

证券代码：688036

证券简称：传音控股

公告编号：2019-009

深圳传音控股股份有限公司 关于2020年度开展外汇衍生品交易额度预计的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性依法承担法律责任。

重要内容提示：

●公司的外汇衍生品交易业务以正常生产经营为基础，以规避和防范汇率风险为目的，不进行单纯以盈利为目的的投机和套利交易。

●公司及控股子公司预计 2020 年度拟进行外汇衍生品交易业务资金额度折合美元不超过 12 亿美元（额度范围内资金可滚动使用），单笔外汇衍生品交易金额不得超过 5000 万美金。额度有效期为自公司股东大会审议通过之日起 12 个月。

●公司将严格根据《深圳传音控股股份有限公司金融衍生品交易管理制度》、《深圳传音控股股份有限公司金融衍生品交易实施细则》等相关规章制度开展外汇衍生品交易业。

●本事项尚需提交公司股东大会审议。

深圳传音控股股份有限公司（以下简称“公司”）于 2019 年 12 月 10 日召开第一届董事会第二十九次会议、第一届监事会第十次会议，审议通过了《关于 2020 年度开展外汇衍生品交易额度预计的议案》，该议案尚需提交公司股东大会审议。公司及控股子公司根据实际经营需要，拟与银行等金融机构开展外汇衍生品交易业务。具体如下：

一、开展外汇衍生品交易业务的必要性

公司主营出口业务外汇结算比重较大，为有效规避外汇市场的风险，防范汇率大幅波动对公司经营业绩造成不利影响，提高外汇资金使用效率，合理降低财

务费用，公司及控股子公司拟与银行等金融机构开展外汇衍生品交易业务。公司的外汇衍生品交易业务以正常生产经营为基础，以规避和防范汇率风险为目的，不进行单纯以盈利为目的的投机和套利交易。

二、拟开展的外汇衍生品交易业务概述

1、公司及控股子公司拟开展的外汇衍生品交易品种包括外汇远期、外汇掉期、买入期权及期权组合等业务；涉及的币种为公司生产经营所使用的主要结算货币，包括但不限于美元、印度卢比、南非兰特等。

2、公司及控股子公司预计 2020 年度拟进行外汇衍生品交易业务资金额度折合美元不超过 12 亿美元（额度范围内资金可滚动使用），额度有效期为自公司股东大会审议通过之日起 12 个月。

3、由公司经营管理层在额度范围内依据内部相关流程履行日常审批程序及签署相关法律文件。预计额度范围内发生的单笔外汇衍生品交易，无需再提交董事会审议。超出额度范围的，将依据《公司章程》规定履行必要的审议程序。

三、开展外汇衍生品交易业务的风险分析

1、市场风险：因国内外经济形势变化可能会造成汇率的大幅波动，外汇衍生品交易业务面临一定的市场风险。

2、操作风险：外汇衍生品交易业务专业性较强，复杂程度高，可能会由于操作人员未及时、充分地理解衍生品信息，或未按规定程序进行操作而造成一定风险。

3、银行违约风险：对于远期外汇交易，如果在合约期内银行违约，则公司不能以约定价格执行外汇合约，存在风险敞口不能有效对冲的风险。

四、公司采取的风险控制措施

1、公司制定了《深圳传音控股股份有限公司金融衍生品交易管理制度》、《深圳传音控股股份有限公司金融衍生品交易实施细则》等相关规章制度，对外汇远期合约产品的购买及决策权限等进行规定，董事会、股东大会审议通过后，授权总经理、财务负责人及其组建的外汇风险管理小组在审议额度范围内审批外汇衍生品业务方案和签署相关协议及其他附件文件。未经授权或审批，其他部门和个人无权做出外汇衍生品交易业务的决定。

在董事会、股东大会审批的额度范围内操作，购买的外汇远期合约不得超过年度预算中预期外汇收款的 50%；单笔外汇衍生品交易金额不得超过 5000 万美金。

2、公司不断优化相应制度及风险防范措施，成立了外汇风险管理小组成员，成员涵盖公司管理层、业务、法务、董秘办及财务部等多部门的负责人员，同时引进了相应的专业人员，并加强与银行等相关专业机构及专家的沟通与交流

3、公司提高决策的谨慎性，强化责任措施，包括但不限于：（1）对相关责任人及权责进一步明晰，明确公司董事长、总经理和财务总监为外汇远期合约业务的直接责任人；（2）由操作人员详细记录每笔交易信息，交易完成后及时存档并报送给外汇风险管理小组，按月向董事长、总经理、财务总监等公司经营管理层进行汇报，如有违反公司相关制度规定，追究有关负责人的责任；（3）审计监察部建立定期和不定期检查制度，保证外汇交易符合公司相关制度规定。

4、强化持续关注与管理，具体如下：

（1）财务管理部随时关注外汇衍生品的市场信息，妥善安排交割资金，保证按期交割；（2）财务管理部应跟踪外汇衍生品公开市场价格或公允价值的变化，及时评估已交易外汇衍生品的风险敞口，并及时提交风险分析报告，内容至少应包括外汇衍生品交易情况、风险评估结果、本期外汇衍生品交易盈亏状况、止损限额执行情况等内容，上报公司管理层；（3）外汇衍生品交易业务存在重大异常情况，并可能出现重大风险时，财务负责人及财务管理部应及时提交分析报告和解决方案，随时跟踪业务进展情况，并及时向董事会办公室报告，同时公司管理层应立即商讨应对措施，综合运用风险规避、风险降低、风险分担和风险承受等应对策略，提出切实可行的解决措施

5、公司仅选择与具有合法资质的、信用级别高的大型商业银行开展外汇衍生品交易业务，这类银行经营稳健、资信良好，基本可规避银行履约风险。

五、独立董事意见

公司开展外汇衍生品交易是以具体经营业务为依托，以规避和防范汇率波动风险为目的，以保护公司正常经营利润为目标，具有一定的必要性。公司开展外汇衍生品交易业务，符合公司利益，不存在损害社会公众股东合法权益的情形。我们一致同意公司关于 2020 年度开展外汇衍生品交易额度预计的事项。

六、监事会意见

公司开展外汇衍生品交易业务主要是为了减少外汇大幅波动带来的不良影响，符合公司业务发展需求。公司制定了相应的业务管理制度，建立了健全有效

的审批程序和风险控制体系，并严格按照制度要求执行。公司开展外汇衍生品交易业务的相关决策程序符合法律法规的相关规定，不存在损害上市公司及股东利益的情形。我们一致同意公司根据实际经营情况，在预计的额度范围内开展外汇衍生品交易业务。

七、保荐机构核查意见

经核查，保荐机构认为：

公司开展外汇衍生品交易符合实际经营需要，可以规避外汇市场的风险，防范汇率大幅波动对公司经营业绩造成不利影响，提高外汇资金使用效率，合理降低财务费用。公司制定了《深圳传音控股股份有限公司金融衍生品交易管理制度》、《深圳传音控股股份有限公司金融衍生品交易实施细则》等相关外汇交易业务管理制度及风险防范措施，形成了较为完善的内控制度，相关风险能够有效控制。

综上，保荐机构同意公司上述 2020 年度开展外汇衍生品交易额度预计事项。特此公告。

深圳传音控股股份有限公司董事会

2019 年 12 月 11 日