

## 中山大洋电机股份有限公司

### 董事会对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 1 号——主板上市公司规范运作》《深圳证券交易所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，中山大洋电机股份有限公司（以下简称“公司”）董事会对公司2025年度证券与衍生品投资情况进行了认真核查，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）证券投资审议批准情况

2025年3月11日，公司召开第六届董事会第二十六次会议，审议通过了《关于使用闲置自有资金购买理财产品的议案》，同意公司及合并报表范围内的子公司在保障日常运营资金需求的前提下，使用闲置自有资金不超过人民币20亿元适时购买安全性较高、流动性好、中低风险、短期（不超过一年）的理财产品，在此额度范围内，资金可以循环使用。自公司第六届董事会第二十六次会议审议通过之日起1年内有效。具体内容详见公司刊载于2025年3月13日巨潮资讯网（[www.cninfo.com.cn](http://www.cninfo.com.cn)）上的《关于使用闲置自有资金购买理财产品的公告》（公告编号：2025-012）。

##### （二）衍生品投资审议批准情况

2023年4月21日，公司召开第六届董事会第六次会议，审议通过了《关于开展2025年度商品期货套期保值业务的议案》，同意公司及子公司2025年度通过境内外期货交易所对不超过20,700吨铜期货与18,500吨铝期货进行套期保值，预计累计所需保证金余额不超过人民币14,800万元和人民币4,250万元，在上述额度范围内，资金可循环使用。具体内容详见公司刊载于2023年4月25日巨潮资讯网（[www.cninfo.com.cn](http://www.cninfo.com.cn)）上的《关于开展2025年度商品期货套期保值业务的公告》（公告编号：2023-009）。

2024年4月19日，公司召开第六届董事会第十五次会议，审议通过了《关于开展远期外汇套期保值业务的议案》，同意公司及子公司开展远期外汇套期保值业务，预计2025年度外汇远期结售汇合约累计发生额不超过人民币50亿元或等值外币。具体内容详见公

司刊载于2024年4月23日巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）上的《关于开展远期外汇套期保值业务的公告》（公告编号：2024-017）。

## 二、2025年度证券与衍生品投资的总体情况

### （一）证券投资

2025年度，公司未使用自有资金购买理财产品，报告期内无理财产品损益。截至2025年12月31日，公司无未到期的银行理财产品。

### （二）衍生品投资

2025年度，公司以套期保值为目的的衍生品投资情况如下表：

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	计入权益的累计公允价值变动	报告期内购入金额	报告期内售出金额	期末金额	期末投资金额占公司报告期末净资产比例
期货	6,933.61	6,933.61	0	236.60	10,920.46	17,306.84	547.23	0.05%
期汇	75,259.25	75,259.25	229.91	1,877.90	76,203.17	109,952.62	41,509.8	4.12%
合计	82,192.86	82,192.86	229.91	2,144.50	87,123.63	127,259.46	42,057.03	4.17%
衍生品投资资金来源	自有资金							
报告期实际损益情况的说明	期货及远期外汇套期工具产生的损益抵消了被套期项目因铜、铝现货价格波动及汇率波动产生的价值变动。							
套期保值效果的说明	报告期内公司开展的套期保值业务严格按公司相关流程制度操作，套期保值业务平抑了现货市场价格波动及现汇市场汇率波动对公司盈利的影响，达到预期保值效果。							

## 三、内控制度执行情况

为规范公司证券与衍生品投资行为，加强风险控制，提高投资收益，切实维护公司与股东权益，公司依据《中华人民共和国证券法》《深圳证券交易所股票上市规则》《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第1号——主板上市公司规范运作》等相关法律法规及《公司章程》，结合实际情况，制定了《证券投资与衍生品交易管理制度》。该制度对证券与衍生品投资的原则、决策权限、风险控制、监督及信息披露等方面作出了详细规定，能有效防范投资风险。

2025年度，公司严格遵循上述制度开展证券投资与衍生品交易，不存在违反相关法律法规及规范性文件规定的情形。

#### 四、董事会的说明与意见

公司及子公司开展的商品期货套期保值业务和远期外汇套期保值业务，均以规避风险为目的，不存在投机和套利交易。其中，商品期货套期保值业务旨在有效对冲原材料市场价格波动风险，服务于稳定生产经营的客观需要；远期外汇套期保值业务则主要用于管理因外销业务产生的外币结算风险，以降低汇率波动对经营业绩的潜在影响。两项业务的开展均以公司实际业务需求为基础，并已履行完备的内部决策程序，符合《公司章程》及相关法律法规的要求，是公司强化全面风险管理、维持财务稳健性的重要举措。

特此说明。

中山大洋电机股份有限公司

董 事 会

2026年3月24日