

证券代码：002114

证券简称：罗平锌电

公告编号：2023-006

云南罗平锌电股份有限公司 关于控股子公司追加期货套期保值业务保证金额度的 公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

云南罗平锌电股份有限公司（以下简称“公司”）于2022年12月9日召开第八届董事会第十次（临时）会议，审议通过了关于《公司及控股子公司2023年开展期货套期保值业务》的议案（具体内容详见公司2022-092号公告），控股子公司云南胜凯锌业有限公司（以下简称“胜凯锌业”）根据该议案审议结果开展期货套期保值业务。

现由于胜凯锌业生产锌合金的主要原辅料锌、铝等产品价格受市场波动较大，叠加外部因素影响，原申请的保证金额度已不能完成保值数量，胜凯锌业向公司及其他股东提交申请，将期货套期保值业务保证金额度上限由3000万元人民币增至5000万元人民币，期货品种不变。

公司于2023年3月14日召开公司第八届董事会第十一次（临时）会议，审议通过了关于《控股子公司追加期货套期保值业务保证金额度》的议案。因胜凯锌业本次追加期货套期保值业务保证金的额度占公司最近一期经审计净利润的50%以上，且绝对金额超过五百万元人民币，公司根据《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第7号——交易与关联交易（2023年修订）》的要求，拟将本次审议事项提交股东大会进行审议。

一、交易概述

1、套期保值期货品种：锌、铝；

2、交易额度、期限及授权：自有资金额度上限5000万元人民币。保值头寸持有总量不超过买卖合同所签订数量。上述额度自公司股东大会审议通过之日起至2023年12月31日内有效，在审批期限内可循环使用，即任一时点的交易金额不超过上述额度。股东大会授权董事长及相关人士在上述额度范围内具体签署套期保值业务相关协议及文件。

3、资金来源：期货资金来源为胜凯铝业自有资金

二、套期保值的风险分析及风险控制措施

（一）风险分析

1、市场风险：市场发生系统性风险；期货和现货价格出现背离；期货合约流动性不足等。

2、资金风险：期货交易按照公司相关制度中规定的权限下达操作指令，如投入金额过大，资金可能存在流动性风险，甚至可能因不能及时补充保证金而被强行平仓，造成实际损失。

3、操作风险：公司在开展期货等衍生品交易业务时，如发生操作人员未按规定程序报备及审批，或未准确、及时完整地记录期货业务信息，将可能导致期货业务损失或丧失交易机会。

4、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。

（二）风控措施

1、保值方案经公司期货领导小组批准后由控股子公司严格执行。操作过程中做好指令单及保值记录单的制作报签，交易由监督部门监督检查。

2、期货操作品种仅限于本次审议的期货产品。

3、保值方案批准后，由控股子公司做好前期的上海期货交易所保值申报工作，计算保值资金，公司备足保证金，保证保值过程顺利完成。

4、交易过程按照《云南罗平锌电股份有限公司境内期货套期保值内部控制制度》以及保值方案执行，不得超范围操作，严禁投机操作。

5、操作过程中控股子公司做好市场跟踪，风险控制以及下单监督工作，防止市场波动及操作错误影响套期保值工作。

6、参与交易人员对公司保值方案、头寸信息严格保密。

三、套期保值业务控股子公司的影响

1、对控股子公司生产经营的影响

通过充分利用期货市场的套期保值功能，规避或减少由于商品价格发生不利变动引起的损失，降低商品价格不利变动对公司生产经营的影响。

2、对控股子公司财务的影响

公司将根据财政部发布的《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》及《企业会计准则第37号——金融工具列报》等相关规定，对套期保值业务进行相应的核算处理，反映财务报表相关项目。

在后续套期保值业务中，公司将按照《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第7号——交易与关联交易》证券投资与衍生品交易的相关要求开展套期业务、履行信息披露义务。

四、备查文件

- 1、第八届董事会第十一次（临时）会议决议；
- 2、云南胜凯锌业有限公司《关于申请增加套期保值保证金额度的请示》；
- 3、《关于云南胜凯锌业有限公司增加期货保证金额度》的会议纪要。

特此公告。

云南罗平锌电股份有限公司

董 事 会

2023年3月15日