

# 宁德时代新能源科技股份有限公司

## 关于公司 2022 年度证券与衍生品交易情况的 专项说明

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

根据《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》《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》等有关规定的要求，宁德时代新能源科技股份有限公司（以下简称“公司”）董事会对 2022 年度证券投资与衍生品交易情况进行了核查，现将相关情况说明如下：

### 一、证券与衍生品投资审议批准情况

#### （一）证券投资

公司分别于 2020 年 8 月 10 日、2021 年 4 月 26 日召开的第二届董事会第十九次会、第二届董事会第二十八次会议审议通过了《关于开展境内外产业链相关投资的议案》，为契合公司业务长期发展需求，推进全球化战略布局，保障行业关键资源的供应，同意公司围绕主业，以证券投资方式对境内外产业链上下游优质企业进行投资，投资总额分别不超过 190.67 亿元、190 亿元（不含本数）人民币或等值币种，有效期限均为自董事会审议通过之日起 12 个月内有效。

此外，根据公司《证券投资管理制度》规定，证券投资总额未达到公司最近一期经审计净资产 10%以上且绝对金额未超过一千万元的，由公司总经理审批。2022 年度，公司发生的证券投资未在上述董事会已审议通过的额度范围的，均已经公司总经理审批通过。

#### （二）衍生品投资

##### 1、外汇套期保值

公司于 2022 年 4 月 20 日召开的第三届董事会第三次会议审议通过了《关于 2022 年度套期保值计划的议案》，为更好地规避和防范外汇汇率波动风险，增强财务稳健性，根据公司经营及业务需求情况，同意开展外汇套期保值业务，该业务所需保证金最高占用额不超过人民币 80 亿元或等值其他外币金额，有效期限自公司董事会审议通过之日起至 2022 年年度股东大会召开之日期间内有效。

## **2、商品套期保值**

公司 2022 年 4 月 20 日召开的第三届董事会第三次会议审议通过了《关于 2022 年度套期保值计划的议案》，为减少生产经营相关原材料价格大幅波动给公司经营带来的不利影响，根据公司经营及业务需求情况，同意开展商品套期保值业务，该业务所需保证金最高占用额不超过人民币 110 亿元，有效期限自公司董事会审议通过之日起至 2022 年年度股东大会召开之日期间内有效。

## **二、2022 年度公司证券及衍生品交易情况**

### **（一）证券交易情况**

2022 年度，公司证券投资情况如下：

单位：人民币万元

证券品种	证券代码	证券简称	最初投资成本	会计计量模式	期初账面价值	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期购买金额	本期出售金额	报告期损益	期末账面价值	会计核算科目	资金来源
境内外股票	PLS.ASX	PLS	30,614.54	公允价值计量	313,791.50		264,592.32				395,666.71	其他权益工具投资	自有
境内外股票	300450.SZ	先导智能	250,000.00	权益法	257,191.40					18,567.15	270,165.71	长期股权投资	自有
境内外股票	MDKA.IDX	MDKA	154,029.77	公允价值计量			66,994.39	154,029.77			221,024.17	其他权益工具投资	自有
境内外股票	601127.SH	赛力斯	152,493.50	公允价值计量	161,967.51		-43,726.41				108,767.10	其他权益工具投资	自有
境内外股票	02245.HK	力勤资源	72,927.35	公允价值计量			-247.22	72,927.35			72,680.12	其他权益工具投资	自有
境内外股票	300390.SZ	天华超净	32,000.00	公允价值计量	39,384.11		16,300.82	20,000.00		243.11	48,300.82	其他权益工具投资	自有
境内外股票	688707.SH	振华新材	7,748.90	公允价值计量	33,059.35		21,747.28			164.05	29,496.19	其他权益工具投资	自有
境内外股票	688141.SH	杰华特	3,000.00	公允价值计量	3,000.00		20,109.11				23,109.11	其他权益工具投资	自有
境内外股票	300712.SZ	永福股份	21,152.65	权益法	21,178.39					628.12	21,671.02	长期股权投资	自有
境内外股票	688147.SH	微导纳米	12,000.00	公允价值计量	12,000.00		4,325.15				16,325.15	其他权益工具投资	自有
期末持有的其他证券投资			20,799.83	--			-6,282.94	20,799.83			14,376.25	--	--
合计			756,766.55	--	841,572.26		343,812.51	267,756.95		19,602.43	1,221,582.35	--	--

## （二）衍生品交易情况

2022 年度，公司衍生品投资情况如下：

单位：人民币万元

衍生品投资类型	初始投资金额	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
商品	430,147.47	-	-2,227.39	20,611.33	705,480.25	19,997.33	0.12%
外汇	5,820,821.36	-	59,791.19	4,589,217.98	820,076.24	4,985,381.11	30.31%
合计	6,250,968.83	-	57,563.80	4,609,829.31	1,525,556.49	5,005,378.44	30.43%
报告期实际损益情况的说明	为规避和防范主要原材料、产品价格及外汇汇率波动给公司带来的经营风险，公司按照一定比例，针对公司生产经营相关的原材料、产品及外汇开展套期保值、远期结售汇及外汇掉期等业务，业务规模均在预计的采购、销售业务规模内，具备明确的业务基础。报告期内，公司商品及外汇套期保值衍生品合约和现货盈亏相抵后的实际损益金额合计为 0.79 亿元。						
套期保值效果的说明	公司从事套期保值业务的金融衍生品和商品期货品种与公司生产经营相关的原材料、产品和外汇相挂钩，可抵消现货市场交易中存在的价格风险的交易活动，实现了预期风险管理目标。						

截至 2022 年 12 月 31 日，公司开展套期保值业务累计使用保证金余额为 27.36 亿元，在公司董事会审议的额度范围内。

## 三、内控制度执行情况

公司已制定《证券投资管理制度》《套期保值业务内部控制及风险管理制度》《外汇套期保值业务内部控制及风险管理制度》等，规范公司证券投资、外汇套期保值及商品套期保值行为，明确相关内部决策程序、业务操作流程、风险控制措施等，能有效防范风险。2022 年度，公司严格按照上述制度相关规定进行证券投资和开展套期保值业务，未有违反相关法律法规及规范性文件规定之情形。

## 四、履行的审批程序及保荐机构意见

### （一）监事会审议情况

公司第三届监事会第十三次会议审议通过了《关于<公司 2022 年度证券与衍生品交易情况专项说明>的议案》，公司监事会认为：2022 年度，公司的证券投资及衍生品交易严格遵循《公司章程》及相关内控制度的规定，不存在违反法律法规及规范性文件规定的情形。

## （二）独立董事意见

公司独立董事发表了独立意见：2022 年度，公司严格按照相关法律法规、《公司章程》及相关内控制度的要求开展证券投资及衍生品交易，履行了相应的决策程序，未出现违反相关法律法规及规章制度的行为，不存在损害公司及股东利益的情形。

## （三）保荐机构核查意见

经核查，保荐机构认为：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之情形，符合公司章程规定，决策程序合法、合规。

## 五、备查文件

- 1、公司第三届董事会第十七次会议决议
- 2、公司第三届监事会第十三次会议决议
- 3、独立董事关于公司第三届董事会第十七次会议相关事项的独立意见
- 4、中信建投证券股份有限公司关于宁德时代新能源科技股份有限公司 2022 年度证券与衍生品交易情况的核查意见

特此公告。

宁德时代新能源科技股份有限公司董事会

2023 年 3 月 9 日