

# 翰博高新材料（合肥）股份有限公司

## 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，翰博高新材料（合肥）股份有限公司（以下简称“公司”）董事会对公司 2023 年度外汇衍生品投资情况进行了核查，现将相关情况说明如下：

### 一、证券与外汇衍生品投资审议批准情况

公司于 2022 年 12 月 26 日召开第三届董事会第二十二次会议，审议通过《关于开展外汇套期保值业务的议案》，同意公司及合并报表范围内子公司开展包括但不限于远期结售汇、期权、期货、掉期（互换）等产品或者混合上述产品特征的金融工具交易，实现以规避风险为目的的资产保值，降低汇率波动对公司的影响。用于以上外汇衍生产品业务的金额不超过人民币 10,000 万元，前述额度可滚动使用，有效期自第三届董事会第二十二次会议通过之日起 12 个月内。具体内容详见公司于 2022 年 12 月 28 日在巨潮资讯网上披露的《关于公司 2022 年度开展外汇衍生产品业务的公告》（公告编号：2022-050）。

### 二、2023 年度开展证券与外汇衍生品交易具体情况

2023 年，公司未开展证券投资。

2023 年度，公司以套期保值为目的开展外汇衍生产品业务，无风险投机行为，资金来源均为自有资金。2023 年度公司严格按照《外汇衍生品交易业务管理制度》等相关规定的要求，控制交易风险，未有违反法律法规及规范性文件规定之情形。

业务	审议额度	期末占用额度 金额	报告期损益	报告期内单日最 高余额是否超过 获批额
外汇套期保值	人民币 10,000 万元	美元 200 万元	人民币 25.8 万元	否

### 三、外汇衍生品交易业务的风险分析

公司及合并报表范围内子公司开展外汇衍生品交易业务遵循谨慎性原则，不做投机性、套利性的交易操作，但外汇衍生品交易业务操作仍存在一定的风险。

1、市场风险：因外汇行情变动较大，可能产生因标的利率、汇率等市场价格波动引起外汇金融衍生品价格变动，造成亏损的市场风险；

2、内部控制风险：外汇衍生品交易业务专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内部控制机制不完善而造成风险；

3、履约风险：开展衍生品业务存在合约到期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、风险控制措施

1、遵循谨慎性原则：为防范内部控制风险，所有的外汇交易均以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，不进行单纯以投机为目的的外汇交易，不影响公司主营业务的发展；

2、不断完善相关内控制度：公司制定了《外汇衍生品交易业务管理制度》，对业务操作原则、业务审批权限、业务管理及内部操作流程、信息隔离措施、内部风险控制程序等方面进行了明确规定；

3、严格控制交易规模：严格控制外汇衍生品交易业务的交易规模，确保在董事会授权额度范围内进行交易；

4、严格挑选合作金融机构：公司及子公司将认真选择合作的金融机构，在外汇衍生品交易业务操作过程中，财务部门将根据与金融机构签署的协议中约定的外汇金额、汇率及交割期间及时与金融机构进行结算；

5、严格审查和执行合约：公司将审慎审查签订的合约条款，严格执行风险管理制度，以防范法律风险；

6、防范并及时报告重大风险：公司财务部门具体经办远期结售汇及外汇期权交易事项，负责方案拟订、资金筹集、业务操作、日常询价和联系及相关账务处理，在出现重大风险或可能出现重大风险时，及时向公司董事长提交分析报告和解决方案，同时向公司董事会秘书报告；

7、审计部门监督：公司审计部门有权对外汇衍生品交易的决策、管理、执行等工作的合规性进行监督检查。

## 五、保荐人核查意见

经上述核查，本保荐人认为公司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，符合公司章程的规定，决策程序合法、合规。

特此公告。

翰博高新材料（合肥）股份有限公司

董事会

2024年4月25日