

深圳市兆威机电股份有限公司

关于开展外汇套期保值业务的可行性分析报告

一、开展外汇套期保值业务的背景

随着公司国际业务的发展需求，国际化布局深入推进，为进一步提高公司应对外汇市场波动风险的能力，更好地规避和防范因外汇汇率及外汇利率大幅波动对公司造成的不利影响，合理优化财务费用，增强公司财务稳健性，公司拟与银行等金融机构开展外汇套期保值业务。

二、拟开展外汇套期保值业务概述

1、交易金额

根据公司业务需求情况，公司拟开展外汇套期保值业务预计动用的交易保证金和权利保证金（包括为交易而提供的担保物的价值、预计占用的金融机构的授信额度、为应急措施所预留的保证金等）任一时点不超过人民币 12,000 万元（或等值外币），预计任一交易日持有的最高合约价值（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）不超过人民币 50,000 万元（或等值外币）。

2、交易方式

公司拟开展的外汇套期保值业务交易对手为依法设立、经营稳健、资信良好，具有金融衍生品交易业务经营资格的金融机构。本次外汇套期保值业务交易对手方不涉及关联方。交易币种包括但不限于美元、欧元、日元、泰铢、港币等与实际业务相关的币种。交易工具包括但不限于远期结售汇、外汇掉期、外汇期权等。

3、交易期限

本次拟开展的外汇套期保值业务交易期限自董事会审议通过之日起 12 个月内有效，上述额度在交易期限内可循环滚动使用，并授权董事长或其授权人士在额度范围内具体实施上述外汇套期保值业务相关事宜。如单笔交易的存续期超过了本次决议的有效期限，则本次决议的有效期限自动顺延至单笔交易终止时止。

4、资金来源

公司拟开展外汇套期保值业务的资金来源均为自有资金，不涉及使用募集资金或银行信贷资金。

三、外汇套期保值业务的风险分析及风险管理措施

（一）风险分析

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、内部操作风险：外汇套期保值交易业务专业性较强，可能会由于员工操作失误、系统故障等原因导致在办理外汇套期保值业务过程中造成损失。

3、法律风险：因相关法律发生变化或交易对手违反法律制度造成外汇合约无法正常执行而导致的损失。

4、流动性风险：不合理的外汇套期保值产品购买安排可能引发公司资金的流动性风险。

5、履约风险：不合适的交易对方选择可能引发公司购买外汇套期保值产品的履约风险。公司开展外汇套期保值的交易对方均为信用良好的金融机构，履约风险低。

（二）风险管理措施

1、公司开展外汇套期保值业务以保值为原则，公司将加强对汇率的研究分析，实时关注国际市场环境变化，适时调整经营策略，最大程度降低结汇损失。

2、公司已建立《外汇套期保值业务管理制度》，该制度对外汇套期保值业务的操作原则、审批权限、业务管理及操作流程等方面进行规范；公司将严格按照规定进行操作，控制业务风险。

3、公司财经部门负责外汇套期保值业务的具体操作办理，所有的外汇交易行为均以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，不得进行投机和套利交易，并严格按照《外汇套期保值业务管理制度》的规定进行业务操作，有效地保证制度的执行。

四、外汇套期保值业务对公司的影响

公司开展外汇套期保值业务以日常经营需要和防范汇率风险为前提，有助于降低汇率大幅波动带来的预期风险，防范汇率波动对公司利润的影响，从而减少汇兑损失，降低财务费用。

五、开展外汇套期保值业务的可行性分析结论

公司拟开展的外汇套期保值业务与日常经营需求紧密相关，基于公司外币资

产、负债状况及预期外汇收支情况，按照真实的业务背景进行。该业务旨在应对汇率、利率波动风险，增强公司财务稳健性，符合公司稳健经营的要求。综上，公司开展外汇套期保值业务具有必要性和可行性。

深圳市兆威机电股份有限公司

董 事 会

2026年4月28日