

盛屯矿业集团股份有限公司 关于开展商品衍生品交易业务的公告

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。

盛屯矿业集团股份有限公司（以下简称“公司”）于2020年4月23日召开第九届董事会第五十三次会议，以7票赞成、0票反对、0票弃权审议通过了董事会《关于开展2020年商品衍生品交易业务的议案》。为规避大宗商品价格波动风险、提高盈利能力，公司及控股子公司商品衍生品业务的在手合约任意时点保证金不超过上一年度经审计的归属于母公司所有者权益的 20%（不含标准仓单交割占用的保证金规模），同时提请股东大会审议公司及其控股子公司连续12个月累计外汇套期保值交易金额可以超过上市公司最近一期经审计净资产的50%，上述额度有效期自公司2019年年度股东大会批准之日起至公司2020年年度股东大会召开日止。具体事宜参照公司《商品衍生品交易业务制度》执行。该议案尚需提交公司股东大会审议。

具体情况如下：

一、商品衍生品业务概述

公司及控股子公司2020年度开展的商品衍生品业务与公司资产及贸易业务的日常经营紧密相关，旨在规避大宗商品价格波动带来的经营风险、提高盈利能力。

1. 商品衍生品业务品种

公司及控股子公司开展的商品衍生品交易，包括期货、期权、掉期等产品或上述产品的组合；衍生品的基础资产主要包括上海期货交易所、大连商品期货交易所、郑州商品期货交易所、上海黄金交易所、无锡不锈钢电子交易中心、伦敦

金属交易所、纽约商品交易所、伦敦金银市场协会、香港交易所等中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的产品；公司交易品种主要为与公司产业布局相关的有色金属和贵金属品种。

2. 商品衍生品业务规模

根据公司及控股子公司风险控制和经营发展需要，提请授权公司及控股子公司商品衍生品业务的在手合约任意时点保证金不超过上一年度经审计的归属于母公司所有者权益的20%（不含标准仓单交割占用的保证金规模），本额度在公司2019年年度股东大会批准之日起至公司2020年年度股东大会召开日止。

3. 资金来源

交易本金既可采用自有资金保证金或担保、抵押进行杠杆交易，也可采用无担保、无抵押的授信额度交易；既可采取实物交割，也可采取现金价差结算。

二、开展商品衍生品业务的必要性

大宗商品受市场供求、地缘政治、行业周期、利率、汇率变动等多种因素作用，价格波动频繁。随着市场经济活动复杂性、透明性的增强，公司从事大宗商品业务的价格管理、风险管理、丰富盈利模式的重要性日益显现。

公司经过多年对大宗商品市场研究的积累，利用商品衍生品工具防范价格波动风险，延伸公司生产及贸易业务收益，有利于公司生产及贸易业务的可持续发展。

三、开展商品衍生品业务的操作规范

1. 公司商品衍生品交易行为主要以正常经营业务为基础，以具体经营业务为依托，以套期保值为主要手段，以规避和防范商品价格风险为主要目的。

2. 公司进行商品衍生品业务只允许与具有商品衍生品业务经营资格的金融机构进行交易，不得与前述金融机构之外的其他组织或个人进行交易。未经公司同意不得开展商品衍生品业务。

3. 公司以其自身名义设立商品衍生品业务交易账户，不得使用他人账户进行商品衍生品交易业务。

4. 公司使用与商品衍生品业务保证金相匹配的自有资金，不使用募集资金直接或间接进行商品衍生品交易业务，且严格按照审议批准的商品衍生品业务，控制资金规模，不影响公司正常经营。

5. 公司进行商品衍生品交易业务必须注重风险防范,坚持风险控制与具体操作相互分离的原则。

四、开展商品衍生品业务的风险分析

1. 市场风险:受衍生品市场相关因素影响,衍生品价格的波动时间与波动幅度与现货价格并非完全一致。相关业务在期现损益对冲时,可能获得额外的利润或亏损。在极端情况下,政策风险或非理性的市场可能出现系统性风险,造成交易损失。

2. 流动性风险:衍生品业务根据公司规定权限下达资金调拨和操作指令,如市场价格波动过于激烈,或是在手业务规模过大,均有可能导致因来不及补充保证金而被强行平仓所产生的损失。

3. 技术及内控风险:由于商品衍生品业务专业性较强,复杂程度较高,会存在因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或内部控制方面缺陷而导致意外损失的可能。

4. 政策及法律风险:因相关法律制度发生变化或交易对手违反相关法律制度或合同约定,造成合约无法正常执行而给公司带来损失。

五、开展商品衍生品业务的风险管理策略

公司及控股子公司的商品衍生品业务计划是根据市场及实际经营情况制定,并严格按照相关规定对业务各环节进行相应管理。

1. 选择正规衍生品交易所交易,选择具有良好资信和业务实力的衍生品经纪公司、银行作为交易通道。

2. 构建专门的衍生品交易决策机制,指定专人负责衍生品交易及管理,严格按照相应管理规定履行计划安排、协调配合、金额审批、指令下达等行为,同时加强相关人员的专业知识培训,提高从业人员的专业素养。当商品市场发生剧烈波动时,交易部门及时进行分析,并将有关信息及时上报商品衍生品业务领导小组及相关人员,由领导小组决策后下达操作指令。交易部门按照商品衍生品业务领导小组要求实施具体操作并随时跟踪业务进展情况。

3. 制定并执行严格的止盈止损机制,严格控制保证金头寸和持仓头寸。

4. 在业务操作过程中，严格遵守国家有关法律法规的规定，防范法律风险，定期对衍生品业务的规范性、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。

六、开展商品衍生品业务的会计政策和核算原则

公司及控股子公司开展的衍生品业务品种在国内外公开市场交易，透明度高，成交活跃，流动性强，信用风险小，成交价和结算价可以充分反映衍生品的公允价值。

公司根据《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37号——金融工具列报》及《企业会计准则第24号——套期会计》等相关规定，对商品衍生品业务进行相应核算和披露。

七、独立董事意见

董事会审议的关于开展2020年商品衍生品交易业务事项符合我国相关法律法规的规定，表决程序合法、有效。公司已根据有关法律法规并结合公司实际情况建立了公司《商品衍生品交易业务管理制度》，规范了相对应的业务流程。本次商品衍生品交易业务的展开于公司日常经营紧密相关、符合公司利益需要，有利于减少、规避大宗商品现货波动等形成的风险，提高盈利能力。不存在损害公司及股东，特别是中小股东利益的情形。公司已履行了必要的审批程序。

特此公告。

盛屯矿业集团股份有限公司

董事会

2020年4月25日