

宁波金田铜业（集团）股份有限公司 关于开展 2020 年度原材料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。

宁波金田铜业（集团）股份有限公司（以下简称“公司”）于 2020 年 5 月 19 日召开了第七届董事会第八次会议、第七届监事会第五次会议，分别审议通过了《关于公司开展 2020 年度原材料期货套期保值业务的议案》。为较好的规避铜价波动对公司经营业绩的影响，公司及其子公司拟继续以自有资金开展原材料套期保值业务，2020 年度拟投入的保证金最高余额不超过 30,000 万元，可循环使用，使用期限自公司 2019 年年度股东大会审议通过之日起至下一年度股东大会召开之日止。现将有关情况公告如下：

一、套期保值的目的

为了规避原材料价格波动对公司生产经营造成的潜在风险，充分利用期货的套期保值功能，减少因原材料价格波动造成的产品成本波动，公司拟在 2020 年度继续开展原材料期货套期保值业务。

二、原材料期货套期保值业务情况

1、原材料期货套期保值交易品种

公司及其子公司拟开展的原材料期货套期保值业务的品种只限于与公司生产相关的大宗商品原材料（包括但不限于电解铜、锌等），严禁进行以逐利为目的的任何投机交易。

2、预计投入资金额度及业务期间

2020 年度公司及其子公司拟以自有资金进行套期保值业务的保证金最高余额不超过人民币 30,000 万元，可循环使用，使用期限自公司 2019 年年度股东大会审议通过之日起至下一年度股东大会召开之日止。

3、资金来源

公司及其子公司的自有资金。

三、期货套期保值的风险分析

通过期货套期保值操作可以规避原材料价格剧烈波动对公司造成的影响，有利于公司的正常经营，但同时也可能存在一定风险：

1、市场风险：期货行情变动较大，可能产生价格波动风险，造成期货交易的损失；

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，可能资金存在流动性风险，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、技术风险：由于无法控制和不可预测的系统故障、网络故障、通讯故障等造成交易系统非正常运行，导致交易指令延迟、中断或数据错误等问题；

4、操作风险：期货交易专业性较强，复杂程度较高，存在操作不当或操作失败的可能，从而带来相应风险；

5、政策风险：由于国家法律、法规、政策变化以及期货交易所交易规则的修改和紧急措施的出台等原因，从而导致期货市场发生剧烈变动或无法交易的风险。

四、风险控制措施

1、套期保值的基本原则

在日常期货业务中，公司严格遵守套期保值的原则，且只针对公司业务相关的原材料期货产品进行操作。公司对铜行业的上下游经营情况、原材料价格走势、风险控制等方面均有较为深入的理解和丰富的经验，以保证每日原材料期货的持仓规模与现货、资金情况相适应。

2、严格的审批制度

公司制定了《套期保值管理制度》，对公司及子公司单日单次期货操作指令、单日期货累计指令设置了不同的审批权限。市场管理部、财务部、审计部分别对操作申请和相关风险进行监控。

3、规范的期货操作流程

公司的期货业务由专业的期货操作员进行操作，严格执行指令下达、交易软件操作、资金管理、财务和审计人员职责分离，确保所选择的产品结构简单、流动性强。当市场发生重大变化时，公司启动期货应急机制，能及时对市场变化做出有效反应。

4、其他风险控制措施

公司审计部不定期组织相关职能部门对各公司提供的基础数据进行抽查。当发现期货业务有关人员违反风险管理政策和风险管理工作程序、经纪公司的资信情况发生变化、交易员的交易行为不符合套期保值规范、公司期货头寸的风险状况影响到套期保值过程的正常进行等问题时，逐级向执行委员会、套期保值决策委员会汇报。

五、独立董事意见

独立董事认为：公司使用自有资金开展原材料期货套期保值业务，可减少因原材料价格波动带来的经营风险，符合公司和全体股东的利益。公司已制定《套期保值管理制度》，为公司从事原材料套期保值业务制定了具体操作规程。我们同意公司 2020 年度开展原材料期货套期保值业务，并同意提交公司 2019 年年度股东大会审议。

特此公告。

宁波金田铜业（集团）股份有限公司

董事会

2020 年 5 月 20 日