

## 深圳市怡亚通供应链股份有限公司

### 关于 2021 年度金融衍生品交易预测的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

深圳市怡亚通供应链股份有限公司及下属控股子公司（以下简称“公司”）在日常经营过程中会涉及大量的外币业务（包括贸易项下外汇资金收付、海外投资引起的资本性收支、外币融资风险敞口、海外外币净资产风险敞口等）。在全球经济急剧变化的环境中，公司必须进行合理有效的风险管理才能确保实际业务的稳健发展。公司及下属控股子公司利用金融衍生工具（包括但不限于远期、掉期、期权合约等或上述产品的组合）对上述业务进行汇率及利率风险管理。现对 2021 年度公司将发生的外汇金融衍生品交易作出以下预测。

#### 一、交易目的

利用金融衍生产品工具管理汇率及利率风险，达到套期保值的目的。

#### 二、金融衍生品交易情况

公司预测 2021 年度金融衍生品交易合约量不超过 20 亿美元（包括但不限于国际、国内产生的金融衍生品交易、远期、掉期合约等）。如超过 20 亿美元，则须依据《证券投资及衍生品交易内控制度》，上报公司董事会、股东大会审批同意后方可进行操作。

#### 三、金融衍生品交易风险分析

1、价格波动风险：因外汇行情变动较大，可能产生因标的利率、汇率等市场价格波动而造成金融衍生品价格变动而造成亏损的市场风险。

2、流动性风险：因市场流动性不足而无法完成交易的风险。

3、履约风险：对部分按照预算进行相应风险管理而开展衍生品业务，存在合约到期无法履约造成违约而带来的风险。

4、内部控制风险：衍生金融交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于内控体系不完善造成的风险。

5、操作风险：可能因为计算机系统不完备导致技术风险及操作人员误操作。

#### **四、公司拟采取的风险控制措施**

1、选择结构简单、流动性强、风险可控的金融衍生工具开展套期保值业务。

2、慎重选择从事金融衍生业务的交易对手。

3、设专人对持有的金融衍生品合约持续监控和报告各类风险，在市场剧烈波动或风险增大情况下，或导致发生重大浮盈浮亏时及时报告公司决策层，积极应对，妥善处理。

4、金融衍生交易以套保为原则，最大程度规避汇率波动带来的风险，并结合市场情况，适时调整操作策略，提高套保效果。公司金融衍生品交易业务只限于以公司及其全资控股的联怡（香港）有限公司、联怡国际（香港）有限公司、上海怡亚通供应链有限公司、上海怡亚通供应链管理有限公司、Eternal Asia (s) PTE. Ltd.、深圳市前海怡亚通供应链有限公司、深圳市怡亚通冷链供应链有限公司、大同市怡亚通供应链有限公司为主体进行操作，其他全资及控股子公司未获批准前一律不得从事。严格控制金融衍生品交易合约量，预计公司及上述控股子公司 2021 年金融衍生品交易合约量不超过 20 亿美元，超过部分须依据《深圳市怡亚通供应链股份有限公司证券投资及衍生品交易内控制度》上报董事会、股东大会审批同意后方可进行操作。

5、严格控制金融衍生交易的资金规模，合理计划和安排使用保证金。公司严禁使用募集资金直接或间接进行套期保值。

6、设立专门的风险控制岗位，实行严格授权和岗位制衡制度。公司将严格按照规定安排和使用专业人员，建立严格的授权和岗位制衡制度，同时加强相关人员的业务培训及职业道德教育，增强相关人员的综合素质。同时建立异常情况及时报告制度，并形成高效的风险处理程序。

7、设立符合要求的交易、通讯及信息服务设施系统。公司将保证交易系统的正常运行，确保交易工作正常开展。当发生错单时，及时采取相应处理措施，以减少损失。

#### **五、独立董事意见**

独立董事认为：公司开展金融衍生品交易业务有利于管理外汇风险，降低购汇成本，具有一定的必要性；公司制定了金融衍生品业务控制制度和实施细则，

完善了相关内控制度，公司拟采取的针对性风险控制措施是可行的；从业务的性质上看，其所进行的金融衍生品交易均双边锁定，不进行无锁定的单边交易；同时公司从事金融衍生品交易的人员具有多年操作经验，对市场及业务较为熟悉，风险在一定程度上是可控的。同时希望公司在上述运作中，对上述工作流程进一步优化，更严格的控制各种风险。

## 六、备查文件

- 1、《深圳市怡亚通供应链股份有限公司第六届董事会第四十二次会议决议》
- 2、《独立董事关于第六届董事会第四十二次会议相关事项的独立意见》
- 3、《深圳市怡亚通供应链股份有限公司第六届监事会第二十九次会议决议》

特此公告。

深圳市怡亚通供应链股份有限公司董事会

2021年4月26日