

宁波均胜电子股份有限公司

关于开展金融衍生品交易业务的可行性分析报告

一、交易情况概述

（一）交易目的

作为业务遍布全球主要汽车市场所在地区/国家的全球汽车一级零部件供应商，宁波均胜电子股份有限公司（以下简称“均胜电子”或“公司”）在日常经营过程中涉及外币业务，并持有有一定数量的外币资产及外币负债，从而在利率及汇率端形成风险敞口。为有效规避和防范汇率及利率大幅波动对公司造成的不利影响，在保证日常运营资金需求的前提下，公司计划在 2026 年与经营稳健、资信良好，具有金融衍生品交易业务资格的境内外银行等金融机构开展外汇与利率套期保值业务，进一步提升抗风险能力，增强公司财务稳健性。

（二）交易金额

1、外汇套期保值业务：公司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）不超过人民币 60,000 万元，预计任一交易日持有的最高合约价值不超过人民币 480,000 万元。

3、利率套期保值业务：公司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）不超过人民币 40,000 万元，预计任一交易日持有的最高合约价值不超过人民币 320,000 万元。

上述资金额度在授权期限内（即自股东会审议通过之日起 12 个月内）均可循环滚动使用，但期限内任一时点的金额（含使用前述交易的收益进行交易的相关金额）不超过已审议额度。

（三）资金来源

公司在套期保值业务中投入的资金（保证金）为自有资金与借贷资金，不

涉及募集资金。

（四）交易方式

1、交易品种：公司开展金融衍生品业务的品种仅限于与公司经营相关的外币汇率及利率；

2、交易工具：为降低利率及汇率波动风险，公司拟开展的金融衍生品交易业务包括但不限于远期结售汇、外汇掉期、利率掉期等；

3、交易场所：公司开展上述交易对手均为经营稳健、资信良好，具有金融衍生品交易业务经营资格且资信良好的境内外银行等金融机构，不涉及公司关联方。

（五）交易期限

本次授权的金融衍生品交易规模有效期至公司股东会审议新的授权为止，且相关授权期限不超过 12 个月。

二、公司开展金融衍生品交易的风险分析

遵循合法、谨慎、稳健、安全和有效的原则，公司金融衍生品业务以日常生产经营活动为基础，不进行以投机为目的的外汇交易，但金融衍生品交易仍存在一定的风险：

1、市场风险：金融衍生品业务存在因标的利率、汇率等市场价格波动导致金融衍生品价格变动而造成亏损的市场风险。

2、违约风险：开展金融衍生品交易业务存在因合约到期交易对方无法履约造成违约而带来的风险。

3、流动性风险：因公司业务变动、市场变动、客户违约等各种原因需提前平仓或展期已办理的外汇衍生品交易业务，存在须向银行支付差价的风险或造成延期交割导致公司损失的风险。

4、法律风险：因相关法律发生变化或交易对手违反相关法律法规可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失。

三、公司开展金融衍生品交易采取的风险控制措施

1、公司已制定《均胜电子期货和衍生品交易管理制度》，制定了严格的决

策程序、报告机制和监控措施，明确了工作职责、审批权限、操作要点和信息披露等具体要求。公司在开展衍生品交易业务时，将严格按照相关内部控制制度执行。

2、公司开展的金融衍生品交易业务以实际业务需求为基础，以锁定成本、规避和防范汇率及利率风险为目的，禁止任何风险投机行为。

3、公司将审慎核查与具有合法资质的金融机构签订的合约条款，严格执行风险管理制度，防范法律风险。

4、公司实时关注金融衍生品交易业务各项风险因素，市场波动有较大影响时及时预警并制定应对方案。

六、公司开展金融衍生品交易的可行性分析结论

公司开展金融衍生品交易业务以日常生产经营活动为基础，不以投机和套利交易为目的，有助于规避和防范部分大宗商品价格、外汇及利率大幅波动对公司产生的不利影响，提升公司的财务稳健性，不会对公司日常资金正常周转及主营业务正常开展造成影响。同时，公司将根据相关法律法规及《均胜电子期货和衍生品交易管理制度》的相关规定审慎开展该类业务，落实风险防范措施，所采取的针对性风险控制措施切实可行，公司开展上述金融衍生品交易具有可行性。因此，公司开展该类业务具备必要性与可行性。

宁波均胜电子股份有限公司

2026年3月30日