

云南罗平锌电股份有限公司

关于公司及控股子公司2021年度开展套期保值业务的公告

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2021年1月4日召开第七届董事会第十八次临时会议，审议通过了关于《公司及控股子公司2021年度开展套期保值业务》的议案，根据《深圳证券交易所股票上市规则》、《云南罗平锌电股份有限公司章程》、《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》的相关规定，公司及控股子公司拟针对在商品期货交易所交易的与公司生产经营相关的原料、产品等期货品种，利用期货工具开展商品期货套期保值业务，并在额度范围内授权期货领导小组实施等相关事项。根据《深圳证券交易所上市公司规范运作指引》等相关规定，该事项无需提交公司股东大会审议。

一、开展期货套期保值业务的概述

1、套期保值的目的

公司及控股子公司开展商品期货套期保值业务，主要为充分利用期货市场的套期保值功能，有效控制市场风险，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正常经营的影响，提升公司整体抵御风险能力，促进公司稳定健康发展。

2、套期保值交易品种

公司：锌、银

控股子公司云南胜凯锌业有限公司：铝、锌。

控股子公司云南锌隆胜亿实业发展有限公司：铜、铝、铅、锌、金、银。

3、投资金额及实施期限

公司及控股子公司套期保值保证金预计不超过7000万元人民币，其中公司保证金额度不超过5000万，控股子公司胜凯锌业和锌隆胜亿保证金额度分别不超过1000万。以上额度的使用期限自公司本次董事会审议通过之日起至2021年年度董事会召开前，在上述额度及决议有效期内，可循环滚动使用。

4、资金来源：自有资金

二、审议程序

本议案已经公司第七届董事会第十八次临时会议审议通过，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、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：公司及控股子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、公司将商品期货套期保值业务与公司生产经营情况相匹配，严格控制期货头寸，禁止进行期货投机交易。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，在市场剧烈波动时及时止损平仓规避风险。

2、公司规定了套保方案的设计原则并规定了套保方案的具体审批权限。期货交易员严格按照审批后的套保方案进行操作，并按规定编制期货交易报告并提交相关人员审核，同时建立异常情况及时报告制度，最大限度的规避操作风险的发生。

3、公司设立符合要求的计算机系统及相关设施，确保交易工作正常开展，当发生故障时，及时采取相应的处理措施以减少损失。

四、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。

五、独立董事意见

1、公司及控股子公司2021年度使用自有资金开展商品期货套期保值业务具有必要性，可以在一定程度上对冲主要原料及产品价格波动对公司经营造成的不良影响，维持经营业绩稳定。

2、公司及控股子公司已就开展商品期货套期保值业务建立了相应组织架构及《境内期货套期保值内部控制制度》，从制度上对套期保值的业务风险进行严格控制。

3、公司及控股子公司本次交易已履行相关法律法规、《公司章程》等制度规定的程序。开展的套期保值业务仅限于与公司生产经营相关的原料、产品等期货品种，不存在损害公司和全体股东利益的情况。

综上，我们同意该议案。

六、其他

根据《深圳证券交易所上市公司规范运作指引》的要求，后续如出现已交易衍生品的公允价值减值与用于风险对冲的资产（如有）价值变动加总，导致合计亏损或者浮动亏损金额每达到公司最近一年经审计的归属于上市公司股东净利润的10%且绝对金额超过人民币一千万元时公司将及时履行信披义务。如未出现上述情况，公司将在定期报告中，按照相关要求披露报告期内公司开展套期保值业务的相关情况。

七、备查文件

1. 第七届董事会第十八次临时会议决议；
2. 独立董事关于公司第七届董事会第十八次临时会议相关事项的独立意见；
3. 《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》。

特此公告。

云南罗平锌电股份有限公司

董 事 会

2021年1月5日