

浙江众合科技股份有限公司

关于开展衍生品投资业务的公告

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

浙江众合科技股份有限公司（以下简称“本公司”或“公司”）因境外采购需要，为减少因外币汇率波动带来的对公司资产、负债和盈利水平的不利影响，第六届董事会第十次会议审议通过了《关于衍生品投资业务的议案》，同意使用累计金额不超过 34,000 万人民币（或等值外币），利用金融机构提供的外汇产品开展以保值为目的的外汇远期、结构性远期、外汇掉期和外汇期权业务，将汇率变动风险控制在可接受水平。根据《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所主板上市公司规范运作指引》、《公司章程》等相关规定，本次衍生品交易的具体情况如下：

一、衍生品投资概述

1、合约期限：不超过一年

2、合约金额：累计金额不超过 34,000 万人民币（或等值外币）

2、交易对手：银行类金融机构

3、流动性安排：衍生品投资以正常的外汇收支业务为背景，投资金额和投资期限与预期收支期限相匹配。4、其他条款：衍生品投资主要使用公司的银行综合授信额度，到期采用本金交割或差额交割的方式。

上述衍生品投资事项已经公司第六届董事会第十次会议审议通过，无需提交公司股东大会审议，公司独立董事贾利民先生、韩斌先生、宋航先生、钱明星先生审议了此项议案，并就此项议案发表了独立意见，四位独立董事一致认为：公司开展的衍生品业务与日常经营需求紧密相关，风险可控，符合有关法律、法规的有关规定。

二、衍生品投资品种

场内场外交易、或者非交易的，实质为期货、期权、远期、互换、掉期等产品或上述产品的结合。

三、开展衍生品投资的必要性

公司开展的衍生品投资业务与日常经营需求紧密相关，随着公司外汇支出的不断增长，收入与支出币种的不匹配致使以美元和欧元为主的外汇风险敞口不断扩大，为防范汇率波动对公司利润和股东权益造成不利影响，公司需进行保值型衍生品投资，以减少外汇风险敞口。

四、衍生品投资的管理情况

1. 公司已制定《衍生品投资风险控制及信息披露制度》，对公司进行衍生品

投资的风险控制、审议程序、后续管理等进行明确规定，以有效规范衍生品投资行为，控制衍生品投资风险。

2. 公司成立了衍生品投资工作小组，具体负责公司衍生品投资事务。投资工作小组配备投资决策、业务操作、风险控制等专业人员。

3. 公司投资工作小组成员应充分理解衍生品投资的特点和潜在风险，严格执行衍生品投资的业务操作和风险管理制度。

五、衍生品投资的风险分析

1. 市场风险：保值型衍生品投资合约汇率与到期日实际汇率的差异将产生投资损益；在保值型衍生品的存续期内，每一会计期间将产生重估损益，至到期日重估损益的累计值等于投资损益。

2. 流动性风险：保值型衍生品以公司外汇收支预算为依据，与实际外汇收支相匹配，以保证在交割时拥有足额资金供清算，或选择净额交割衍生品，以减少到期日现金流需求。

3. 履约风险：公司衍生品投资交易对手均为信用良好且与公司已建立长期业务往来的银行，基本不存在履约风险。

4. 其它风险：在开展业务时，如操作人员未按规定程序进行衍生品投资操作或未充分理解衍生品信息，将带来操作风险；如交易合同条款的不明确，将可能面临法律风险。

六、衍生品投资风险管理策略

1、公司开展的衍生品投资以减少汇率波动对公司影响为目的，禁止任何风险投机行为；公司衍生品投资额不得超过经董事会或股东大会批准的授权额度上限；

2、公司开展衍生品投资前，投资工作小组应评估衍生品的投资风险，分析衍生品投资的可行性与必要性，负责根据实际操作工作中情况及时上报突发事件及风险评估变化情况；

3、公司衍生品投资合约由投资工作小组提交公司管理层和董事会审批后予以执行；

4、公司与交易银行签订条款准确清晰的合约，公司风险控制部（原法务部）应严格执行风险管理制度，以防范法律风险。

5、公司衍生品投资小组应跟踪衍生品公开市场价格或公允价值变动，及时评估已投资衍生品的风险敞口变化情况，并定期向董事会审计委员会报告。

6、公司内审部定期对衍生品投资进行合规性审计。

七、衍生品投资公允价值分析

公司开展的衍生品交易主要针对具有较强流通性的货币，市场透明度大，成交价格和当日结算单价能充分反映衍生品的公允价值，公司按照银行、路透系统等定价服务机构提供或获得的价格厘定。

八、衍生品投资会计核算政策及后续披露

1、公司开展的衍生品投资会计核算方法依据《企业会计准则》确定。

2、当公司已投资衍生品的公允价值减值与用于风险对冲的资产（如有）价值变动加总，导致合计亏损或浮动亏损金额达到公司最近一期经审计净资产的10%

且绝对金额超过1000万人民币时，审计委员会应向董事会汇报，董事会应以临时公告及时披露。

九、独立董事专项意见

公司独立董事贾利民先生、韩斌先生、宋航先生、钱明星先生审议了《公司关于衍生品投资业务》的事项，就该事项发表以下独立意见：

公司已制定《浙江众合科技股份有限公司衍生品投资风险控制及信息披露制度》，建立健全了业务流程、审批权限、风险控制和后续管理。

鉴于公司及其控股子公司国际业务的持续发展，外汇支出不断增长，为降低外汇业务的汇率风险，通过有效的金融衍生工具锁定汇兑成本，有利于增强公司财务稳定性，提高公司竞争力。公司已为衍生品业务进行了严格的内部评估，建立了相应的监管机制。我们认为公司开展的衍生品业务与日常经营需求紧密相关，风险可控，符合有关法律、法规的有关规定。

十、备查文件

- 1、公司第六届董事会第十次会议决议；
- 2、公司独立董事独立意见。

特此公告。

浙江众合科技股份有限公司董事会
二〇一六年十月二十六日