

证券代码：600096

证券简称：云天化

公告编号：临 2018-099

云南云天化股份有限公司 关于子公司增加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。

2018 年 10 月 26 日，公司第七届董事会第三十七次会议审议通过了《关于子公司申请增加期货套期保值业务的议案》，本议案无需提交股东大会审议，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”）为公司的控股子公司，公司持有其96.6%的股权。

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。

2017年经审计的总资产927,251.59万元、净资产47,855.01万元，2017年实现营业收入2,617,872万元，净利润10,258.22万元。

二、开展期货套期保值的目的

由于目前农产品市场价格波动较大，对公司大豆、豆粕贸易影响较大，为减少进口大豆价格波动对公司造成的不确定性影响，联合商务计划增加对豆粕商品开展套期保值业务。

三、开展的期货套期保值交易情况

2018年3月21日，公司第七届董事会第二十六次会议审议通过了《关于子公司开展期货套期保值业务的议案》，详见上海证券交易所网站（<http://www.sse.com.cn>）公司2018-024号公告。

联合商务申请在上述套期保值方案中增加豆粕品种，豆粕期货持仓上限5.15万吨，期货保证金上限3,200万元。情况如下：

单位：万元、万吨

子公司	经营产品	公司实物交易全年总量	最高期货持仓数量	最高期货保证金额度	备注
联合商务	豆粕	5.15	4.63	3,200	平均价3,400元/吨，平均保证金率20%计

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

2018年10月27日