衍生品交易的公告》（公告编号：2023-068）。

二、2024年第一季度证券投资与衍生品交易情况

1、证券投资情况

2024年第一季度，公司使用部分暂时闲置自有资金进行证券交易，最高额未超过人民币5亿元（或等值外币）。具体投资情况如下：

交易类型	币种	本期购买金额 (万美元)	报告期损益(万 美元)	期末账面价值 (万美元)	会计核算科目
债券	美元	1,001.19	6.83	1,008.02	交易性金融资产
合计		1,001.19	6.83	1,008.02	-

2、衍生品交易情况

交易类型	币种	获批的额度(万 人民币)	报告期内单日协议约定最高累计余额(万美 元)	期末占用额度 金额(万美元)	是否超过获批 额度
外汇期权	美元	50,000.00	800.00	500.00	否
合计	-	50,000.00	800.00	500.00	否

三、风险分析

1、市场风险

金融市场受宏观经济形势、财政及货币政策、产业政策、利率等方面的影响，存在一定的市场和政策波动风险。公司将根据经济形势以及金融市场的变化适时适量的介入。

2、流动性风险

投资产品的赎回、出售及投资收益的实现受相应产品价格因素的影响，需遵守相应的交易结算规则和协议的约束，相比货币资金存在一定的流动性风险。

3、操作风险

公司在开展业务时，如操作人员未按规定程序进行交易操作或未能充分理解投资产品的信息，将存在一定的操作风险。

四、公司采取的风险控制措施

1、公司遵循合法、审慎、安全、有效的原则，控制投资风险，严格按照董事会审批通过的授权额度审慎投资。

2、公司已经制定《证券投资及衍生品交易管理制度》，对交易的决策权限、交易的管理、信息披露等作了明确的规定，以控制相关风险。

3、公司将根据经济形势以及市场环境的变化，加强市场分析和调研工作，发现或判断有不利因素，及时调整投资策略及规模，及时采取相应的措施，严格控制投资风险。

4、公司内部审计部门定期对投资业务情况进行监督管理，独立董事、监事会 有权对公司投资资金的使用情况进行监督与检查。董事会审计委员会、独立董事、监事会如发现违规操作情况，可提议召开董事会审议停止公司的证券投资等活动。

五、监事会审议情况

公司第三届监事会第二十一次会议审议通过了《关于<公司2024年第一季度证券与衍生品交易情况专项说明>的议案》，公司监事会认为：2024年第一季度，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。

特此报告。

新乡市瑞丰新材料股份有限公司

董事会

2024年4月26日