

浙江核新同花顺网络信息股份有限公司

关于使用闲置自有资金进行衍生品投资的公告

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。

浙江核新同花顺网络信息股份有限公司（以下简称“公司”）于 2016 年 12 月 30 日召开的第四届董事会第二次会议审议通过了《关于使用闲置自有资金进行衍生品投资的议案》。

一、衍生品投资的基本内容

公司衍生品投资的对象主要为中国金融期货交易所上市的股指期货，根据第四届董事会第二次会议通过的决议，公司及控股子公司参与衍生品投资时，动用的保证金总额不超过人民币 5000 万元，投资期限为自本项投资事项经股东大会审议通过之日起三年。

二、开展衍生品投资的必要性

根据公司第四届董事会第二次会议通过的决议，公司将使用闲置自有资金进行证券市场投资。由于股指期货具有做多和做空的功能，在采取科学严格的风险控制手段的前提下，能够有效锁定公司证券投资的投资成本，对冲投资的或有风险，努力获取稳健的收益。

三、公司衍生品投资的管理情况

1. 公司已制定《证券投资管理制度》，对公司包括股指期货等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. 为保证公司股指期货投资工作的顺利开展，由董事会秘书组织证券部负责

具体实施；证券部配备投资决策、业务操作方面的专业人员，具体负责金融衍生品投资事务，拟定投资计划，并按照董事会的授权及《证券投资管理制度》的规定予以执行。

3. 公司证券部成员已充分理解股指期货投资的特点和潜在风险，严格执行相关的业务操作和相关管理制度。

四、公司衍生品投资的风险分析

1. 市场风险：公司开展的股指期货投资业务，主要为与公司证券投资相关的套期保值类业务，存在市场价格波动导致金融衍生品价格变动而造成亏损的市场风险。

2. 流动性风险：目前公司自有资金较为充沛，而参与股指期货所动用的资金量较小，不会影响公司各项正常业务的开展，基本不存在流动性方面的风险。

3. 履约风险：公司股指期货投资交易是在中国金融期货交易所进行，基本无履约风险。

4. 其他可能的风险：在具体开展业务时，如发生操作人员未准确、及时、完整地记录股指期货投资业务信息，将可能导致衍生品业务损失或丧失交易机会；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。

五、风险管理措施

针对前述可能的风险，公司证券部将按照董事会的授权及《证券投资管理办法》的规定，控制投资规模，严格履行相应的审批监管程序，及时关注证券市场变化，注重对股指期货相关知识的学习和对股指期货交易信息的收集，并根据市场变化 情况及时调整，制定合理的交易策略，最大限度的避免风险的发生。

六、公司衍生品投资的公允价值分析

公司进行的股指期货投资，其公允价值按照中国金融期货交易所提供的价格厘定。

七、公司衍生品投资的会计政策及核算原则

公司根据《企业会计准则》和公司会计政策的相关规定，对股指期货投资业务进行适当处理，并按规定进行信息披露。

八、独立董事意见

公司衍生品投资事项审议程序符合《公司章程》、《深圳证券交易所创业板股票上市规则》、《信息披露业务备忘录第26号——衍生品投资》等法律法规、规范性文件的规定；该投资事项的实施能够有效发挥公司自有资金较为充沛的优势，有助于控制公司参与证券市场投资所可能产生的风险。

基于上述，公司独立董事一致同意公司使用不超过5000万元人民币的闲置自有资金进行衍生品投资，同意将该议案提交公司股东大会审议。

九、备查文件

1. 第四届董事会第二次会议决议；
2. 独立董事对第四届董事会第二次会议相关事项的独立意见；
3. 深交所要求的其他文件。

特此公告！

浙江核新同花顺网络信息股份有限公司

董事会

二〇一六年十二月三十一日