

证券代码：600096

证券简称：云天化

公告编号：临 2023-015

云南云天化股份有限公司 关于公司及子公司开展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法律责任。

2023年2月27日，公司第九届董事会第十次（临时）会议审议通过了《关于公司及子公司开展期货套期保值业务的议案》，该议案无需提交股东大会审议，现将相关情况公告如下：

一、开展期货套期保值业务子公司的基本情况

公司及公司全资子公司云南水富云天化有限公司（以下简称“水富云天化”）、云南云天化商贸有限公司（以下简称“云天化商贸”）、重庆云天化天聚新材料有限公司（以下简称“天聚新材”）、云南云天化联合商务有限公司（以下简称“联合商务”）、云南云天化农资连锁有限公司（以下简称“农资连锁”）计划开展期货套期保值业务，各子公司基本情况如下：

公司名称	注册地点	经营范围	公司持股比例	主要财务指标
水富云天化	云南省水富市云富街道办事处云天大道 37 号	化肥原料、化工原料、有机化工产品、电子材料、车用尿素、硫酸、工业气体，危险化学品经营；煤炭经营；货物或技术进出口等。	公司持股 100%	截至 2022 年 9 月 30 日，水富云天化未经审计的总资产 506,122.36 万元、净资产 272,112.59 万元，2022 年 1-9 月实现营业收入 240,976.92 万元，净利润 42,723.72 万元。
云天化商贸	云南省昆明市滇池路 1417 号	化肥、农副产品、化工产品及其材料，饲料、农具、农膜、农用机械、粮食的销售，粮食收购，散装食品的批发兼零售，农业技术开发服务等。	公司持股 100%	截至 2022 年 9 月 30 日，云天化商贸未经审计的总资产 139,295.08 万元、净资产 21,198.10 万元，2022 年 1-9 月实现营业收入 548,439.76 万元，净利润 2,219.35 万元。

公司名称	注册地点	经营范围	公司持股比例	主要财务指标
天聚新材	重庆市长寿区经济技术开发区化南路3号	危险化学品生产；票据式经营；硫酸、氨（压缩的或液化的）、氧（压缩的或液化的）、氮（压缩的或液化的）、甲醇、甲醛溶液生产和销售等。	公司持股100%	截至2022年9月30日，天聚新材未经审计的总资产146,845.21万元、净资产91,791.22万元，2022年1-9月实现营业收入122,669.83万元，净利润36,941.69万元。
联合商务	云南省昆明市滇池路1417号	国际贸易；国际经济技术合作；国内贸易、物资供销；化肥进出口经营；贵金属经营；物流方案设计；铁路运输；物流信息咨询；普通货物运输经营；道路货运代理（代办）；仓储服务等。	公司持股100%	截至2022年9月30日，联合商务未经审计的总资产1,534,696.25万元、净资产172,326.62万元，2022年1-9月实现营业收入3,688,583.23万元，净利润31,538.60万元。
农资连锁	云南省昆明市滇池旅游度假区金柳路11号	化肥、农药、农膜、不再分装的包装种子、饲料及添加剂、农业机械、非金属矿及制品、金属矿及制品等销售；粮食收购；煤炭批发经营；国内贸易、物资供销；货物及技术的进出口业务等。	公司持股100%	截至2022年9月30日，农资连锁未经审计的总资产320,279.81万元、净资产85,802.70万元，2022年1-9月实现营业收入1,230,648.28万元，净利润10,790.58万元。

二、开展期货套期保值的目的

公司全资子公司水富云天化涉及自产甲醇产品；全资子公司云天化商贸涉及采购主要原料动力煤；公司全资子公司天聚新材对外采购甲醇作为聚甲醛产品原料；公司全资子公司联合商务开展大豆、油脂（棕榈油、豆油、菜籽油等）、豆粕等品种的贸易业务和玉米深加工业务；公司全资子公司农资连锁为公司尿素产品的销售公司。

以上涉及原料、产品、商品贸易的价格波动，对公司生产成本控制、自产产品盈利水平和贸易业务的利润实现造成较大影响。为此，在不影响正常经营并确保资金安全的基础上，公司与子公司通过开展期货套期保值业务，锁定原材料和产成品价格，减少相关产品价格波动对公司业绩造成的不确定影响，保障公司经营的平稳性。

三、开展期货套期保值交易情况

公司	经营产品	最高期货持仓数量（万吨）	最高期货保证金额度（万元、万美元）
公司及全资子公司水富云天化、天聚新材、云天化商贸	甲醇	5.00 （天聚新材）	8,580
		6.00 （水富云天化）	
	动力煤	20.00	12,600
小计			21,180
公司全资子公司联合商务	大豆	76.00	\$7,700
	豆粕	72.00	56,000
	油脂	18.00	35,800
	玉米	18.00	10,000
小计			154,160
公司全资子公司农资连锁	尿素	20.00	15,000
合计	--	--	190,340

- 备注：1. 人民币兑美元汇率按 6.80 元计算；
2. 所涉及期货品种可能限仓和提高保证金比例；
3. 确定进行实际交割时不进行止损操作；
4. 交割时支付的货款不计入保证金范围内；
5. 油脂包含豆油、棕榈油、菜籽油等品种。

同时，为有效降低期货风险，公司拟适时以上述品种对应的期权为工具，开展对以上品种期货交易的风险对冲。上述品种对应的期权交易额度不得超出期货持仓额度，其期权交易费用包含在上表的“最高期货保证金额度”内。

四、期货套期保值交易有效期

本方案有效期为董事会审议通过后 12 个月。

五、风险控制措施

（一）严格执行公司《期货套期保值业务管理制度》相关规定，并在董事会审议通过的年度方案权限内办理公司期货套期保值业务；

（二）公司进行的商品期货套期保值业务遵循锁定对应商品价格风险、套期保值原则，坚决不做投机性、套利性的交易操作；

（三）建立严格内部风险报告制度，制定对应的风险监控方案，形成高效的风险监控预警制度，以及风险测算体系；

（四）建立有效的内控制度，专业人员针对不同产品的实际情况制定交易策略，由期货套期保值业务工作小组会议审议通过决策方案；

（五）强化监督检查机制，对期货套期保值业务的制度执行和风险控制措施由公司总部实施监督检查，严格进行考核。

六、独立董事独立意见

公司及子公司开展期货套期保值业务有利于有效防范市场风险，对冲现货成本，促进自身长期稳健地发展，公司已建立较为完善的《期货套期保值业务管理制度》，形成了较为完整的风险管理体系，该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。我们认为公司应加强对市场的判断分析，提升市场分析操作准确性，根据经营需求严格按照相关规定进行期货套期保值操作，并确保有效防范期货套期保值业务风险。

独立董事对《关于公司及子公司开展期货套期保值业务的议案》发表同意的独立意见。

特此公告。

云南云天化股份有限公司

董事会

2023年2月28日