

江苏国信股份有限公司董事会

关于 2021 年度证券投资情况的专项说明

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》和《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，江苏国信股份有限公司（以下简称“公司”）董事会对 2020 年度证券投资情况进行了认真核查，现将有关情况说明如下：

一、证券投资审议批准情况

公司于 2020 年 12 月 14 日召开的第五届董事会第八次会议和 2020 年 12 月 30 日召开的 2020 年第一次临时股东大会审议通过了《关于江苏信托 2021 年 1 月至 5 月证券投资计划的议案》和《关于江苏信托 2021 年 1 月至 5 月投资信托计划的议案》；公司于 2021 年 4 月 13 日召开的第五届董事会第九次会议和 2021 年 5 月 7 日召开的 2020 年度股东大会审议通过了《关于江苏信托未来 12 个月（2021 年 6 月-2022 年 5 月）证券投资计划的议案》和《关于江苏信托未来 12 个月（2021 年 6 月-2022 年 5 月）投资信托计划的议案》，同意公司子公司江苏省国际信托有限责任公司（以下简称“江苏信托”）运用自有资金投资证券市场，额度不超过 8 亿元；投资信托计划，额度不超

过 150 亿元。

二、2021 年度公司证券投资情况

2021 年度，公司证券投资的具体明细如下：

单位：人民币元

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
信托产品	*****	信托计划 1	2,050,000,000.00	公允价值计量	1,583,880,000.00			16,031,200,000.00	15,565,080,000.00	22,801,037.85	2,050,000,000.00	交易性金融资产	自有资金
信托产品	*****	信托计划 2	1,040,004,963.00	公允价值计量				1,292,298,000.00	252,293,037.00		1,040,004,963.00	交易性金融资产	自有资金
信托产品	*****	信托计划 3	1,000,000,000.00	公允价值计量		2,241,715.40		1,000,300,000.00	300,000.00	2,242,085.26	1,002,241,715.40	交易性金融资产	自有资金
信托产品	*****	信托计划 4	922,984,917.04	公允价值计量		20,830,830.32		1,823,584,917.04	900,600,000.00	20,831,348.13	943,815,747.36	交易性金融资产	自有资金

信托产品	****	信托计划 5	728,333,520.00	公允价值计量		18,097,138.71		1,050,300,000.00	321,966,480.00	19,416,093.56	746,430,658.71	交易性金融资产	自有资金
信托产品	****	信托计划 6	600,000,000.00	公允价值计量	609,018,196.72	-18,196.72		4,550,300,000.00	4,559,300,000.00	8,580,776.81	600,000,000.00	交易性金融资产	自有资金
信托产品	****	信托计划 7	417,140,000.00	公允价值计量				487,140,000.00	70,000,000.00		417,140,000.00	交易性金融资产	自有资金
信托产品	****	信托计划 8	263,527,944.64	公允价值计量				475,310,000.00	211,782,055.36		263,527,944.64	交易性金融资产	自有资金
信托产品	****	信托计划 9	209,182,357.83	公允价值计量				638,900,000.00	429,717,642.17		209,182,357.83	交易性金融资产	自有资金
境内外股票	****	股票 1	157,162,000.00	公允价值计量	149,550,300.00	-17,964,000.00				-13,972,000.00	131,586,300.00	交易性金融资产	自有资金
期末持有的其他证券投资			1,717,905,194.84	--	8,203,998,473.99	164,748,599.30	0.00	7,635,210,000.00	14,040,174,986.99	188,997,080.68	1,811,305,780.70	--	--
合计			9,106,240,897.35	--	10,546,446,970.71	187,936,087.01	0.00	34,984,542,917.04	36,351,214,201.52	248,896,422.29	9,215,235,467.64	--	--

三、投资风险及风险控制措施

（一）投资风险

股票投资风险主要包括系统性风险、非系统性风险和操作风险三大类。系统性风险包括政策风险、经济周期波动风险、利率风险、购买力风险；非系统性风险包括信用风险、经营风险、道德风险；操作风险即投资者由于自身管理失责而遭致证券被违规交易、资金被挪用等风险。

信托财产在投资管理运用过程中存在法律与政策风险、信用和流动性风险、市场风险、操作风险、合规性风险、经营风险、担保措施风险、提前终止风险、管理风险、保管人风险和其他风险，从而可能对信托资金和收益产生影响。

（二）风险控制措施

对于前述风险，公司主要从如下几个方面加以应对：

- 1、公司已经制定了《风险投资管理制度》，具体内容公司已刊登在巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）上。
- 2、密切关注国家政策动向、预判经济金融走势以降低系统性风险；
- 3、建立、调整证券投资组合有效分散非系统性风险；
- 4、严格执行操作规程，并加强对业务操作人员的培训及管理，防范操作风险；

5、公司将做好投资信托计划产品前期调研和可行性论证，严格遵守审慎投资原则，选择稳健的投资品种，并根据经济形势以及金融市场的变化适时适量的介入，防范公司投资风险，保证投资资金的安全和有效增值。

四、独立董事意见

经核查，报告期内江苏信托运用自有资金参与证券投资，未影响江苏信托和公司业务正常运行。公司严格按照相关法律法规、《公司章程》以及《风险投资管理制度》等相关规章制度的要求进行证券投资，决策程序合法合规，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。

江苏国信股份有限公司

2022年4月29日