

股票代码：601328 股票简称：交通银行 编号：临 2017-018



交通银行股份有限公司 日常关联交易公告

交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”或“本公司”）董事会及全体董事保证本公告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

重要内容提示：

- 本次日常关联交易无需提交股东大会审议。
- 本次审议的《银行间交易主协议》涉及的是本公司或本公司子公司与香港上海汇丰银行有限公司（“汇丰银行”）或汇丰银行子公司或联系人¹之间发生的日常关联交易，该类交易不会对本公司的财务状况产生不利影响，也不会导致本公司对关联方形成较大依赖。

一、日常关联交易基本情况

（一）日常关联交易履行的审议程序

本公司于2017年4月28日召开的第八届董事会第八次会议审议批准了《关于与汇丰银行续签〈银行间交易主协议〉的议案》，关联董事王冬胜先生和黄碧娟女士回避表决，其余15名非关联董事一致同意前述议案。本公司独立董事彼得·诺

¹ 属于香港联合交易所有限公司《证券上市规则》定义。

兰先生、陈志武先生、于永顺先生、李健女士、刘力先生和杨志威先生事前发表以下独立意见：认可本公司与汇丰银行之间的日常关联交易；本次拟与汇丰银行续签的《银行间交易主协议》明确规定了双方应按照银行间市场惯例和一般商务条款进行日常交易，交易条款及年度交易上限是公平合理的，符合本公司及全体股东的权益。

本公司董事会风险管理与关联交易控制委员会于2017年4月27日审议了该议案，同意提交董事会审议批准。

（二）前一期日常关联交易情况

本公司自2005年开始与汇丰银行每三年签订一期《银行间交易主协议》，以规管双方在日常银行业务中进行的各项交易。最近一期《银行间交易主协议》于2014年6月生效，于2014至2016年度以及2017年一季度，本公司或本公司子公司与汇丰银行或汇丰银行子公司或联系人之间进行的交易具体情况如下：

（单位：人民币亿元）

	年度交易限额	2014年度	2015年度	2016年度	2017年一季度
已实现收益	78.96	9.86	20.57	10.28	1.59
已实现损失	78.96	9.04	22.60	10.63	1.70
未实现收益	78.96	1.70	2.52	2.75	1.14
未实现损失	78.96	1.84	1.29	6.20	0.18
衍生金融工具公允价值净额	140	5.16	3.25	12.67	8.00

以上各年度实际交易金额均未超过限额。实际交易情况与年度交易限额存在差异，主要原因是：有关交易的收入或亏损受到全球金融市场的利率及汇率走势影响较大，可能因应市场价格而发生重大变化，非本公司所能控制。

（三）本次日常关联交易限额

本次续签的《银行间交易主协议》约定的每年度交易限额如下：

（单位：人民币亿元）

	2017年6月1日至12月31日	2018年全年	2019年全年	2020年1月1日至5月31日
已实现收益	56.60	97.03	97.03	40.43
已实现亏损	56.60	97.03	97.03	40.43
未实现收益	56.60	97.03	97.03	40.43
未实现亏损	56.60	97.03	97.03	40.43
衍生金融工具公允价值净额	114.92	197	197	82.08

本公司确定本次《银行间交易主协议》项下年度上限时考虑了多种因素，包括：(1)过去三年历史交易数据；(2)有关业务活动会由于本公司无法控制的外部因素（包括无法预见到的金融市场波动）而每年有所变化；(3)债券交易受国内及全球证券市场的交易量及价格波动的影响；(4)外汇交易受所买卖的货币相对强弱走势的影响，且部分外汇交易事实上是由客户需求所驱动且为进行外汇风险管理而订立的；(5)对货币市场交易的需求主要取决于本公司自身的资金流及流动性要求。

二、关联方介绍和关联关系

（一）汇丰银行基本情况

汇丰银行于1865年在香港及上海成立，是汇丰集团（世界最大的银行及金融服务机构之一）的始创成员，也是香港最大的本地注册银行及三大发钞银行之一。汇丰银行是汇丰控股有限公司的全资附属公司，后者是汇丰集团的控股公司。汇丰集团的国际网络横跨欧洲、亚洲、中东及北非、北美洲及拉丁美洲五个地域。

汇丰银行2016年度主要财务数据：资产总值75,489.52亿港元，净资产6,791.36亿港元，未扣除贷款减值准备之营业收益净额1,681.52亿港元，股东应占利润786.46亿港元。

（二）汇丰银行实益持有本公司19.03%的股份，符合上海证券交易所《股票上市规则》第10.1.3规定的关联关系情形。

三、《银行间交易主协议》主要内容

本公司已于 2017 年 4 月 28 日经董事会批准与汇丰银行续签了《银行间交易主协议》，主要内容如下：

（一）期限

为期三年，自 2017 年 6 月 1 日起，于 2020 年 5 月 31 日到期。如协议双方于协议到期前两个月内达成协议，则可再续期三年。

（二）所涵盖的日常关联交易

《银行间交易主协议》所涵盖的日常关联交易主要包括拆借、债券交易、货币市场交易、外汇交易、掉期及期权交易等。

（三）定价原则

每笔交易均应按适用的银行间市场惯例和一般商务条款进行。在适用的法律法规、监管机关发布的条例或通知有规定时，采用其规定的固定价格或费率。如不存在固定价格或费率，对于公开市场交易，将按现行市场价格进行，且均按公平原则及一般商业条款订立；对于其他交易（如场外交易），需按公平原则及一般商业条款，且需参考交易双方（或具备同等信誉的第三方）在相同类型交易中通常采用的费用/价格（如适用），及交通银行与汇丰银行双方的风险管理规定。

四、关联交易目的和对上市公司的影响

《银行间交易主协议》项下的各交易为本公司或本公司子公司与汇丰银行或汇丰银行子公司或联系人之间发生的日常关联交易。相关交易在本公司上市及汇丰银行成为本公司关联方之前一直在进行，并在本公司上市后继续进行。汇丰银行为香港最大的银行之一，以及香港及其它地区的货币市场工具、债券工具、外汇工具和利率工具的主要市场做市商，因此包括本公司在内的多数大型银行均在各自的日常业务过程中与其进行交易。

本公司与汇丰银行已在《银行间交易主协议》中约定，确保双方进行的交易均应按适用的银行间市场惯例和一般商务条款进行，该类交易不会对本公司的财务状况产生不利影响，不损害本公司或中小股东的利益，也不会导致本公司对关联方形成较大依赖。

特此公告

交通银行股份有限公司董事会

2017年4月28日