

深圳市普路通供应链管理股份有限公司

关于拟开展金融衍生品交易的可行性分析报告

一、公司拟开展金融衍生品交易的必要性和可行性

由于公司及子公司在日常经营进出口业务过程中涉及部分的外币业务(包括贸易项下外汇资金收付、外币融资业务、海外外币净资产业务等),为满足公司及子公司外币业务,降低支付成本、规避汇率变动风险,并获得一定收益,公司及子公司拟开展货币类金融衍生品交易业务,满足公司稳健经营的需求。

公司及子公司开展的金融衍生品交易应与其日常经营需求紧密相关,并基于公司及子公司具体业务情况,适度开展金融衍生品交易业务。

二、公司拟开展的金融衍生品交易概述

公司拟开展的金融衍生品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,对应基础资产包括汇率、利率、货币、有价证券等;既可采取到期交割,也可采取差额结算。

结合资金管理要求和日常经营需要,公司拟开展的金融衍生品包括但不限于以下范围:人民币或其他货币的远期结售汇业务、外汇掉期业务、货币互换业务、利率互换业务以及外汇期权业务等或上述产品的组合。

三、公司拟开展的金融衍生品交易业务计划

根据公司《金融衍生品交易业务管理制度》,结合相关法律、法规规定和公司实际经营需要,公司及子公司 2024 年度拟开展的金融衍生品交易合约量不超过 20 亿美元,该金融衍生品交易额度有效期限自公司股东大会审议通过之日起 12 个月内有效,在此期间,额度可循环滚动使用。

四、公司拟开展金融衍生品交易的风险分析

公司及子公司进行金融衍生品业务遵循稳健原则,不进行以投机为目的的衍生品交易,所有金融衍生品业务均以正常经营为基础,以具体经营业务为依托,以规避和防范汇率、利率风险为目的。但是进行金融衍生品业务也会存在一定的风险:

1、价格波动风险: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浮动亏损的市场风险。

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,可能会由于内部操作或内部人员未能充分理解交易合同条款和产品信息而造成风险。

- 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、公司拟开展金融衍生品交易的风险控制措施

- 1、选择流动性强、风险可控的金融衍生品开展套期保值等业务。
- 2、金融衍生品交易以获取无风险收益，提高股东回报为原则，最大程度规避汇率波动带来的风险，并结合市场情况，适时调整操作及风控策略。
- 3、公司仅选择具有合法资质的大型商业银行等金融机构作为交易对手，开展金融衍生品交易业务，规避可能产生的法律风险。
- 4、设专人对持有的金融衍生品合约持续监控，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，并积极应对。

六、公司拟开展金融衍生品交易的可行性分析结论

公司及子公司拟开展的金融衍生品交易与日常经营紧密相关，以降低支付成本、规避汇率变动风险为目的，符合公司稳健经营的要求。公司已制定了《金融衍生品交易业务管理制度》，建立了完善的内部控制制度，公司所计划采取的针对性风险控制措施也是可行的。

深圳市普路通供应链管理股份有限公司

董事会

2024年4月29日