



证券代码：002213

证券简称：大为股份

公告编号：2021-054

深圳市大为创新科技股份有限公司 关于提高开展外汇衍生品交易业务额度的公告

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。

重要内容提示：

1、深圳市大为创新科技股份有限公司（以下简称“公司”）于 2021 年 3 月 25 日召开的第五届董事会第十一次会议、第五届监事会第八次会议审议通过了《关于开展外汇衍生品交易业务的议案》，同意公司及控股子公司在不超过 2,750 万美元（或其他等值外币）的额度内开展外汇衍生品交易，以上额度在期限内可循环滚动使用，但在以上额度期限内任一时点的累计余额不超过 2,750 万美元（或其他等值外币）；投资期限为与基础交易期限相匹配，一般不超过十二个月，公司外汇衍生品交易业务使用流动资金。

公司于 2021 年 4 月完成对四川欧乐智能技术有限公司（以下简称“四川欧乐”）增资的工商登记事项，四川欧乐成为公司控股子公司，考虑到四川欧乐日后进出口业务的开展，公司拟将公司及控股子公司开展外汇衍生品交易业务的额度由不超过 2,750 万美元（或其他等值外币）提高至不超过 4,500 万美元（或其他等值外币）。

2、投资种类：公司及控股子公司拟开展外汇衍生品交易，主要包括远期、期货、掉期（互换）和期权等产品或上述产品的组合，对应基础资产包括证券、指数、利率、汇率、货币、商品等标的或是上述标的的组合。

3、投资金额：公司及控股子公司拟开展的外汇衍生品交易额度为不超过 4,500 万美元（或其他等值外币）。

4、公司及控股子公司拟开展的外汇衍生品交易业务均以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，以规避和防范汇率风险为目的，不得进行投机和非

法套利交易。

5、特别风险提示：本投资无本金或收益保证，在投资过程中存在市场风险、流动风险及履约风险等，敬请投资者注意投资风险。

一、交易概述

（一）投资目的

随着人民币定价机制趋于透明，汇率市场化改革提速推进，汇率和利率波动幅度不断加大，外汇市场不确定性越发凸显。近两年，公司信息事业部业务发展较快，其进出口业务持续增加（主要采用美元结算），加之新并入的控股子公司四川欧乐预计有较多进出口业务，预计公司将持续面临汇率或利率波动的风险。

公司及控股子公司拟开展的衍生品交易业务与日常经营需求是紧密相关的，旨在提高公司应对外汇波动风险的能力，防范汇率波动对公司利润和股东权益造成不利影响，增强公司财务稳健性。

（二）投资金额

公司及控股子公司拟在不超过 4,500 万美元（或其他等值外币）的额度内开展外汇衍生品交易，以上额度在期限内可循环滚动使用，但在以上额度期限内任一时点的累计余额不超过 4,500 万美元（或其他等值外币）。

（三）投资方式

公司及控股子公司开展的外汇衍生品交易主要包括远期、期货、掉期（互换）和期权等产品或上述产品的组合，对应基础资产包括证券、指数、利率、汇率、货币、商品等标的或是上述标的的组合；交易对手方为经国家外汇管理局和中国人民银行批准，具有外汇衍生品交易业务经营资格的金融机构；外汇衍生品交易以正常外汇资产、负债为背景，业务金额和业务期限与预期外汇收支期限相匹配；外汇衍生品交易使用公司的银行综合授信额度或保证金交易，到期采用本金交割或差额交割的方式。

（四）投资期限

与基础交易期限相匹配，一般不超过十二个月。

（五）资金来源

公司及控股子公司开展外汇衍生品交易业务使用流动资金。

（六）授权

提请股东大会授权董事长在上述额度范围内具体实施外汇衍生品交易业务的相关事宜。

二、审批程序

公司于 2021 年 5 月 11 日召开的第五届董事会第十五次会议、第五届监事会第十次会议审议通过了《关于提高开展外汇衍生品交易业务额度的议案》；该议案尚需提交公司 2020 年年度股东大会审议；本事项不构成关联交易，亦不构成《上市公司重大资产重组管理办法》所规定的重大资产重组。

三、开展外汇衍生品交易业务的风险分析及风控措施

（一）风险分析

公司及控股子公司开展外汇衍生品交易遵循锁定汇率、防范利率风险原则，不做投机性、套利性的交易操作，但外汇衍生品交易操作仍存在一定的风险：

1、市场风险：汇率波动具有双向性，在远期汇率走势中，可能出现远期外汇交易汇率锁定价格低于交割当日公司记账汇率，造成公司汇兑损失。

2、流动性风险：外汇衍生品以公司外汇资产、负债为依据，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：公司及控股子公司开展外汇衍生品交易对手均为经国家外汇管理局和中国人民银行批准，具有外汇衍生品交易业务经营资格的金融机构，履约风险较低。

4、其它风险：如操作人员未按规定程序进行外汇衍生品交易操作或未能充分理解衍生品信息，将带来操作风险；在开展交易时，如交易合同条款不明确，或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。

（二）风控措施

1、公司已制定《外汇衍生品交易业务管理制度》，对金融衍生品业务的操作原则、审批权限、责任部门及责任人、内部操作流程、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序、信息披露等作了明确规定，防范内部控制风险。

2、公司为开展外汇衍生品交易业务配备专业人员，并定期进行业务知识和

风险制度等方面的专业培训。

3、公司财务部密切跟踪金融衍生品公开市场价格或公允价值变动，及时评估金融衍生品业务的风险敞口变化情况，并定期向公司相应监管机构报告。

4、公司及控股子公司开展的外汇衍生品交易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；公司外汇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；公司不得进行带有杠杆的外汇衍生品交易。

5、公司将审慎审查与金融机构签订的合约条款，严格执行风险管理制度，以防范法律风险。

四、外汇衍生品交易对公司的影响

（一）公司及控股子公司开展的衍生品交易业务与日常经营需求是紧密相关的，有利于提高公司应对外汇波动风险的能力，防范汇率波动对公司利润和股东权益造成不利影响，增强公司财务稳健性。

（二）公司需严格按照《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》等相关规定及其指南，对拟开展的外汇衍生品交易业务进行相应的核算和披露，反映资产负债表及损益表相关项目。

公司将密切关注外汇衍生品业务开展情况，根据相关规则的要求及时履行信息披露义务。

五、独立董事意见

公司已就拟提高开展衍生品交易额度事项出具可行性分析报告，本次拟提高开展外汇衍生品交易业务额度是基于预计公司及控股子公司未来的进出口业务增多，且拟开展的外汇衍生品交易业务与日常经营需求紧密相关，并以降低外汇汇率及利率波动风险为目的，不存在任何风险投机行为，有利于提高公司及控股子公司的资金使用效率，增强公司应对外汇波动风险的能力，更好地规避和防范公司所面临的外汇汇率波动风险，增强公司财务稳健性，不影响公司及子公司正常的生产经营。公司制定的《外汇衍生品交易业务管理制度》，有利于加强交易风险管理和控制，不存在损害公司和股东利益，尤其是中小股东利益的情形，该议案的审议程序符合有关法律法规及《公司章程》的规定。因此，我们同意公司

提高开展外汇衍生品交易业务额度。

六、监事会意见

经审议,监事会认为:公司开展与日常经营需求紧密相关的衍生品交易业务,有利于提高公司应对外汇波动风险的能力,增强公司财务稳健性。公司审议提高开展外汇衍生品交易业务额度的程序合法合规,不存在损害公司和股东利益的情形。因此,同意将公司及控股子公司开展外汇衍生品交易业务的额度由不超过 2,750 万美元(或其他等值外币)提高至不超过 4,500 万美元(或其他等值外币)。

七、公司外汇衍生品交易业务开展情况

截至本公告日,公司外汇衍生品交易业务开展情况如下:

单位:人民币万元

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	起始日期	终止日期	投资金额
兴业银行股份有限公司深圳分行	无	否	远期结售汇	2021 年 03 月 30 日	2021 年 10 月 29 日	2,001.81
兴业银行股份有限公司深圳分行	无	否	远期结售汇	2021 年 03 月 30 日	2021 年 11 月 29 日	4,012.14
兴业银行股份有限公司深圳分行	无	否	远期结售汇	2021 年 03 月 30 日	2021 年 12 月 30 日	4,689.93
兴业银行股份有限公司深圳分行	无	否	远期结售汇	2021 年 03 月 30 日	2022 年 01 月 28 日	4,026.96
兴业银行股份有限公司深圳分行	无	否	远期结售汇	2021 年 03 月 30 日	2022 年 02 月 25 日	2,503.6
合计				--	--	17,234.44

八、备查文件

- 1、经与会董事签字并加盖董事会印章的《第五届董事会第十五次会议决议》;
- 2、经独立董事签字的《独立董事关于第五届董事会第十五次会议相关事项的独立意见》;
- 3、经与会监事签字并加盖监事会印章的《第五届监事会第十次会议决议》;
- 4、《关于提高开展外汇衍生品交易业务额度的可行性分析报告》;
- 5、《外汇衍生品交易业务管理制度》。

特此公告。

深圳市大为创新科技股份有限公司

董 事 会

2021 年 5 月 11 日