

## 深圳市兆驰股份有限公司

### 关于开展 2020 年度金融衍生品交易业务的公告

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

深圳市兆驰股份有限公司（以下简称“公司”）于 2020 年 8 月 24 日召开第五届董事会第十六次会议，审议通过了《关于开展 2020 年度金融衍生品交易业务的议案》，为有效地规避和防范外汇市场风险，公司及纳入合并报表范围内的下属公司拟于 2020 年第四次临时股东大会审议通过之日起 12 个月内，以境内外商业银行等金融机构作为交易对手方，以本金累计折合不超过 10 亿美元开展金融衍生品交易业务（包括但不限于人民币或其他货币的远期结售汇业务、外汇掉期业务、货币互换业务、利率互换业务以及外汇期权业务等或上述产品的组合。该额度包含公司第五届董事会第五次会议、2019 年第四次临时股东大会审批的远期外汇套期保值业务额度）。同时，授权公司董事长在上述金额范围内处理与上述金融衍生品交易业务相关的事项。现将相关情况公告如下：

#### 一、开展金融衍生品交易业务的目的

公司境外销售收入占主营业务收入总额的 40% 左右，材料采购也部分来自于境外，收汇或付汇主要以美元等外币进行结算。当收付货币汇率出现较大波动时，或实际汇率与记账货币汇率出现较大差异时，汇兑损益会对经营业绩产生较大影响。为了降低汇率波动对利润的影响，有效规避和防范外汇市场风险，公司拟与境内外商业银行等金融机构开展金融衍生品交易业务。

公司从事金融衍生品交易业务的主要目的是充分利用外汇工具降低汇率波动对公司的影响，使公司及海外控股子公司专注于生产经营，在汇率发生较大波动时，仍能维持稳定的利润水平。公司不做投机性、套利性的交易操作。

## 二、金融衍生品交易业务概述

### （一）主要涉及币种及业务品种

公司拟开展的金融衍生品包括但不限于以下范围：人民币或其他货币的远期结售汇业务、外汇掉期业务、货币互换业务、利率互换业务以及外汇期权业务等或上述产品的组合。金融衍生品的基础资产包括汇率、利率、货币、有价证券等；既可采取到期交割，也可采取差额结算。

### （二）拟投入资金及业务期间

公司及纳入合并报表范围内的下属公司拟于 2020 年第四次临时股东大会通过之日起 12 个月内，以境内外商业银行等金融机构作为交易对手方开展金融衍生品交易业务，本金累计发生额不超过 10 亿美元，并授权公司董事长在上述金额范围内处理与上述金融衍生品交易业务相关的事项。

开展金融衍生品交易业务，公司除有可能根据与金融机构签订的协议缴纳一定比例的保证金外，不需要投入其他资金，该保证金将使用公司的自有资金，不涉及募集资金。缴纳的保证金比例根据与不同商业银行签订的具体协议确定。

## 三、公司对于金融衍生品交易业务的可行性分析

公司金融衍生品交易是围绕公司实际经营业务进行的，以正常业务背景为依托，以规避汇率风险为主要目的，禁止投机和套利交易，是出于公司稳定经营的迫切需求。公司已制定了《金融衍生品交易业务内部控制制度》，对业务操作原则、审批权限、内部管理及操作流程、信息隔离措施、内部风险控制制度等做出了明确规定，建立了完善的内部控制制度。公司严格按照规定安排和使用专业人员，建立严格的授权和岗位牵制制度，同时建立异常情况及时报告制度，并形成高效的风险处理程序。该制度符合监管部门的有关要求，满足实际操作的需要，所制定的风险控制措施是切实有效的。

## 四、金融衍生品交易业务的风险分析

### （一）价格波动风险

可能产生因标的利率、汇率等市场价格波动而造成金融衍生品价格变动而造成浮动亏损的市场风险。

## （二）内部控制风险

金融衍生品交易业务专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内部操作或内部人员未能充分理解交易合同条款和产品信息而造成风险。

## （三）履约风险

开展金融衍生品业务存在有关法律法规发生变化、交易对手无法履约、金融市场流动性不足等因素而无法完成交易的风险。

## 五、公司采取的风险控制措施

（一）选择流动性强、风险可控的金融衍生品开展套期保值等业务。

（二）金融衍生品交易以获取无风险收益，提高股东回报为原则，最大程度规避汇率波动带来的风险，并结合市场情况，适时调整操作及风控策略。

（三）公司仅选择具有合法资质的大型商业银行等金融机构作为交易对手，开展金融衍生品交易业务，规避可能产生的法律风险。

（四）公司已制定《金融衍生品交易业务内部控制制度》，对金融衍生品交易业务有明确规定，并设专人对持有的金融衍生品合约持续监控，在市场剧烈波动或风险增大情况下，或导致发生重大浮盈浮亏时及时报告公司决策层，并积极应对。

## 六、开展金融衍生品交易业务的会计核算原则

公司根据财政部《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》等相关规定及其指南，对金融衍生品交易业务进行相应核算和披露。

## 七、独立董事意见

随着公司国际化业务的推进，公司海外资产及业务布局广泛，对其管理能力也相应提升。公司及纳入合并报表范围内的下属公司拟开展金融衍生品交易业务是围绕主营业务进行的，不以盈利为目的，而是以具体经营业务为依托，规避和防范汇率波动风险，具有一定的必要性。公司在保证正常生产经营的前提下开展金融衍生品交易业务，有利于防范汇率大幅波动对公司经营业绩造成的不利影响。本次拟以本金累计折合不超过 10 亿美元开展金融衍生品交易业务符合公司的实际情况，不存在损害公司及全体股东，特别是中小股东利益的情形，因此我们一致同意公司开展 2020 年度金融衍生品交易业务，并提交公司股东大会审议。

## 八、备查文件

- 1、公司第五届董事会第十六次会议决议；
- 2、独立董事关于第五届董事会第十六次会议相关事项的独立意见。

特此公告。

深圳市兆驰股份有限公司

董 事 会

二〇二〇年八月二十五日