

内蒙古兴业矿业股份有限公司 关于 2023 年度开展期货套期保值 交易业务的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

重要内容提示：

1、内蒙古兴业矿业股份有限公司（以下简称“公司”）及控股子公司将开展与生产经营和贸易业务相关产品的套期保值业务。

2、本次期货套期保值业务拟投入的保证金不超过人民币 50,000 万元（含 50,000 万元）。

3、公司于 2023 年 2 月 3 日召开第九届董事会第十五次会议，审议通过了《关于 2023 年度开展期货套期保值交易业务的议案》，同意公司及控股子公司在 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日期间使用自有资金不超过人民币 50,000 万元（含 50,000 万元）保证金开展与公司生产经营和贸易业务相关的期货套期保值业务，并授权公司管理层在此授权范围内根据公司业务情况、实际需要择机开展套期保值业务。根据《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 7 号——交易与关联交易（2023 年修订）规定》等相关规定，本议案尚需提交公司股东大会审议。该事项不属于关联交易，无需履行关联交易表决程序。

4、开展期货套期保值交易业务可以规避和防范主要产品价格波动给公司带来的经营风险，有利于公司稳健经营，但也可能存在市场风险、流动性风险、内部控制风险、技术风险、政策风险，公司将积极落实风险控制措施，防范相关风险。

一、开展期货套期保值业务概述

（一）开展期货套期保值业务的目的及必要性

公司主要从事贵金属、有色金属、黑色金属矿采选及金属贸易业务，为规避和减少现货产品价格剧烈波动给公司生产经营带来的不确定性和经营风险，锁定预期利润或降低因现货价格下跌造成的损失，保证日常生产经营能够平稳有序的进行，公司有必要利用好这个价格风险管理工具，增强核心竞争力。

（二）拟投入保证金金额

本次期货套期保值业务任意时点保证金最高不超过人民币 50,000 万元（含 50,000 万元），上述额度在有效期内可循环使用。具体根据公司计划产量或贸易业务确定套期保值头寸数量，在风险可控的程度内进行交易操作。

（三）开展期货套期保值业务的主要内容

- 1、交易品种：开展与公司生产经营和贸易业务涉及的相关期货品种。
- 2、持仓量：期货持仓与同期现货交易总量相匹配，最大净头寸不超过公司全年产量的 40% 或贸易总量。
- 3、拟进行套期保值的期间：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日。
- 4、交易场所：上海期货交易所及国内其他交易所。
- 5、交易规则：采用国家法律法规及各交易所的相关交易规则。

（四）资金来源

公司将使用自有资金以保证金的形式进行期货套期保值业务。

二、期货套期保值履行的审议程序

公司于 2023 年 2 月 3 日召开第九届董事会第十五次会议，审议通过了《关于 2023 年度开展期货套期保值交易业务的议案》。根据《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 7 号——交易与关联交易（2023 年修订）规定》等相关规定，本议案尚需提交公司股东大会审议。该事项不属于关联交易，无需履行关联交易表决程序。

三、开展期货套期保值业务的可行性分析

公司及控股子公司本次开展期货套期保值业务，是以规避和防范主要产品价格波动给公司带来的经营风险，降低主要产品价格波动对公司的影响为目的。公

司制定了《内蒙古兴业矿业股份有限公司期货保值交易业务管理制度》（内容详见公司于2014年7月1日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)披露的《兴业矿业：期货保值交易业务管理制度（2014年6月）》），对套期保值业务额度、套期保值业务品种范围、审批权限、责任部门及责任人、内部风险报告制度及风险处理程序等作出明确规定，能够有效保证套期保值业务的顺利进行，并对风险形成有效控制。同时，公司配备了相关专业人员开展具体工作，且公司具有与拟开展套期保值业务保证金相匹配的自有资金。公司及控股子公司将严格按照《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第1号——主板上市公司规范运作》和公司内部控制制度的有关规定，落实风险防范措施，审慎操作。

四、开展期货套期保值业务的风险分析

公司及控股子公司开展期货套期保值业务以套期保值为目的，主要为有效规避主要商品价格波动对公司带来的影响，但同时也会存在一定的风险，具体如下：

1、市场风险：期货市场行情变化较快，可能会发生期货价格与现货价格走势背离或市场大幅波动等风险。在极端行情下，期货价格若频繁的触及涨、跌停板，期货交易或将失去连续性，而被交易所强制平仓，将导致公司部分期货头寸提前了结，失去套保作用，重新面对现货市场价格波动风险。

2、流动性风险：（1）市场流动性风险：在套期保值交易中，受市场流动性不足的限制，可能会使公司不能以有利的价格进出套期保值交易市场。（2）资金流动性风险：期货交易采取保证金和逐日盯市制度，如行情急剧变化，可能造成资金流动性风险，甚至因为来不及补充保证金而被强行平仓带来实际损失。

3、内部控制风险：期货交易专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内控体系不完善造成的风险。

4、技术风险：由于无法控制和不可预测的系统、网络、通讯等故障，造成交易系统非正常运行，导致交易指令延迟、中断等问题，从而带来相应风险。

5、政策风险：期货市场法律法规等政策如发生重大变化，可能引起市场波动或无法交易，从而带来相应风险。

五、公司采取的风险控制措施

1、将套期保值业务与公司生产经营相匹配，最大程度对冲产品价格波动风险，严格审批交易。公司严格控制期货交易的种类，套期保值业务限于场内交易。公司开展套期保值业务，以保障生产经营为前提，杜绝一切投机为目的的交易行为。

2、公司将重点关注期货交易情况，合理选择合约月份，避免市场流动性风险。公司将控制套期保值的资金规模，合理调度自有资金用于期货套期保值业务。按照公司期货保值交易业务管理制度等相关制度规定下达操作指令，进行套期保值操作。同时，加强内部审计监督，有效防范风险。

3、建立符合要求的计算机系统及相关设施。公司建立符合要求的计算机系统及相关设施，并具备稳定可靠的维护能力，保证交易系统的安全性和正常运行。当发生故障时，及时采取相应的处理措施以减少损失。同时公司严格甄选合格的期货经纪公司，保证交易渠道通畅。

4、公司制定了《内蒙古兴业矿业股份有限公司期货保值交易业务管理制度》对套期保值额度、品种范围、审批权限、业务管理、财务核算、风险管理、信息披露等作出了明确规定。公司将严格按照内部控制制度的规定对各个环节进行控制。

5、密切关注国家及行业监管机构相关政策，紧跟市场步伐，及时合理的调整套期保值方案与思路，最大限度降低市场政策风险。

六、期货套期保值业务的会计政策

公司将根据《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 24 号-套期会计》等规定对套期保值业务进行相应的会计处理，反映财务报表相关项目。

七、开展期货套期保值业务对公司的影响

公司及控股子公司通过开展期货套期保值业务，可以充分利用期货市场的套期保值功能，规避主要商品价格波动对公司带来的影响，有利于公司的生产经营。

八、期货套期保值业务后续信息披露

1、公司若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 1000 万人民币的,公司将及时披露。

2、公司将在定期报告中对已开展的衍生品投资相关信息予以披露。

九、独立董事独立意见

公司及控股子公司开展期货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。公司已制定《内蒙古兴业矿业股份有限公司期货保值交易业务管理制度》,明确了审批流程、风险防控和管理等内部控制程序,对公司控制期货风险起到了保障的作用。公司及控股子公司开展套期保值业务,能有效规避和防范主要产品价格波动给公司带来的经营风险,充分利用期货市场的套期保值功能,降低价格波动对公司的影响。我们认为,公司及控股子公司开展期货套期保值业务不存在损害公司及全体股东的利益,同意公司及控股子公司开展期货套期保值交易业务。

十、备查文件

- 1、公司第九届董事会第十五次会议决议;
- 2、独立董事关于第九届董事会第十五次会议相关事项出具的独立意见。

特此公告。

内蒙古兴业矿业股份有限公司董事会

二〇二三年二月四日