

证券代码：600096

证券简称：云天化

公告编号：临 2019-074

云南云天化股份有限公司 关于子公司开展期货套期保值业务的公告

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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

2019 年 7 月 10 日，公司第七届董事会第五十次（临时）会议审议通过了《关于子公司开展期货套期保值业务的议案》，现将相关情况公告如下：

一、开展期货套期保值业务子公司基本情况

公司子公司呼伦贝尔东明矿业有限责任公司（以下简称“东明矿业”）预计开展动力煤品种的套期保值业务。其基本情况如下：

公司名称：呼伦贝尔东明矿业有限责任公司

注册地点：内蒙古自治区陈巴尔虎旗巴彦库仁镇东明矿区

法定代表人：林旭楠

经营范围：煤炭开采、销售

与公司关系：公司控股子公司呼伦贝尔金新化工有限公司的全资子公司。

股东及持股比例：东明矿业的股东为呼伦贝尔金新化工有限公司，公司持有金新化工51%的股权。

东明矿业 2018 年经审计总资产 171,563.67 万元、净资产 40,858.07 万元，2018 年全年实现营业收入 104,992.45 万元，净利润 22,142.81 万元。

二、开展期货套期保值的目的

东明矿业为煤炭开采和销售企业，由于目前煤炭市场价格波动较

大，对公司生产、销售影响较大，为减少煤炭价格波动对公司造成的不确定性影响，东明矿业计划增加对煤炭（动力煤等）商品开展套期保值业务。

三、开展的期货套期保值交易情况

单位：万元、万吨

子公司	经营产品	公司日均库存量	最高期货持仓数量	最高期货保证金额度	备注
东明矿业	动力煤	20	18	2,200	平均价约 610 元/吨，平均保证金率 20%

同时，为有效降低期货风险，公司拟以期权为工具，适时开展对以上期货交易的风险对冲。期权交易额度不得超出期货持仓额度，期权交易费用包含在上表的“最高期货保证金额度”内。

四、套期保值交易有效期

本方案有效期一年。

五、风险控制措施

（一）严格执行公司《期货套期业务管理制度》相关规定，并在董事会审议通过的年度方案权限内办理公司期货套期保值业务；

（二）公司进行的商品期货套期保值业务遵循锁定原材料价格风险、套期保值原则，不做投机性、套利性的交易操作；

（三）建立严格内部风险报告制度，形成高效的风险监控预警制度，以及风险测算体系；

（四）建立有效的内控制度。使用专业人员，加强相关人员的职业道德教育及业务培训，提高相关人员的综合素质。

六、独立董事独立意见

公司子公司开展期货套期保值业务有利于有效防范市场风险，对冲现货成本，促进自身长期稳健的发展，公司已建立较为完善的《期货套期保值业务管理制度》，形成了较为完整的风险管理体系，该套期保值业务的相关审批程序符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定。我们认为公司应加强对市场的判断分析，提升市场分析

操作准确性，根据经营需求严格按照相关规定进行期货套期保值操作，并确保有效防范期货套期保值业务风险。

特此公告。

云南云天化股份有限公司

董事会

2019年7月11日