

苏州苏大维格科技集团股份有限公司

关于 2020 年度开展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。

苏州苏大维格科技集团股份有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）于 2020 年 1 月 21 日召开第四届董事会第二十八次会议、第四届监事会第二十八次会议，审议并通过了《关于 2020 年度开展金融衍生品交易业务的议案》，同意公司 2020 年度开展金融衍生品交易业务。现将有关事项公告如下：

一、金融衍生品交易业务概述

随着公司银行外币借款、国际贸易业务规模的不断增加，为满足公司开展外币业务控制汇率风险需要，实现公司目标利润和可持续发展，在风险可控范围内，公司拟开展以套期保值为目的的特定金融衍生品交易业务，用于金融衍生品交易业务的资金最高额度不得超过人民币 2 亿元或等值外币，授权期限为自董事会审议通过之日起一年内有效；在授权额度范围内，资金可以滚动使用。本次开展金融衍生品交易业务不属于关联交易。

二、交易对手方介绍

公司拟开展的金融衍生品交易业务的交易对手方为经营稳健、资信良好，具有金融衍生品交易业务经营资格的银行等金融机构，与公司不存在关联关系。

三、金融衍生品交易业务的基本情况

（一）拟开展的金融衍生品交易业务品种

为了降低汇率波动对公司经营业绩的影响，公司拟开展金融衍生品交易业务，金融衍生品包括但不限于远期结售汇、期权、远期外汇买卖、掉期（包括货币掉期和利率掉期）、货币互换业务等。

（二）拟开展的金融衍生品交易业务额度

公司拟开展以套期保值为目的特定金融衍生品交易业务，用于金融衍生品交易业务的资金最高额度不得超过人民币 2 亿元或等值外币；在授权额度范围内，资金可以滚动使用。

四、开展金融衍生品交易业务的目的、存在的风险和对公司的影响

（一）开展金融衍生品交易的目的和对公司的影响

公司不进行单纯以盈利为目的的金融衍生品交易，所有金融衍生品交易行为均以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，应以套期保值、规避和防范汇率风险和利率风险为目的。

（二）开展金融衍生品交易的风险

1. 价格波动风险：可能产生因标的利率、汇率、市场价格等波动而造成金融衍生品价格变动而导致亏损的市场风险。

2. 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，可能会由于内部控制机制不完善而造成风险。

3. 流动性风险：因市场流动性不足而无法完成交易的风险。

4. 履约风险：开展金融衍生品业务存在合约到期无法履约造成违约而带来的风险。

5. 法律风险：因相关法律发生变化或交易对手违反相关法律制度可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失。

（三）风险应对措施

1. 明确金融衍生品交易原则：金融衍生品交易以保值为原则，并结合市场情况，适时调整操作策略，提高保值效果。

2. 制度建设：公司已制定《金融衍生品交易业务管理制度》，对金融衍生品交易业务的操作规范、审批权限、管理流程、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序等做出了明确规定，能够有效规范金融衍生品交易行为，控制金融衍生品交易风险。

3. 产品选择：在进行金融衍生品交易前，在多个交易对手与多种产品之间进行比较分析，选择最适合公司业务背景、流动性强、风险可控的金融衍生工具开展业务。

4. 交易对手管理：充分了解办理金融衍生品的金融机构的经营资质、实施团

队、涉及的交易人员、授权体系，慎重选择信用良好且与公司已建立长期业务往来的银行等金融机构。必要时可聘请专业机构对衍生品的交易模式、交易对手进行分析比较。

5. 专人负责：设专人对持有的金融衍生品合约持续监控，在市场波动剧烈或风险增大情况下，或导致发生重大浮盈浮亏时及时报告公司决策层，并及时制订应对方案。

五、金融衍生品业务的会计政策核算准则

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 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》相关规定及其指南，对拟开展的金融衍生品交易业务进行相应的核算处理，反映资产负债表及损益表相关项目。

六、监事会与独立董事意见

1、监事会审核意见

经审议，监事会认为：公司及子公司开展金融衍生品交易业务是为更好的规避和防范汇率风险，符合公司生产经营的实际需要，有利于降低或规避汇率波动出现的汇率风险、减少汇兑损失、控制经营风险，具有一定的必要性。其相关决策程序符合国家相关法律、法规、《公司章程》及公司《金融衍生品交易业务管理制度》的有关规定。因此，监事会同意公司按照相关制度的规定开展金融衍生品交易业务。

2、独立董事意见

公司及子公司开展的金融衍生品交易业务与日常经营需求紧密相关，有利于规避汇率波动的风险，增强公司财务稳健性，符合公司的经营发展需要。其相关决策程序符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定。公司以正常经营为基础，以具体经营业务为依托，在《金融衍生品交易业务管理制度》框架下，运用外汇套期保值工具降低汇率风险，减少汇兑损失，控制经营风险，不存在损害公司和全体股东、尤其是中小股东利益的情形。因此，一致同意公司按照相关制度的规定开展金融衍生品交易业务。

七、备查文件

- 1、公司第四届董事会第二十八次会议决议；
- 2、公司独立董事对相关事项的独立意见；
- 3、公司第四届监事会第二十八次会议决议。

特此公告

苏州苏大维格科技集团股份有限公司

董 事 会

2020 年 1 月 21 日