

# 苏州苏大维格科技集团股份有限公司

## 关于 2022 年度开展金融衍生品交易业务的 可行性分析报告

### 一、公司开展的金融衍生品交易的背景

苏州苏大维格科技集团股份有限公司（以下简称“公司”）及子公司在日常经营中，部分产品需要出口、部分原材料需要进口，公司及子公司在进出口业务中也涉及外币贷款等业务。受国际政治、经济等不确定因素影响，外汇市场风险显著增加，为有效规避和防范公司开展对外贸易和外币借款过程中的汇率、利率波动风险，结合公司及子公司日常经营需要，公司拟使用部分自有资金开展金融衍生品交易业务，以合理控制汇兑风险对公司经营的影响程度，实现资产的保值增值。

### 二、公司开展金融衍生品交易概述

#### 1、交易目的

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，以规避和防范汇率和利率风险为目的。

#### 2、额度及期限

公司拟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 15,000 万元或等值外币，授权期限为自公司第五届董事会第六次会议审议通过之日起一年内有效；在授权额度范围内，资金可以循环使用。

#### 3、交易业务品种

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。

#### 4、交易对手方

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、公司开展金融衍生品交易的必要性和可行性

公司及子公司在日常经营中，部分产品需要出口、部分原材料需要进口，公司及子公司在进出口业务中也涉及为有效规避和防范公司开展对外贸易和外币借款过程中的汇率、利率波动风险，增强公司财务稳健性，公司有必要根据自身业务及外币资金等具体情况，适度开展金融衍生品交易。

公司开展的金融衍生品交易与公司业务紧密相关，基于公司出口项下的外币收款预测及进口项下的外币付款预测，或者在此基础上衍生的外币银行存款、借款情况，公司须具有与金融衍生品业务相匹配的自有资金，不得使用募集资金直接或间接进行金融衍生品业务交易，且严格按照审议批准的交易额度，控制资金规模，进一步提高公司应对外汇波动风险的能力，更好地规避和防范外汇汇率、利率市场波动风险，增强公司财务稳健性。

### 四、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。

### 五、公司对金融衍生品业务的风险应对措施

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。

## **六、公司开展金融衍生品的交易的可行性分析结论**

公司金融衍生品交易是围绕公司实际外汇收支业务进行的，以具体经营业务为依托，以规避和防范汇率风险、利率风险为目的，是出于公司稳健经营的需求。公司已制定《金融衍生品交易管理制度》，公司所计划采取的针对性风险管理控制措施也是可行的。公司通过开展金融衍生品交易，可以在一定程度上规避和防范汇率波动风险。

苏州苏大维格科技集团股份有限公司

董 事 会

2022年3月29日