

欣龙控股（集团）股份有限公司 关于开展衍生品投资业务的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

欣龙控股（集团）股份有限公司（以下简称“本公司”或“公司”）曾经第五届董事会第三十二次会议决议，同意公司使用不超过 5000 万元人民币委托瑞达期货股份有限公司进行资产管理。该项投资目前已到期限。根据公司目前的资金等实际情况，为进一步提高公司资金使用效率，增加公司投资收益，董事会拟同意公司在不影响正常运营、严格控制风险的前提下，增加使用不超过 5000 万元人民币总计不超过 10000 万元人民币自有资金参与期货公司资产管理业务。

根据《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所主板上市公司规范运作指引》、《公司章程》及《欣龙控股（集团）股份有限公司衍生品投资管理制度》等相关规定，上述衍生品投资事项已经公司第六届董事会第九次会议审议通过，无需提交公司股东大会审议，亦不构成关联交易。

本次衍生品交易的具体情况如下：

一、衍生品投资项目概况

总计使用不超过 10000 万元人民币（占公司上一年末经审计净资产的 16.13%）委托瑞达期货股份有限公司进行资产管理。投资期限

为自公司董事会会议审议通过后一年内。

二、拟委托开展衍生品投资的主要条款

(一) 资产管理计划的名称：瑞达-欣财 1 号资产管理计划。

(二) 资产管理计划的类别：期货公司特定客户资产管理计划。

(三) 资产管理计划的运作方式：开放式。

(四) 资产管理计划的投资目标：在风险适度可控前提下，追求稳定、长期的适度收益。

(五) 资产管理计划的投资范围：本产品主要投资于包括国内依法发行的国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板上市的股票）、权证、期权、公开募集证券投资基金、债券、股指期货、商品期货、利率远期和互换、证券公司资产管理计划、期货公司资产管理计划、集合资金信托计划；本产品可以参与融资融券交易，可以将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司，也可参与证券回购业务。

(六) 资产管理计划的存续期限：不定期。

(七) 资产管理计划份额的面值：人民币 1.00 元。

(八) 资产管理计划的预警与止损：

为保护资产委托人的利益，本资产管理计划将计划份额净值为 0.8500 元设置为预警线，将计划份额净值为 0.8000 元设置为止损线。

(九) 资产管理计划的费用

1、管理费：本计划的年管理费率不超过 2%

2、托管费：本计划的年托管费率不超过 0.1%。

3、运营服务费：本计划份额注册登记、估值等运营服务费用，年费率不超过 0.1%。

4、业绩报酬：业绩报酬的计提，以资产委托人退出对应份额持有期间收益为基准，按比例提取，具体提取比例如下：

当资产委托人退出对应份额持有期间的收益低于 0%（含），不提取业绩报酬；

当资产委托人退出对应份额持有期间的收益高于 0%（不含），提取该对应份额收益的 25%作为业绩报酬。

（十）本资产管理计划的委托人为欣龙控股（集团）股份有限公司，管理人不接受其他第三方委托参与申请。

三、开展衍生品投资的必要性说明

公司在保证资金安全性、流动性的基础上，委托专业机构进行衍生品等投资，可有效把握市场投资机遇，提升公司自有资金的使用效率，增加投资收益，实现资金的保值增值。

四、公司对衍生品交易的准备情况

（一）公司制定了《欣龙控股（集团）股份有限公司衍生品投资管理制度》，对公司进行衍生品投资的风险控制、审批程序、后续管理和信息披露等进行了明确规定，以有效规范衍生品投资行为，控制衍生品投资风险。

（二）公司开展衍生品投资前，由计划财务处负责评估衍生品的投资风险，分析该业务的可行性与必要性，并及时上报突发事件及风险评估变化情况。公司董事会审计委员会负责审查衍生品投资的必要性及风险控制情况。

（三）公司组织相关部门、人员通过多种渠道学习衍生品交易知识，公司衍生品投资专业人员已充分理解衍生品投资的特点和风险，并将严格执行衍生品投资的业务操作和风险管理制度。

五、投资风险分析

（一）市场风险：证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使计划资产面临潜在的风险。衍生品交易受国内外宏观经济形势、汇率和利率波动、股票市场波动、投资标的行业周期、投资标的公司经营管理状况等多种因素的影响，存在一定的市场风险，公司收益存在一定的不确定性；资产管理合同虽然约定了一定的止损比例，但由于持仓品种价格可能持续向不利方向变动、持仓品种因市场剧烈波动导致不能平仓等原因，存在超出该止损比例的风险。

（二）流动性风险：在市场或个股流动性不足的情况下，管理人可能无法迅速、低成本地调整投资计划，从而对计划收益造成不利影响。在资产委托人提出追加或减少计划财产时，可能存在现金不足的风险和现金过多带来的收益下降风险。

（三）信用风险：本计划交易对手方发生交易违约或者计划持仓债券的发行人拒绝支付债券本息，导致计划财产损失。

（四）操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险。在计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致资产委托人的利益受到影响。

（五）管理风险：在实际操作过程中，管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断，其精选出的投资品种的业绩表现不一定持续优于其他投资品种。

（六）法律风险：在本计划的运作过程中，因管理人、托管人、证券经纪机构等合作方违反国家法律规定或者相关合同约定而可能

对计划财产带来风险。

六、拟采取的风险控制措施

（一）公司将遵守谨慎投资原则，考虑风险与收益最佳匹配，委托正规、专业的投资机构选择稳健的投资品种，最大限度地降低、规避市场风险；

（二）在委托投资前，公司计划财务处进行了衍生品投资风险分析，对委托机构的基本情况 & 专业素质进行了充分地调查，严格在授权范围内从事衍生品交易，同时并建立异常情况及时报告制度，指定相关人员跟踪委托交易的变动情况，最大限度地降低、规避操作风险；

（三）公司将与委托机构签订条款准确明晰的协议，最大限度地降低、规避法律风险；

（四）公司将定期对衍生品交易的规范性、内控制度的有效性、信息披露的真实性等进行监督检查；

（五）公司将按照相关监管规定，及时披露衍生品投资相关损益情况。

七、会计政策及核算原则

公司根据《企业会计准则》对衍生品投资公允价值予以确认，并对衍生品予以列示和披露。

八、对公司的影响

公司坚持谨慎投资的原则，在确保公司日常经营稳健以及资金安全性、流动性的前提下，以自有资金适度进行委托专业机构开展衍生品投资业务，不会影响公司主营业务的正常开展。同时，适度的衍生品投资有助于提高公司的资金使用效率，进而提升公司整体业绩水平，为公司股东谋取更多投资回报。

九、独立董事意见

作为欣龙控股（集团）股份有限公司的独立董事，我们对提交公司第六届董事会第九次会议予以审议的《关于公司开展衍生品投资的议案》及相关事项涉及的相关内容进行了认真审查。在审阅有关文件后，我们基于独立判断的立场，特发表如下独立意见：

（一）公司在保证正常生产经营活动及投资需求的前提下，使用部分自有资金用于衍生品交易，有利于提高公司资金使用效率，并利用资本市场提升公司整体业绩水平。

（二）公司已制定《欣龙控股（集团）股份有限公司衍生品投资管理制度》，建立健全了业务流程、审批权限、监督机制及风险控制措施，衍生品交易风险可控；

（三）公司开展衍生品交易事项的决策程序符合有关法律、法规及公司相关的规定，且履行了必要的审批程序，符合相应规范。

综上，我们同意公司开展本次衍生品投资事项。

十、备查文件

- （一）公司第六届董事会第九次会议决议；
- （二）公司独立董事的独立意见

欣龙控股（集团）股份有限公司

董 事 会

2016年10月11日