

中信建投证券股份有限公司

关于云南铝业股份有限公司 2021 年度证券投资情况的核查意见

根据《深圳证券交易所股票上市规则》、深圳证券交易所《上市公司业务办理指南第 2 号—定期报告披露相关事宜》等有关法律法规和规范性文件的要求，中信建投证券股份有限公司（以下简称“中信建投证券”或“保荐机构”）作为云南铝业股份有限公司（以下简称“云铝股份”或“公司”）非公开发行股票的保荐机构，对 2021 年度证券投资情况进行了认真核查，现将核查情况说明如下：

一、公司证券投资情况概述

2012 年 7 月，公司以在香港注册成立的全资子公司云铝国际有限公司（以下简称“云铝国际”）为投资主体，作为基石投资者参与了在有色金属行业具备国际工程设计、施工、总承包能力的中铝国际工程股份有限公司（以下简称“中铝国际”）2012 年度 H 股发行，以 3.93 港元/股（不含佣金、征费等）交易价格认购了中铝国际 H 股股票 19,495,000 股，认购总价为 76,615,350 港元（不含佣金、征费等 772,282.73 港元）。

该事项经 2012 年 6 月 19 日召开的公司第五届董事会第十五次会议审议通过后实施完毕。

二、2021 年度证券投资损益情况

截止2021年度报告期末，公司全资子公司云铝国际持有中铝国际H股股票 19,495,000股，公司采用公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失确认为其他综合收益。截止2021年报告期末，公司证券投资的具体明细情况如下表：

单位：人民币元

证	最初投资	会	期初账面	本	计入权益的	本	本	报	期末账面
---	------	---	------	---	-------	---	---	---	------

券 简 称	成本	计 计 量 模 式	价值	期 公 允 价 值 变 动 损 益	累计公允价值 变动	期 购 买 金 额	期 出 售 金 额	告 期 损 益	价值
中 铝 国 际 H 股	62,727,444.14	公 允 价 值 计 量	22,644,160.42	0	-25,267,162.63	0.00	0.00	0.00	37,460,281.51
合 计	62,727,444.14	--	22,644,160.42	0	-25,267,162.63	0.00	0.00	0.00	37,460,281.51

三、报告期内证券投资内控制度执行情况

报告期内，公司严格执行中国证监会、深圳证券交易所相关证券投资的规定以及《公司章程》、《云南铝业股份有限公司证券投资管理辦法》等有关要求。

四、证券投资对公司的影响

公司全资子公司云铝国际持有中铝国际H股股票19,495,000股，公司采用公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失确认为其他综合收益。

五、独立董事的意见

经核查，公司2012年进行证券投资的资金来源于公司的自有资金，未影响公司主营业务的开展。公司严格按照相关法律法规、《公司章程》以及《云南铝业股份有限公司证券投资管理办法》等相关规章制度的要求进行证券投资，决策程序合法合规，内控制度严格落实，资金安全能够得到保障，未出现违反相关法律法规及规章制度的行为。

六、保荐机构核查意见

2021 年度，保荐机构通过资料审阅、现场检查、与管理层沟通等多种方式，对云铝股份 2021 年度证券投资情况及证券投资内控制度的合规性和有效性进行了核查。

中信建投证券认为：云铝股份 2021 年度证券投资情况不存在违反《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所上市公司规范运作指引》等相关法律法规及规范性文件规定的情形，符合《公司章程》《云南铝业股份有限公司证券投资管理办法》的规定，决策程序合法、合规，资金安全能够得到保障。

（本页无正文，为《中信建投证券股份有限公司关于云南铝业股份有限公司 2021 年度证券投资情况的核查意见》之签章页）

保荐代表人：_____

李彦芝

王逐原

中信建投证券股份有限公司

2022 年 3 月 21 日