

# 中联重科股份有限公司董事会

## 关于公司 2019 年证券投资情况的专项说明

根据《深圳证券交易所主板上市公司规范运作指引》、深圳证券交易所《主板信息披露业务备忘录第 1 号—定期报告披露相关事宜》等有关规定的要求,中联重科股份有限公司(以下简称“公司”)董事会对公司 2019 年度证券投资情况进行了核查,现将相关情况说明如下:

### 一、证券投资审议批准情况

#### 1、关于委托理财事项

经公司 2019 年 3 月 29 日召开的第六届董事会第二次会议,及 2019 年 6 月 21 日召开的 2018 年年度股东大会审议通过的《公司关于授权进行低风险投资理财业务的公告》,低风险投资理财额度不超过 170 亿元人民币,在该额度内,资金可滚动使用。

#### 2、关于金融衍生品事项

经公司 2019 年 3 月 29 日召开的第六届董事会第二次会议,及 2019 年 6 月 21 日召开的 2018 年年度股东大会审议通过的《公司关于授权开展金融衍生品业务的议案》,为满足公司及其控股子公司进行套期保值业务的需要,授权公司开展金融衍生品业务,名义本金不超过人民币 70 亿元,在该额度内循环操作。

### 二、2019 年度公司证券投资情况

#### 1、委托理财的情况

2019 年公司以闲置资金购买了中短期银行理财产品、债券型基金及券商集合资

产管理计划。2019 年度公司使用闲置资金购买投资理财产品的本金累计 321,000 万元，获得收益约 6,902 万元，具体情况如下：

单位：万元

受托机构名称（或受托人姓名）	受托机构（或受托人）类型	产品类型	金额	资金来源	起始日期	终止日期	资金投向	报酬确定方式	参考年化收益率	预期收益（如有）	报告期实际损益金额	报告期损益实际收回情况	计提减值准备金额（如有）	未来是否还有委托理财计划	未来是否还有委托理财计划	事项概述及相关查询索引（如有）
浙商银行股份有限公司	银行理财	银行非保本浮动收益型理财产品	50000	自有资金	2019-1-18	2019-10-17	债券、货币市场工具、同业存款、符合监管要求的资产收益权、货币市场基金、债券基金、资产证券化产品等	非保本浮动收益	4.77%	1777	1777	1777	0	是	有	无
广发证券股份有限公司	券商资管	券商非保本浮动收益型理财产品	20000	自有资金	2019-2-27	2019-11-21	银行存款、债券等法规、监管规定允许范围内的其他低风险高流动性的金融资产	非保本浮动收益	5.30%	775	832	832	0	是	有	无
阳光资产管理股份有限公司	资产管理公司	资产管理公司资产管理计划	10000	自有资金	2019-3-26	2019-6-18	银行存款、债券、货币基金、债券基金等法律法规或监管允许投资的流动性和固定收益类资产	非保本浮动收益	4.25%	98	98	98	0	是	有	无
中国光大银行股份有限公司	银行理财	银行非保本浮动收益型理财产品	15000	自有资金	2019-3-27	2020-3-27	债券、货币市场工具、同业存款等固定收益类产品	非保本浮动收益	5%	752	565	565	0	是	有	无
阳光	资产管理	资产	40000	自有	2019	2019	银行存款、债	非保	4.25	321	321	321	0	是	有	无

资产管理股份有限公司	理公司	管理公司资产管理计划		资金	-4-10	-6-18	券、货币基金、债券基金等法律法规或监管允许投资的流动性和固定收益类资产	本浮动收益	%							
湖南省信托有限责任公司	信托公司	信托产品	15000	自有资金	2019-5-15	不超过2021-5-13	信托债权资产	固定收益	11.80%	2405	1225	1225	0	是	有	无
华夏银行股份有限公司	银行理财	银行非保本浮动收益型理财产品	50000	自有资金	2019-7-31	2020-7-31	现金、国债、央行票据、金融债、企业债、短期融资券、中期票据等高信用等级债券	非保本浮动收益	4.80%	2407	1006	0	0	是	有	无
南方基金管理有限公司	公募基金	定期开放债券型基金	15000	自有资金	2019-7-29	2022-10-29	债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等中国证监会允许基金投资的其他金融工具	浮动收益、净值型产品	浮动收益	0	235	210	0	是	有	无
平安基金管理有限公司	公募基金	定期开放债券型基金	18000	自有资金	2019-9-2	2020-9-2	债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等中国证监会允许基金投资的其他金融工具	浮动收益、净值型产品	浮动收益	0	144	0	0	是	有	无
华夏基金管理有限公司	公募基金	开放式债券型基金	18000	自有资金	2019-9-6	随时赎回	债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等中国证监会允许基金投资的其他金融工具	浮动收益、净值型产品	浮动收益	0	188	544	0	是	有	无
浦发银行股份有限公司	银行理财	银行非保本浮	50000	自有资金	2019-4-4	2019-6-11	现金、国债、地方政府债、央行票据、政	非保本浮动收	4.80%	447	447	447	0	是	有	无

有限公司		动收益型理财产品					策性金融债等流动性较好的产品以上评级	益								
中国银行股份有限公司	银行理财	银行保证收益型理财产品	10000	自有资金	2019-9-25	2019-10-28	国债、中央银行票据、金融债、银行存款、大额可转让定期存单等法规、监管规定允许范围内的其他低风险高流动性的金融资产	固定收益	3.50%	32	32	32	0	是	有	无
中国银行股份有限公司	银行理财	银行保证收益型理财产品	10000	自有资金	2019-9-20	2019-10-22	国债、中央银行票据、金融债、银行存款、大额可转让定期存单等法规、监管规定允许范围内的其他低风险高流动性的金融资产	固定收益	3.50%	31	31	31	0	是	有	无
合计			321,000	--	--	--	--	--	--	9,045	6,902	6,082	0	--	--	--

## 2、金融衍生品的情况

衍生品投资操作方名称	关联关系	是否关联交易	衍生品投资类型	衍生品投资初始投资金额	起始日期	终止日期	期初投资金额	报告期内购入金额	报告期内售出金额	计提减值准备金额(如有)	期末投资金额	期末投资金额占公司报告期末净资产比例	报告期实际损益金额
银行	无	否	远期外汇合约	47,083.80	2019年1月1日	2019年12月31日	47,083.80	-	47,083.80	无	0	0	-601.57

合计	47,083.80	--	--	47,083.80	-	47,083.800	无	0	0	-601.57
衍生品投资资金来源	公司自有资金									
涉诉情况（如适用）	不适用									
衍生品投资审批董事会公告披露日期（如有）	2019年3月30日									
衍生品投资审批股东会公告披露日期（如有）	2019年6月22日									
报告期衍生品持仓的风险分析及控制措施说明（包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、操作风险、法律风险等）	<p>公司开展的金融衍生品业务，是以套期保值为目的，用于锁定成本、规避利率、汇率等风险，与主营业务密切相关的简单金融衍生产品，且衍生产品与基础业务在品种、规模、方向、期限等方面相匹配，符合公司谨慎、稳健的风险管理原则。</p> <p>1、风险分析</p> <p>（1）市场风险：集团及成员企业开展的金融衍生品业务，主要为与主营业务相关的套期保值类业务，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风险；</p> <p>（2）流动性风险：因开展的衍生品业务均为通过金融机构操作的场外交易，以公司进出口收付汇业务及本外币基础业务为基础，实质未占用可用资金，但存在因各种原因平仓斩仓损失而须向银行支付价差的风险；</p> <p>（3）其他风险：在具体开展业务时，内部控制流程不完善、员工操作、系统等原因均可能导致公司在金融衍生品交易业务的过程中承担损失。同时，如交易人员未能充分理解交易合同条款和产品信息，将面临因此带来的法律风险及交易损失。</p> <p>2、风险控制措施</p> <p>（1）中联重科集团财务有限公司负责统一代理集团成员企业管理金融衍生品业务，实时关注国际外汇市场动态变化，加强对汇率及利率的信息分析，严格按照《金融衍生品业务内部控制制度》的规定进行业务操作，保证有效执行，最大限度避免汇兑损失。</p> <p>（2）公司已制定《金融衍生品业务内部控制制度》及其他相关流程制度，针对公司的金融衍生品业务交易额度、品种范围、审批权限、内部流程、责任部门、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序、信息披露及档案管理等做出了明确规定；</p> <p>（3）交易对手管理：从事金融衍生业务时，慎重选择与实力较好的境内外大型商业银行开展金融衍生品业务，密切跟踪相关法律法规，规避可能产生的法律风险。</p> <p>（4）加强对银行账户和资金的管理，严格遵守资金划拨和使用的审批程序。</p> <p>（5）当市场发生重大变化或出现重大浮亏时要成立专门工作小组，及时建</p>									

	立应急机制，积极应对，妥善处理。 (6) 选择恰当的风险评估模型和监控系统，持续监控和报告各类风险，在市场波动剧烈或风险增大情况下，增加报告频度，并及时制订应对预案。
已投资衍生品报告期内市场价格或产品公允价值变动的情况，对衍生品公允价值的分析应披露具体使用的方法及相关假设与参数的设定	报告期末已投资未到期衍生品投资余额为 0，公允价值余额为 0。
报告期公司衍生品的会计政策及会计核算具体原则与上一报告期相比是否发生重大变化的说明	否
独立董事对公司衍生品投资及风险控制情况的专项意见	公司独立董事认为：与主业业务密切相关的简单金融衍生产品与基础业务在品种、规模、方向、期限等方面相匹配，符合公司谨慎、稳健的风险管理原则。公司通过外汇资金业务的开展，进一步提升公司外汇风险管理能力，为外汇资产进行保值增值。通过上述衍生品的投资业务，有利于充分发挥公司竞争优势，公司开展金融衍生品业务是可行的，风险是可控的。公司董事会的决策程序符合相关法律、法规及《公司章程》的规定。同意《公司关于授权开展金融衍生品业务的议案》。

### 三、内控制度执行情况

#### 1、委托理财的情况

公司制定了《理财产品管理制度》，对理财产品的管理机构、实施流程、信息保密措施等方面进行了规定，中联重科集团财务有限公司（简称“财务公司”）作为理财产品业务的具体经办单位，制定了财务公司《授权管理办法》、《资金管理办法》等内部管理制度及流程，对投资理财业务流程、审批权限、风险评估、档案管理等进行了明确的规定，有效防范投资风险，确保资金安全。

2019 年，公司严格按照相关法律法规、《公司章程》、《理财产品管理制度》及财务公司《授权管理办法》及《资金管理办法》等相关规章制度的要求进行投资理财产品的购买，未发现违反相关法律法规及规章制度的行为。

#### 2、金融衍生品的情况

(1) 中联重科集团财务有限公司负责统一代办集团成员企业管理金融衍生品业

务，加强对汇率及利率的研究分析，实时关注国际市场环境变化，严格按照《金融衍生品业务内部控制制度》的规定进行业务操作，保证有效执行，最大限度避免汇兑损失。

(2) 公司已制定《金融衍生品业务内部控制制度》及其他相关流程制度，针对公司的金融衍生品业务交易额度、品种范围、审批权限、内部流程、责任部门、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序、信息披露及档案管理等做出了明确规定；

(3) 交易对手管理：从事金融衍生业务时，慎重选择与实力较好的境内外大型商业银行开展外汇套期保值业务，密切跟踪相关法律法规，规避可能产生的法律风险。

(4) 加强对银行账户和资金的管理，严格遵守资金划拨和使用的审批程序。

(5) 当市场发生重大变化或出现重大浮亏时要成立专门工作小组，及时建立应急机制，积极应对，妥善处理。

(6) 选择恰当的风险评估模型和监控系统，持续监控和报告各类风险，在市场波动剧烈或风险增大情况下，增加报告频度，并及时制订应对预案。

#### **四、独立董事关于公司 2019 年证券投资情况的意见**

根据深圳证券交易所的有关规定，我们对公司 2019 年度证券投资情况进行了认真核查。经核查，2019 年公司除开展委托理财和金融衍生品业务，未进行其他证券投资。我们认为，公司用于证券投资的资金来源于公司的闲置资金，未影响公司主营业务的开展。公司严格按照相关法律法规、《公司章程》以及公司相关制度的要求开展证券投资业务，决策程序合法合规，内控制度严格落实，资金安全能够得到保障，未出现违反相关法律法规及规章制度的行为。公司利用闲置资金开展证券投资业务，有利于提高公司资金的使用效率和收益，符合公司利益，不存在损害公司

及中小股东利益的情形。

中联重科股份有限公司  
董 事 会  
二〇二〇年三月三十日