

（上接B061版）

4. 注册地点:云南省红河州蒙自经济技术开发区冶金材料加工区

5. 法定代表人:吴建勋

6. 注册资本:27,240.35万元人民币

7. 成立日期:2018年12月26日

8. 主营业务:有色金属化工产品及高新技术产品开发、生产(不含危险化学品);有色金属化工产品及高新技术产品销售(含危险化学品经营许可批准的氯化亚锡、四丁基锡、二丁基氯化锡、辛酸亚锡、二丁基二氯化锡、二丁基二月桂酸锡、二丁基氯化锡、三丁基氯化锡的销售其他未经许可的危险化学品除外);产品售后服务和技术支持;研发和开发同类产品的更新换代产品及其他新产品;化工工程设计及设备制造、安装、维修;有色金属及矿产品、非金属及矿产品、建筑材料、销售、代购、代销;环境保护工程服务;劳务服务、技术服务(依法须经批准的项目,经相关部门批准后方可开展经营活动)。

9. 股权结构:锡业股份持有100%的股权

10. 2021年12月末及2022年9月末的财务状况

单位:万元

| 序号 | 项目                                 | 2021年12月31日 | 2022年9月30日 |
|----|------------------------------------|-------------|------------|
| 1  | 资产总额                               | 105,277.33  | 109,192.06 |
| 2  | 负债总额                               | 49,979.66   | 27,496.56  |
| 3  | 银行借款总额                             | 0.00000     | 14,500.00  |
| 4  | 流动负债总额                             | 49,271.11   | 25,102.49  |
| 5  | 或有事项涉及的总<br>额(包括担保、质押、诉讼与仲裁事<br>项) | 0.00        | 0.00       |
|    | 资产负债率                              | 46.62%      | 31.01%     |
| 7  | 净资产                                | 56,296.67   | 81,527.71  |
| 8  | 营业收入                               | 179,076.77  | 191,790.37 |
|    | 利润总额                               | 12,380.20   | 6,496.49   |
| 10 | 净利润                                | 10,479.02   | 5,144.04   |

注:2021年度数据已经会计师事务所审计,2022年9月数据未经会计师事务所审计。

11. 经查询全国法院失信被执行人名单信息与查询系统,云南锡业锡化工材料有限责任公司不属于“失信被执行人”。

公司为锡化工公司上述30,000.00万元综合授信额度提供连带责任担保,申请额度及时间以银行最终批准为准。锡化工公司为公司的全资子公司,为其提供担保将有利于其生产经营活动的正常开展,公司存在的担保风险较小。

(三)云锡贸易(上海)有限公司

1. 公司名称:云锡贸易(上海)有限公司(以下简称“上海贸易公司”)

2. 统一社会信用代码:91310117332676816C

3. 公司类型:有限责任公司(自然人投资或控股的法人独资)

4. 注册地点:上海漕河泾开发区松江高科技园莘砖公路258号32幢1501室

5. 法定代表人:金小琳

6. 注册资本:100,000.00 万元人民币7. 成立日期:2015 年 04 月 24 日

8. 经营范围:一般项目:贵金属材料、电子产品、电子元器件、金银饰品、有色金属、金属材料及制品(除专控)、化工产品 & 原料(除危险化学品、监控化学品、烟花爆竹、民用爆炸物品、易制毒化学品)、玻璃制品、石英砂、白云石、石灰石的销售,废物或技术进出口(国家禁止或涉及行政审批的货物和技术进出口除外),有色金属领域内的技术开发、技术转让、技术咨询、技术服务,货运代理,仓储管理(除食品、危险品),商务咨询,电子商务(不得从事增值电信、金融业务),自有房屋租赁,成品油批发,原油批发。(除依法须经批准的项目外,凭营业执照依法自主开展经营活动)

9. 股权结构:锡业股份持有 100%的股权

10. 2021年12月末及2022年9月末的财务状况:

单位:万元

| 序号 | 项目                                 | 2021年12月31日  | 2022年9月30日   |
|----|------------------------------------|--------------|--------------|
| 1  | 资产总额                               | 51,025.68    | 57,088.06    |
| 2  | 负债总额                               | 9,462.69     | 16,171.16    |
| 3  | 银行借款总额                             | 0            | 0.00000      |
| 4  | 流动负债总额                             | 9,569.13     | 16,067.61    |
| 5  | 或有事项涉及的总<br>额(包括担保、质押、诉讼与仲裁事<br>项) | 10,170.34    | 10,170.34    |
|    | 资产负债率                              | 18.69%       | 28.15%       |
| 7  | 净资产                                | 35,482.69    | 41,216.89    |
| 8  | 营业收入                               | 2,223,546.40 | 1,434,686.04 |
|    | 利润总额                               | -6,253.44    | 2,137.80     |
| 10 | 净利润                                | -4,679.67    | 1,403.32     |

注:2021年度数据已经会计师事务所审计,2022年9月数据未经会计师事务所审计。

11. 经查询全国法院失信被执行人名单信息与查询系统,云锡贸易(上海)有限公司不属于“失信被执行人”。

公司为上海贸易公司上述11,000.00万元综合授信额度提供连带责任担保,申请额度及时间以银行最终批准为准。上海贸易公司为公司的全资子公司,为其提供担保将有利于其供应链贸易业务的正常开展,公司存在的担保风险较小。

(四)云锡(深圳)融资租赁有限公司

1. 公司名称:云锡(深圳)融资租赁有限公司(以下简称“深圳融资租赁公司”)

2. 统一社会信用代码:91440300MA5DJR0HXM

3. 公司类型:有限责任公司台港澳法人独资

4. 住所:深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

5. 法定代表人:岳敏

6. 注册资本:50,000万元

7. 成立日期:2016 年 8 月 24 日

8. 经营范围:融资租赁业务;租赁业务;贸易融资;向国内外购买租赁资产;租赁财产的残值处理及维修;租赁交易咨询和担保;兼营与主营业务相关的商业保理业务。(非银行融资类)。

9. 股权结构:本公司通过全资子公司云锡(香港)资源有限公司间接持有其100%的股权

10. 2021年12月末及2022年9月末的财务状况

单位:万元

| 序号 | 项目                                 | 2021年12月31日 | 2022年9月30日 |
|----|------------------------------------|-------------|------------|
| 1  | 资产总额                               | 31,572.02   | 27,423.64  |
| 2  | 负债总额                               | 69,230.03   | 10,023.03  |
| 3  | 银行借款总额                             | 2,328.40    | 2,300.00   |
| 4  | 流动负债总额                             | 69,230.03   | 10,023.03  |
| 5  | 或有事项涉及的总<br>额(包括担保、质押、诉讼与仲裁事<br>项) | 0.00        | 0.00       |
|    | 资产负债率                              | 52.88%      | 32.88%     |
| 7  | 净资产                                | 59,019.68   | 66,173.14  |
| 8  | 营业收入                               | 9,424.67    | 3,056.20   |
|    | 利润总额                               | 7,799.68    | 4,099.67   |
| 10 | 净利润                                | 6,838.40    | 3,193.30   |

注:2021年度数据已经会计师事务所审计,2022年9月数据未经会计师事务所审计。

11. 经查询全国法院失信被执行人名单信息与查询系统,深圳融资租赁公司不属于“失信被执行人”。

公司为深圳融资租赁公司上述20,000.00万元综合授信额度提供连带责任担保,申请额度及时间以银行最终批准为准。深圳融资租赁公司为公司的全资孙公司,为其提供担保将有利于其融资租赁业务的正常开展,公司存在的担保风险较小。

1. 云南锡业资源(美国)有限公司

1. 公司名称:云南锡业资源(美国)有限公司(以下简称“美国公司”)

2. 成立日期:2003 年 01月10日

3. 注册地点:美国加利福尼亚州

4. 法定代表人:金小琳

5. 注册资本:500万美元

7. 主营业务:进出口贸易

8. 股权结构:锡业股份持有 100%的股权

9. 2021年12月末及2022年9月末的财务状况

单位:万元

| 序号 | 项目                                 | 2021年12月31日 | 2022年9月30日 |
|----|------------------------------------|-------------|------------|
| 1  | 资产总额                               | 31,572.02   | 27,423.64  |
| 2  | 负债总额                               | 29,369.66   | 20,133.76  |
| 3  | 银行借款总额                             | 0           | 0          |
| 4  | 流动负债总额                             | 29,636.69   | 20,133.76  |
| 5  | 或有事项涉及的总<br>额(包括担保、质押、诉讼与仲裁事<br>项) | 0.00        | 0.00       |
|    | 资产负债率                              | 81.20%      | 72.62%     |
| 7  | 净资产                                | 5,168.37    | 7,289.89   |
| 8  | 营业收入                               | 16,022.34   | 94,076.33  |
|    | 利润总额                               | 879.06      | 411.10     |
| 10 | 净利润                                | 760.26      | 411.10     |

注:2021年度数据已经会计师事务所审计,2022年9月数据未经会计师事务所审计。

- 公司拟为云锡资源(美国)公司向包括但不限于中国工商银行、中国银行等银行申请开具累计不超过10,000.00万元人民币或等值美元国际备用信用证函保,期限一年。美国公司为公司的全资子公司,经营性质现金流稳定,为其提供担保将有利于其供应链贸易业务的正常开展,公司存在的担保风险较小。

(六)云锡(德国)资源有限公司

1. 公司名称:云锡(德国)资源有限公司(以下简称“德国公司”)

2. 成立日期:2004年 08月26日

3. 注册地点:德国杜塞尔多夫市

4. 法定代表人:金小琳

5. 注册资本:300万欧元

7. 主营业务:经营所有类别金属的贸易

8. 股权结构:锡业股份持有 100%的股权

9. 2021年12月末及2022年9月末的财务状况

单位:万元

| 序号 | 项目                                 | 2021年12月31日 | 2022年9月30日 |
|----|------------------------------------|-------------|------------|
| 1  | 资产总额                               | 31,220.32   | 22,266.04  |
| 2  | 负债总额                               | 29,367.19   | 20,078.12  |
| 3  | 银行借款总额                             | 0           | 0          |
| 4  | 流动负债总额                             | 29,196.36   | 19,303.66  |
| 5  | 或有事项涉及的总<br>额(包括担保、质押、诉讼与仲裁事<br>项) | 0.00        | 0.00       |
|    | 资产负债率                              | 97.68%      | 85.81%     |
| 7  | 净资产                                | 1,863.13    | 2,197.92   |
| 8  | 营业收入                               | 72,186.38   | 93,242.66  |
|    | 利润总额                               | 12.23       | 146.62     |
| 10 | 净利润                                | -107.78     | 140.00     |

注:2021年度数据已经会计师事务所审计,2022年9月数据未经会计师事务所审计。

- 公司拟为德国公司向包括但不限于中国工商银行、中国银行等银行申请开具累计不超过10,000.00万元人民币或等值欧元国际备用信用证函保,期限

一年。德国公司为公司的全资子公司,经营性质现金流稳定,为其提供担保将有利于其供应链贸易业务的正常开展,公司存在的担保风险较小。

(七)云锡(红河)投资发展有限公司

1. 公司名称:云锡(红河)投资发展有限公司(以下简称“红投公司”)

2. 统一社会信用代码:91532500351887176B

3. 公司类型:有限责任公司

4. 注册地点:红河综合保税区综合围网区C区1幢001号

5. 法定代表人:肖大明

6. 注册资本:10,000万元人民币

7. 成立日期:2015年08月27日

8. 经营范围:项目投资及管理、投资咨询;有色金属、贵金属及其制品、矿产品(除专控)、化工产品(除危险化学品)的销售;国际贸易、转口贸易、仓储物流;从事货物及技术进出口业务;贸易咨询、展览展示服务(依法须经批准的项目,经相关部门批准后方可开展经营活动)

9. 股权结构:锡业股份持有 100%的股权

10. 2021年12月末及2022年9月末的财务状况

单位:万元

| 序号 | 项目                                 | 2021年12月31日 | 2022年9月30日 |
|----|------------------------------------|-------------|------------|
| 1  | 资产总额                               | 12,326.00   | 46,773.62  |
| 2  | 负债总额                               | 1,642.86    | 34,897.66  |
| 3  | 银行借款总额                             | 1,000.00    | 1,000.00   |
| 4  | 流动负债总额                             | 1,642.87    | 34,897.66  |
| 5  | 或有事项涉及的总<br>额(包括担保、质押、诉讼与仲裁事<br>项) | 0.00        | 0.00       |
|    | 资产负债率                              | 13.33%      | 75.25%     |
| 7  | 净资产                                | 10,683.13   | 10,676.06  |
| 8  | 营业收入                               | 44,049.00   | 35,266.64  |
|    | 利润总额                               | 728.12      | 263.70     |
| 10 | 净利润                                | 546.36      | 190.32     |

注:2021年度数据已经会计师事务所审计,2022年9月数据未经会计师事务所审计。

11. 经查询全国法院失信被执行人名单信息与查询系统,云锡(红河)投资发展有限公司不属于“失信被执行人”。

公司为红投公司上述14,000.00万元人民币或等值美元综合授信额度提供连带责任担保,申请额度及时间以银行最终批准为准。红投公司为公司的全资子公司,为其提供担保将有利于其供应链贸易业务的正常开展,公司存在的担保风险较小。

三、担保协议的主要内容

上述担保均为公司为全资子公司(孙)公司提供连带责任担保,担保期限为1年,因被担保人均为公司全资子(孙)公司,不存在其他股东方提供担保的情形,也不存在反担保措施。上述担保相关协议尚未签署,本公司和上述被担保人将于股东大会审议通过与有关金融机构签订正式担保合同或协议,并根据担保合同或协议约定具体担保责任。

四、累计对外担保数量及逾期担保的数量

截至2023年1月11日,公司及控股子公司对外担保(含本次董事会审议的担保事项)累计为225,000万元,均为公司对下属全资子公司(孙)公司提供的担保,占公司最近一期经审计归属于上市公司股东净资产1,551,876.83万元的14.50%,公司及下属子公司不存在逾期对外担保、涉及诉讼的对外担保及因担保被判决败诉而面临担保损失的情形。

五、董事意见

1. 本次担保事项是为支持子(孙)公司发展,增强其综合实力,同时拓宽子(孙)公司融资渠道,满足其生产经营流动的资金需求;

2. 被担保对象均为锡业股份全资子公司(孙)公司,公司对其日常经营和重大事项决策具有绝对控制权,能够对其进行有效的管理和监督。且被担保对象经营稳定,未来能获得持续的现金流,具备较强的债务偿还能力,公司对其担保风险处于可控范围之内。

六、独立董事意见

公司对于子(孙)公司的担保有利于拓宽下属公司的融资渠道,促进其主营业务健康发展,被担保对象均为公司全资子(孙)公司,公司能够对其实施有效管控,风险可控。上述担保决策程序合法,本次担保不存在损害公司及广大投资者利益的情形,不存在与中国证监会《上市公司监管指引第8号——上市公司资金往来、对外担保的监管要求》(证监会公告〔2022〕26号)相违背的情形。我们一致同意公司本次对于(孙)公司的担保事项,并同意提交公司股东大会审议。

七、备查文件

1. 经与会董事签字并加盖董事会印章的《云南锡业股份有限公司第八届董事会第十次会议决议》;

2. 经与会监事签字并加盖监事会印章的《云南锡业股份有限公司第八届监事会第十次会议决议》;

3. 云南锡业股份有限公司独立董事关于第八届董事会第十次会议相关事项的独立意见。

特此公告

云南锡业股份有限公司

董事会

二〇二三年一月十二日

证券代码:000960 证券简称:锡业股份 公告编号:2023-005

## 云南锡业股份有限公司 关于开展远期外汇交易业务的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

特别提示:

1. 投资种类:远期外汇。

2. 投资金额:2023年开展远期外汇交易业务总规模累计金额不超过52,000万美元(按当期汇率折算成人民币355,160万元)。

3. 特别风险提示:在汇率行情变动较大的情况下,银行远期结汇汇率报价可能超出公司购汇时的实际汇率,超出远期汇率锁汇报价部分,可能造成预计外的汇兑损失。
- 云南锡业股份有限公司(以下简称“锡业股份”或“公司”)于2023年1月11日召开第八届董事会第十次会议和第八届监事会第十次会议,审议通过了《关于开展远期外汇交易业务的预案》,同意公司开展远期外汇交易业务,该事项尚需提交股东大会审议。现将公司拟开展远期外汇交易业务基本情况公告如下:

一、投资情况概述

(一)开展远期外汇交易业务的目的

公司外贸进出口业务主要采用美元进行结算,当汇率出现较大波动时,汇兑损益将影响公司的经营业绩。因此,开展远期外汇交易业务,加强公司的汇率风险管理,降低企业在外币营运环境中的汇率风险,成为企业稳定经营的迫切和内在需求。基于此,公司及子公司拟通过开展远期外汇交易业务,锁定未来时点的收汇和付汇的交易成本或收益,以规避汇率市场风险,从而降低汇率波动对公司进口原料采购和出口产品销售的经营风险。

(二)投资金额

根据公司生产经营计划,结合公司和子公司原料采购及产品出口相关计划开展,2023年拟开展远期外汇交易业务总规模累计金额不超过52,000万美元(按当期汇率折算成人民币355,160万元)。

(三)投资方式

1. 远期结售汇业务:公司与银行签订远期结售汇合同,约定将来办理结汇或售汇的外汇币种、金额、汇率和期限,到期后再按照该远期结售汇合同约定的币种、金额、汇率办理结汇或售汇的业务。

2. 外汇期权业务:公司与银行签订外汇期权合约,在规定的期间按照合同约定的执行汇率和其他约定条件,买入或者卖出外汇的选择权业务。

3. 掉期(包括利率和汇率掉期等):通过利率或者汇率互换,将利率固定或者汇率锁定。

4. 交易对手:公司及子公司开展外汇交易业务的对手方为银行等金融机构。

5. 流动性安排:所有外汇资金业务均对应正常合理的经营业务背景,与收付款时间相匹配,不会对公司的流动性造成重大不利影响。

(四)投资期限

公司开展远期外汇交易业务有效期限为经股东大会审议通过本事项之日起至2023年12月31日(以交易开始日期计算)。

(五)资金来源

公司及子公司外汇交易业务资金来源为自有资金或为进口产品办理外币贷款,不涉及募集资金。

二、开展远期外汇交易业务的审议程序

2023年1月11日,第八届董事会第十次会议及第八届监事会第十次会议审议通过了《关于开展远期外汇交易业务的预案》,同意开展远期外汇交易业务总规模累计金额不超过52,000万美元(按当期汇率折算成人民币355,160万元)。根据《深圳证券交易所股票上市规则》及《云南锡业股份有限公司章程》相关规定,上述事项尚需提交公司股东大会审议,本次开展远期外汇交易业务不涉及关联交易。

三、开展远期外汇交易业务的风险分析及风险控制

(一)风险分析

公司开展远期外汇交易业务遵循锁定汇率风险、套期保值的原则,不进行投机性、套利性的交易操作,在签订合同时严格按照公司预测收付款期限及金额进行交易。远期外汇汇锁定可以在汇率发生较大波动时,降低汇率波动对公司的影响,但远期外汇交易仍存在一定的风险:

1. 汇率大幅波动风险:在汇率行情变动较大的情况下,银行远期结汇汇率报价可能超出公司购汇时的实际汇率,超出远期汇率锁汇报价部分,造成预计外的汇兑损失。

2. 内部控制风险:远期外汇交易专业性较强,复杂程度较高,可能会由于内控制度不完善而造成风险。

3. 外币存款、借款和贷款过程中涉及的货币兑换风险。公司存款大部分是本土,归往外币存款前需将本土兑换成外币,或需将外币兑换成本土及其他货币,因为外币币种借款时的汇率一般不同于还款时的汇率,货币兑换过程中存在汇率变化的风险。

(二)风险控制措施

1. 参照各银行远期汇率结售汇价格,选择专业性较强的银行签订远期结售汇合同,并根据外币贷款期限约定将来办理购汇的人民币兑外币币种、金额、汇率以及交割期限。在开展远期汇率锁定业务期间收集整理汇率变动资料,提出规避汇率变动风险的建议。

2. 公司制定了《远期外汇交易业务管理制度》,对远期外汇交易业务的操作原则、审批权限、责任部门及责任人、内部操作流程、信息隔离措施、内部风险控制制度及风险处理程序、信息披露等做出明确规定,该制度满足实际操作的需要,风险控制措施是切实可行的。

3. 公司严格控制远期外汇交易规模,进行远期外汇交易必须基于公司的进出口业务,远期结汇合约的合计金额不得超过经公司股东大会审批的额度,将公司可能面临的风险控制在可承受范围内,若因实际需要超过股东大会事

批额度,公司将根据有关规定履行相应的决策程序。

四、本次开展远期外汇交易业务对公司的影响

公司及所属子公司根据《企业会计准则第22号—金融工具确认及计量》《企业会计准则第24号—套期会计》《企业会计准则第39号—公允价值计量》《企业会计准则第37号—金融工具列报》相关规定及其指南,对拟开展的远期外汇交易进行相应的核算和列报,反映资产负债表及损益表相关项目,公司对该业务的最终会计处理以负责公司审计的会计师事务所意见为准。

五、独立董事意见

为规避汇率波动对生产经营带来的影响,公司开展远期外汇锁定业务,该业务与公司日常经营需求紧密相关,符合有关法律、法规的规定。公司制定了《远期外汇交易业务管理制度》并严格执行,有利于加强远期外汇锁定业务的风险管理和控制。该预案决策程序符合《公司法》《深圳证券交易所股票上市规则》和《云南锡业股份有限公司章程》的规定。独立董事一致同意公司开展远期外汇交易业务并同意将该事项提请公司股东大会审议。

六、备查文件

1. 经与会董事签字并加盖董事会印章的《云南锡业股份有限公司第八届董事会第十次会议决议》;

2. 经与会监事签字并加盖监事会印章的《云南锡业股份有限公司第八届监事会第十次会议决议》;

3. 《云南锡业股份有限公司独立董事关于第八届董事会第十次会议相关事项的独立意见》;

4. 《云南锡业股份有限公司关于开展远期外汇交易业务的可行性分析报告》。

特此公告

云南锡业股份有限公司

董事会

二〇二三年一月十二日

证券代码:000960 证券简称:锡业股份 公告编号:2023-006

## 云南锡业股份有限公司 关于2023年度套期保值计划的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

重要提示:

1. 套期保值种类:云南锡业股份有限公司(以下简称“锡业股份”或“公司”)及下属子公司结合自身生产经营实际,拟针对公司自产和供应链业务,开展铜、铜、锌、铅、黄金、白银、铁矿石套期保值业务。

2. 公司提供套期保值业务任意时点保证金最高不超过人民币104,507万元(其中:人民币103,824万元,美元100万—按当期汇率折算成人民币汇总)。

3. 特别风险提示:公司开展套期保值业务可以部分规避现货价格波动对公司生产经营的影响,有利于公司稳健经营,但也可能存在市场风险、资金风险、操作风险、系统风险及政策风险,公司将积极落实风险控制措施,防范相关风险。

一、套期保值业务概述

(一)开展套期保值的目的和必要性

公司主要从事锡、铜、锌等有色金属的采选、冶炼、加工、销售及供应链业务,由于有色金属产品、原料和商品价格易受宏观形势、货币政策及产业供需等诸多因素的影响呈现较大波动,为规避有色金属价格波动对公司原料采购、产品销售、供应链业务的风险,同时减少因价格波动对公司正常生产经营业务的影响和冲击,公司拟于2023年对与生产经营业务相关的产品、原料及供应链商品开展套期保值业务,上述套期保值业务符合《企业会计准则》套期保值相关规定。

(二)套期保值业务任意时点最高保证金金额

公司使用自有资金并结合公司自产及供应链业务实际情况,提供套期保值业务任意时点保证金金额最高不超过人民币104,507万元(其中:人民币103,824万元,美元100万—按当期汇率折算成人民币汇总),在保值期限范围内可循环使用。

(三)开展套期保值业务的方式

| 保值品种 | 套期保值计划数量(符合套期保值要求) | 备注                   | 交易市场                | 有效期    | 资金来源               |
|------|--------------------|----------------------|---------------------|--------|--------------------|
| 铜    | 不超过7,000吨          | 含自产、冶炼加工进出口及供应链业务    | 上海期货交易所、LME         | 2023年度 | 自有资金、委托理财和自有资金信用额度 |
| 铜    | 不超过15,000吨         | 含自产及供应链业务及贸易         | 上海期货交易所             |        |                    |
| 黄金   | 不超过5000千克          | 含自产及供应链业务涉及黄金        | 上海期货交易所             |        |                    |
| 白银   | 不超过710吨            | 含自产、冶炼加工原料及供应链业务涉及白银 | 上海期货交易所、LMA、上海黄金交易所 |        |                    |
| 铝    | 不超过100,000吨        | 供应链业务涉及铝锭            | 上海期                 |        |                    |

开展套期保值业务原则:以现货需求为依据,严格进行套期保值交易,禁止投机交易,期货持仓量不得超过同期现货交易数量,期货持仓时间应与现货交易时间相匹配,连续12个月的套期保值头寸总量不得超出相应时期的套期保值额度。

二、审议程序

2023年1月11日,第八届董事会第十次会议和第八届监事会第十次会议审议通过了《云南锡业股份有限公司2023年度套期保值计划的预案》,同意公司及下属子公司在2023年度开展与生产经营和供应链相关产品的套期保值业务。

上述事项尚需提交公司股东大会审议,本次套期保值计划不涉及关联交易。

三、套期保值业务的风险分析、风控措施及可行性分析

(一)套期保值业务可能存在的风险分析

通过期货套期保值操作可以部分规避金属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:期货行情变动幅度较大,可能产生价格波动风险,造成期货套期保值损失。

2. 资金风险:期货交易按照公司相关制度中规定的权限下进行操作指令,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. 操作风险:由于期货及远期交易专业性较强,复杂程度较高,会存在因信息系统或内部控制方面的缺陷而导致交易损失的可能。

4. 系统风险:全球经济影响导致金融系统风险。

5. 信用风险:当价格出现对交易对方不利的大幅度波动时,交易对方可能违反合同的相关规定,取消合同,造成公司损失。

6. 政策风险:期货市场的法律法规政策如发生重大变化或交易对方违反相关法律法规可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失。

(二)公司进行期货套期保值的准备工作及风险控制措施

1. 针对套期保值业务,公司建立了完整的组织机构,制定了一套严格的期货套期保值管理制度以及相关业务操作流程、审批程序、风险控制措施得当,能确保该业务有效运行。

2. 公司设有套期保值委员会定期制定套保策略并由市场运营中心开展期货业务管理操作,明确相关人员的职责;公司将加强相关人员的专业知识培训,提高套期保值从业人员的专业素养。

3. 公司将套期保值业务与公司生产经营相匹配,严格控制套期保值头寸,并实施动态监管。

4. 在实际操作中,公司将严格控制套期保值的资金规模,合理计划和使用保证金,严格按照公司《期货套期保值管理办法》的规定下进行操作指令,根据审批权限进行对应的操作。公司将合理调拨资金用于套期保值业务。

5. 在业务操作过程中,公司将严格遵守国家有关法律法规的规定,防范法律风险,定期开展套期保值业务的规范性、内控机制的有效性、信息披露的真实性等方面进行监督检查。

6. 开展套期保值业务的可行性分析

公司开展套期保值业务,