

中国有色金属建设股份有限公司 关于开展2019年度期货套期保值业务的公告

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、误导性陈述或者重大遗漏。

为规避产品价格波动的风险，有效控制经营风险，提高公司市场竞争力，根据《深圳证券交易所主板上市公司规范运作指引》等相关规定，结合公司业务发展的实际需要，公司控股子公司赤峰中色锌业有限公司（以下称“中色锌业”）和赤峰中色白音诺尔矿业有限公司（以下称“中色矿业”）拟于2019年继续开展商品期货套期保值业务（以下简称“套期保值业务”），现将相关情况说明如下：

一、履行合法表决程序的说明

2019年1月17日，公司第八届董事会第54次会议以9票同意，0票反对，0票弃权的表决结果审议通过了《关于公司2019年度期货套期保值计划的议案》。

该业务不属于关联交易事项，无需履行关联交易表决程序。

该业务涉及金额未达到公司股东大会审议标准，无需提交公司股东大会审议。

二、开展套期保值业务概述

1、交易品种：锌锭

2、交易数量和金额

2019年公司锌金属保值总量计划11.089万吨，初始保证金规模不超过人民币1.2亿元，其中：

中色锌业全年保值计划数量为锌锭不超过10.089万吨，初始保证金规模不超过人民币7,000万元；

中色矿业全年保值计划数量为锌锭不超过1万吨，初始保证金规模不超过人

民币 5,000 万元。

3、业务期间：2019 年 1 月—2019 年 12 月。

三、开展套期保值业务的目的和必要性

为预防和规避 2019 年锌产品价格波动风险，减少锌价下跌风险对企业的预期利润造成的不利影响，确保企业稳健经营，2019 年，公司将结合生产经营的实际情况，拟通过套期保值来规避和减少锌金属价格剧烈波动带来的经营风险，锁定预期利润或减少价格下跌造成的损失。

四、公司开展套期保值业务的准备情况

1、公司已制定《中国有色金属建设股份有限公司期货套期保值管理办法》并严格执行。

2、本次进行套期保值的两个平台中色锌业和中色矿业也制定了各自的期货套期保值管理办法和套期保值风控专项管理制度等系列办法和细则，并严格执行。

3、为进一步加强期货保值管理工作，健全和完善期货运作程序，确保公司生产经营目标的实现，公司成立了套期保值业务管理委员会，两个期货套期保值业务平台中色锌业和中色矿业也分别设立了相应的组织架构。

4、设立了期货业务部门，明确相应职责、人员。

5、配备投资决策、业务操作、风险控制等专业人员。

五、开展套期保值业务的风险分析

通过期货套期保值操作可以规避锌金属价格剧烈波动对公司生产经营的影响，有利于公司正常的生产经营，但同时也可能会存在一定风险：

1、市场风险：期货市场行情变化较快，可能会发生期货价格与现货价格走势背离或市场大幅波动等风险。

2、技术风险：由于无法控制或不可预测的系统、网络、通讯故障等造成交易系统非正常运行，使交易指令出现延迟、中断或数据错误等问题，从而带来相应风险。

3、操作风险：因内部控制不当等原因，导致操作不当而产生的意外损失。

4、资金风险：由于交易保证金不足可能导致所持仓位被强制平仓，造成实际损失。

5、法律风险：与相关法律法规冲突导致的法律风险及交易损失。

六、开展期货套期保值业务的风险控制措施

1、严格控制套期保值品种。将套期保值业务与公司生产经营相匹配，最大程度对冲有色金属原材料和产品价格波动风险。公司的期货套期保值业务只限于在上海期货交易所交易的有色金属期货合约，严禁进行以逐利为目的的任何投机交易。进行套期保值的数量原则上不得超过与现货锁定价格的商品数量，持仓时间应与现货保值所需的计价期相匹配。

2、严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金。严格按照公司规定权限下达操作指令，根据规定进行审批后，方可进行操作。公司将合理调度资金用于套期保值业务。

3、根据国资委及深圳证券交易所等有关规定，结合公司实际情况，对套期保值业务额度、品种范围、审批权限、内部审核流程、责任部门及责任人、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序、信息披露等作出明确规定。公司将严格控制期货价格波动风险，在套期保值过程中设立止损线。

4、设立符合要求的计算机系统及相关设施，确保交易工作正常开展。当发生故障时，及时采取相应处理措施以减少损失。

5、根据生产经营所需及客户订单周期作为期货操作期，降低期货价格波动风险。

6、加强对国家及相关管理机构相关政策的把握和理解，及时合理地调整套期保值思路与方案。

七、期货公允价值分析

公司套期保值业务选择的交易所和交易品种市场透明度大，成交活跃，流动性较强，成交价格和结算价格能充分反映衍生品的公允价值。

八、会计政策及核算原则

公司套期保值交易相关会计政策及核算原则按照中华人民共和国财政部发布的《企业会计准则—金融工具确认和计量》及《企业会计准则—套期保值》相关规定执行。

九、套期保值业务后续信息披露

1、当套期保值业务出现重大风险或可能出现重大风险，套期保值业务导致

合计亏损或浮动亏损金额每达到公司最近一期经审计净资产的10%且绝对金额超过1,000万元人民币时，公司将及时发布临时公告并披露相关情况。

2、公司将在定期报告中对已经开展的套期保值业务相关信息予以披露。

十、 独立董事意见

公司独立董事发表了独立意见：（1）公司在保证正常生产经营的前提下，使用自有资金开展期货套期保值业务履行了相关的审批程序，符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定，有利于公司降低经营风险，不存在损害公司和全体股东利益，特别是中小股东利益的情况。

（2）公司建立了《中国有色金属建设股份有限公司期货套期保值管理办法》，明确了业务操作流程、审批流程及风险防控等内部控制程序，对公司控制期货风险起到了保障的作用。

（3）公司确定的年度套期保值保证金的最高额度和交易品种合理，符合公司的实际生产经营情况，有利于公司合理的控制交易风险。

十一、 备查文件

- 1、第八届董事会第54次会议决议；
- 2、独立董事的独立意见。

特此公告。

中国有色金属建设股份有限公司董事会

2019年1月19日