

证券代码：600096

证券简称：云天化

公告编号：临 2020-077

云南云天化股份有限公司

关于子公司增加期货套期保值额度的公告

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。

2020年7月15日，公司第八届董事会第十七次会议审议通过了《关于子公司增加期货套期保值额度的议案》，该议案无需提交公司股东大会审议，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

云南云天化联合商务有限公司（以下简称“联合商务”）为公司的全资子公司。

公司名称：云南云天化联合商务有限公司

注册地点：云南省昆明市滇池路1417号

法定代表人：胡均

注册资本：10,000万元人民币

经营范围：国际经济技术合作；国内贸易、物资供销；化肥进出口经营；贵金属经营等。

截至 2019 年 12 月 31 日，联合商务经审计的总资产 1,030,220.82 万元，净资产 135,479.53 万元，2019 年实现营业收入 3,017,760.56 万元，净利润 17,615.78 万元。

截至2020年3月31日，联合商务未经审计的总资产1,226,550.01万元，净资产140,549.76万元，2020年一季度实现营业收入578,139.85万元，净利润3,314.49万元。

二、开展期货套期保值的目的

为了更好地服务于客户，规避市场波动风险，联合商务拟增加对国

内豆粕和油脂、油料的期货套期保值业务额度，以减少进口大豆价格波动对公司相关业务造成的不确定性影响，提升公司经营业绩的平稳性。

三、2020年开展的期货套期保值交易情况及新增内容

2020年3月2日，公司第八届董事会第十一次（临时）会议审议通过了《关于公司及子公司开展期货套期保值业务的议案》，同意公司子公司联合商务开展期货套期保值业务的方案，期限为董事会审议通过后12个月。详见上海证券交易所网站(<http://www.sse.com.cn>)公司临：2020-018号公告。

联合商务申请在年度套期保值方案中豆粕期货持仓额度增加43.2万吨，期货保证金额度增加25,920万元；油脂、油料持仓额度增加10.8万吨，期货保证金额度增加8,720万元。

2020年原预计开展期货套期保值交易的品种和保证金额度情况及新增内容如下：

子公司	经营产品	公司实物交易 全年总量 (万吨)	最高期货 持仓数量 (万吨)	最高期货保 证金额度 (万元)	备注
第八届董事会第十一次（临时）会议授权					
联合商务	豆粕	52	28.80	17,280	平均价约 3,000 元/吨，平均保证金 20%计
	油脂油料	25	9.20	12,880	平均价约 7,000 元/吨，平均保证金 20%计
	小计			30,160	
本次新增授权					
联合商务	豆粕	预计增加不超过 28 万吨	43.2	25,920	平均价 3,000 元/吨，平均保证金 20%计
	油脂油料	不增加	10.8	8,720	平均价约 6,000 元/吨，平均保证金 20%计
	小计			34,640	
合计				64,800	

四、套期保值交易有效期

本方案有效期为董事会审议通过后12个月。

五、风险控制措施

（一）严格执行公司《期货套期保值业务管理制度》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）建立严格有效的套期保值业务实施细则，实行多级审批管理流程，实施定期汇报机制，确保期货套期保值风险控制在合理范围内；

（三）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；

（四）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；

（五）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、独立董事意见

公司子公司开展期货套期保值业务有利于防范市场风险，对冲现货价格波动风险；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，能有效防范业务风险。该事项表决程序及方式符合有关法律、法规和《公司章程》的规定，不存在损害公司及股东特别是中小投资者利益的情形，同意本次公司子公司增加期货套期保值额度。

特此公告。

云南云天化股份有限公司

董事会

2020年7月16日