

证券代码：601899 股票简称：紫金矿业 编号：临 2018-010

## 紫金矿业集团股份有限公司

### 关于开展2018年度外汇风险管理交易业务的公告

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。

紫金矿业集团股份有限公司(以下简称“本公司”或“公司”)于2018年1月23日召开第六届董事会2018年第1次临时会议，审议通过《关于开展2018年度外汇风险管理交易业务的议案》。随着公司国际化业务拓展及公司生产经营需求，为有效化解公司外币资产和负债面临的汇率或利率等风险，降低利率汇率波动对公司利润的影响，结合外汇市场的变动趋势，公司拟开展外汇衍生品交易业务，具体如下：

#### 一、外汇衍生品交易业务范围

公司拟开展的外汇衍生品业务包括以下范围：包括但不限于远期、掉期、期权、货币互换、利率互换等。业务期限不超过3年，超过3年需上报集团公司金融业务指导小组审批。

#### 二、外汇衍生品交易额度和授权期限

公司开展外汇衍生品交易是以满足日常生产经营和海外并购需要，以及防范利率汇率风险为前提，依照公司外币资产、负债风险敞口规模以及谨慎预测原则，在授权有效期内，非贸易项下的外汇衍生品交易持仓金额不超过5亿美元或等值外币，占公司2016年度经审计归母净资产的11.5%，无需经公司股东大会审议批准；贸易项下根据实际贸易业务做好汇率风险控制。授权期限自2018年1月1日起至新一年度授权作出为止。

#### 三、开展外汇衍生品交易业务的风险分析

(一) 市场风险：在汇率或利率行情走势与公司预期发生大幅偏离的情况下，公司锁定汇率或利率成本后支出的成本支出可能超过不锁定时成本支出，从而造成潜在损失。

(二) 内部控制风险：外汇衍生品交易业务专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内部控制机制不完善而造成风险。

(三) 回款预测风险：公司通常根据采购订单、客户订单和预计订单进行付款、回款预测，但在实际执行过程中，供应商或客户可能会调整自身订单和预测，造成公司回款预测不准，导致已操作的外汇衍生品延期交割风险。

(四) 法律风险：因相关法律发生变化或交易对手违反相关法律制度可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失。

#### **四、开展外汇衍生品交易的风险控制**

(一) 公司不进行以投机为目的的外汇衍生品交易，所有外汇衍生品交易业务均以正常生产经营为基础，以规避和防范汇率或利率风险为目的。

(二) 公司已制定《资金管理办法》、《紫金矿业集团资本投资有限公司外汇交易管理办法》和《紫金矿业集团资本投资有限公司外汇交易操作细则》，对外汇衍生品交易业务风险控制、审批程序、后续管理等方面做了详尽的规定，有效防范外汇衍生品交易业务风险。

(三) 公司金融业务指导小组在董事会授权范围内对外汇衍生品交易业务进行决策，公司计划财务部负责对外汇衍生品交易进行监督指导，公司下属全资子公司紫金矿业集团资本投资有限公司作为外汇衍生品交易的主办企业，对非贸易项下的汇率风险敞口进行套保。

(四) 公司仅与具有合法资质的大型商业银行开展外汇衍生品交易业务，密切跟踪相关领域的法律法规，规避可能产生的法律风险。

(五) 公司独立董事、监事会有权对外汇衍生品交易业务开展情况进行监督与检查，必要时可以聘请专业机构进行审计。

#### **五、会计政策及核算原则**

公司根据《企业会计准则》等相关规定及其指南，对外汇套期保值业务进行相应核算和披露。

#### **六、备查文件目录**

(一) 第六届董事会2018年第1次临时会议决议。

特此公告

紫金矿业集团股份有限公司

董 事 会

二〇一八年一月二十四日