

中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司

第八届董事会独立董事对公司 2017 年第一季度相关事项的独立意见

一、关于 2017 年第一季度衍生品投资及风险控制情况的说明和独立意见

根据《中华人民共和国公司法》（以下简称“《公司法》”）、《关于在上市公司建立独立董事的指导意见》、《上市公司治理准则》、《深圳证券交易所股票上市规则》、《中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司章程》（以下简称“《公司章程》”）、《深圳证券交易所主板上市公司规范运作指引》（2015 年修订）等有关规定，作为中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司（以下简称“公司”）的独立董事，经对公司 2017 年第一季度衍生品投资及风险控制情况进行核查，我们发表独立意见如下：

（一）2017 年第一季度衍生品投资及风险控制情况如下：

1、2017 年第一季度公司衍生品投资风控险控制情况

衍生品投资资金来源	自有资金
报告期衍生品持仓的风险分析及控制措施说明（包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、操作风险、法律风险等）	截至 2017 年 3 月 31 日，本集团持有的衍生金融工具主要有外汇远期和利率掉期合约。利率掉期合约的风险和利率波动密切相关。外汇远期所面临的风险与汇率市场风险以及本集团的未来外币收入现金流的确定性有关。本集团对衍生金融工具的控制措施主要体现在：谨慎选择和决定新增衍生金融工具的种类和数量；针对衍生品交易，本集团制订了严格规范的内部审批制度及业务操作流程，明确了相关各层级的审批和授权程序以便于控制相关风险。
已投资衍生品报告期内市场价格或产品公允价值变动的情况，对衍生品公允价值的分析应披露具体使用的方法及相关假设与参数的设定	2017 年 1-3 月本集团衍生金融工具公允价值变动损益为人民币 8,609 千元。集团衍生金融工具公允价值根据外部金融机构的市场报价确定。
报告期公司衍生品的会计政策及会计核算具体原则与上一报告期相比是否发生重大变化的说明	否

2、2017年第一季度末公司衍生品投资的持仓情况表

单位：人民币千元

衍生品 投资操 作方名 称	关联 关系	是否 关联 交易	衍生品 投资类 型	衍生品 投资初 始投资 金额	起始日期	终止日期	期初投资金 额	报告 期内 购入 金额	报告 期内 售出 金额	计提减 值准备 金额(如 有)	期末投资金 额	期末投资金 额占公司报 告期末净资 产比例	报告期 实际损 益金额
汇丰、渣打等银行	无	否	外汇远期合约	-	2015/1/29	2018/1/29	219,820	-	-	-	242,686	0.81%	2,844
建行、渣打等银行	无	否	利率掉期合约	-	2010/1/20	2021/6/28	10,302,060	-	-	-	10,239,135	34.25%	5,765
合计				-	-	-	10,521,880	-	-	-	10,481,821	35.06%	8,609

(二) 独立意见

公司开展汇利率衍生品投资是与公司日常全球经营业务有关，是为平滑汇利率变化对公司经营造成的波动，降低汇利率对公司经营的影响至可控或可承受范围，稳定和改善经营，确保公司长期经营目标或战略目标的实现。公司已制订了严格规范的内部审批制度及业务操作流程，相关决策程序完备，风险可控，符合有关法律、法规的规定，不存在损害公司及公司股东特别是中小股东利益的情形。

二、关于 2017 年第一季度证券投资情况的独立意见

根据《公司法》、《关于在上市公司建立独立董事的指导意见》、《上市公司治理准则》、《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（2015 年修订）》、《公司章程》等有关规定，作为公司的独立董事，我们对公司 2017 年第一季度证券投资情况进行核查并发表独立意见如下：

公司证券投资的资金来源及审批程序符合有关法律法规的规定，公司内控制度健全，能有效防范和控制风险，不存在损害公司及公司股东特别是中小股东利益的情形。

二〇一七年四月二十七日

独立董事：

潘承伟
潘正启
王桂壖