

中国有色金属建设股份有限公司 关于开展2021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。

重要内容提示：

- 1、公司套期保值业务的品种只限于上海期货交易所交易的与公司生产经营相关的锌金属期货合约；
- 2、本次拟投入的套期保值业务的保证金不超过人民币 13,000 万元；
- 3、通过期货套期保值操作可以规避金属价格波动对公司生产经营的影响，有利于公司生产经营，但具体交易中也可能存在市场风险、资金流动性风险、操作风险等相关风险，公司将积极落实相关风险防控措施，防范交易风险。

为降低产品价格波动风险，有效控制经营风险，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，中国有色金属建设股份有限公司（以下称“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 2021 年继续开展与公司生产经营相关的锌金属产品期货套期保值业务（以下简称“套期保值业务”），现将相关情况公告如下：

一、本次套期保值业务概述

1、目的及必要性：公司开展套期保值业务，目的是充分利用期货工具的套期保值功能，规避和减少主要产品价格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，符合公司日常经营之所需，存在必要性。本次套期保值业务不会影响公司主营业务的发展，公司严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金。本次套期保值业务满足《企业会计准则》规定的套期保值业务条件，会计核算将按套期保值相关规定进行会计处理。

2、投资金额：本次套期保值业务保证金不超过人民币 13,000 万元，本次业务期限内可循环使用。

3、交易方式：仅限于在上海期货交易所进行场内交易，风险等级较低。本次拟开展的期货套期保值业务的主要条款如下：

(1) 交易品种：只限于上海期货交易所交易的与公司生产经营业务相关的锌金属期货合约；

(2) 交易数量：2021 年公司锌金属套期保值总量计划 11.22 万吨，其中：中色锌业全年锌金属保值总量不超过 9.72 万吨，中色矿业全年锌金属保值总量不超过 1.5 万吨；

(3) 金额：套期保值业务保证金不超过人民币 13,000 万元；

(4) 合约期限：不超过 12 个月；

(5) 履约担保：以期货交易保证金方式担保；

(6) 交易杠杆倍数：12.5 倍以内；

(7) 流动性安排和清算交易规则：根据建立头寸所对应的每日结算价进行资金方面的准备，并按照期货交易所相应的结算价格或开平仓价格进行清算；

(8) 支付方式及违约责任：出现违约或者交易损失，按现金汇付结算。

4、套期保值的业务期限：自本次董事会审议通过后，于 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止；

5、资金来源：公司使用自有资金进行套期保值业务，不涉及使用募集资金或银行信贷资金。

二、本次套期保值业务的审议程序

2020年12月24日，公司第九届董事会第8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2021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。

三、本次套期保值业务的风险分析及风控措施

(一) 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套期保值业务管理办法》

并严格执行，子公司中色锌业和中色矿业也制定了相应的期货套期保值管理制度及实施细则，可以有效保证套期保值业务的顺利进行，并对风险形成有效控制。

2、公司成立了期货套期保值业务管理委员会，对公司范围内开展的期货套期保值业务履行监督管理职能。同时，子公司中色锌业和中色矿业也分别设立了相应的组织架构和业务流程决策制度，配备了投资决策、业务操作、风险控制等专业人员，并明确相应职责。

（二）开展套期保值业务的风险分析

公司开展期货套期保值业务不以投机为目的，主要为有效规避主要产品价格波动对公司带来的影响，风险等级较低，但同时也会存在一定的风险，具体如下：

1、价格波动风险：期货行情变动较大，可能产生价格波动风险，造成期货账户损失。

2、资金风险：期货交易采取保证金和逐日盯市制度，如投入金额过大，可能造成资金流动性风险，以及因未及时补足保证金被强行平仓而产生损失的风险。

3、技术风险：存在交易系统出现技术故障、系统崩溃、通信失败等，导致无法获得行情或无法下单的风险。

4、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。

5、信用风险：由于交易对手不履行合同而导致的风险。

6、政策风险：期货市场法律法规等政策如发生重大变化，可能引起市场波动或无法交易，从而带来风险。

（三）风险控制措施

1、将套期保值业务与公司生产经营相匹配，最大程度对冲价格波动风险。公司的期货套期保值业务只限于在上海期货交易所内且与公司生产经营相关的锌金属期货合约，不进行以逐利为目的的任何投机交易。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。

2、严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金，规范资金划拨和使用程序，严格履行保证金追加审批程序。

3、公司已选择与行业内资信好、业务实力强的期货经纪公司合作，避免发生信用风险。

4、根据深圳证券交易所等有关规定，结合公司实际情况，公司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、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，加强套期保值业务内部控制。

5、公司已设立符合要求的交易、通讯及信息服务设施，并具备稳定可靠的维护能力，保证交易系统的安全性和正常运行。

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。

四、开展套期保值业务对公司的影响

1、对公司生产经营的影响

通过开展期货套期保值业务，可以充分利用期货市场的套期保值功能，规避和防范主要产品价格波动给公司带来的经营风险，有利于公司的生产经营。

2、拟采用的会计政策及核算原则

公司将根据《企业会计准则第 22 号-金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 24 号-套期会计》对金融衍生品的公允价值予以确定。公司套期保值业务将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 and 结算价格预计能充分反映衍生品的公允价值。

五、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。

六、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套期保值业务管理办法》，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) 公司编制了《中国有色金属建设股份有限公司关于子公司开展期货套期保值业务的可行性分析报告》，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，有助于公司利用期货市场的套期保值功能，降低价格波动对公司的影响。我们同意公司2021年度开展期货套期保值业务。

一、 备查文件

- 1、第九届董事会第8次会议决议；
- 2、独立董事的独立意见；
- 3、公司《套期保值业务管理办法》。

特此公告。

中国有色金属建设股份有限公司董事会

2020年12月25日