证券代码：601899 股票简称：紫金矿业 编号：临 2024-028

紫金矿业集团股份有限公司
关于子公司开展期货及衍生品交易的公告

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。

重要内容提示：
 交易目的：为充分发挥紫金矿业集团股份有限公司（以下简称“公司”）金
融板块与主业的协同作用，降低公司跨境投资及产业链投资涉及的市场波动风险，
在不影响公司正常经营及风险有效控制的前提下，公司拟授权金融板块的下属企
业使用部分闲置自有资金开展期货及衍生品交易业务，获取一定投资收益，提高资
金使用效率，为公司及股东创造更大的利益。
 审批程序：公司第八届董事会第六次会议审议通过，该事项尚需提交公司
股东大会审议批准。
 特别风险提示：公司子公司开展期货和衍生品交易业务始终以降低价格、
汇率、利率等波动风险为目标，将风险控制放在首位，同时获取一定投资收益，但
业务开展过程中依然会存在市场风险、操作风险、资金风险、内部控制风险、技术
风险等其他风险等因素的影响，敬请广大投资者注意投资风险。

一、交易情况概述
（一）交易目的
为充分发挥公司金融板块与主业的协同作用，降低公司跨境投资及产业链投
资涉及的市场波动风险，在不影响公司正常经营及风险有效控制的前提下，公司拟
授权金融板块的下属企业使用部分闲置自有资金开展期货及衍生品交易业务，获

取一定投资收益，提高资金使用效率，为公司及股东创造更大的收益。
（二）交易金额
公司授权金融板块的下属企业使用不超过人民币 3 亿元及不超过 1 亿美元或
等值外币的交易保证金、权利金等进行其他期货和衍生品业务，亏损限额最高为
3,000 万元及 500 万美元或等值外币。投资范围包括：挂钩境内外股票、大宗商品、

自公司 2023 年年度股东大会审议通过之日起至 2024 年年度股东大会召开之
日止。
（六）实施主体
根据业务实施情况，实施主体为公司金融板块的下属企业。
二、审议程序
公司于 2024 年 3 月 22 日召开第八届董事会第六次会议，审议通过了《关于
子公司开展期货和衍生品交易业务的议案》，该事项尚需提交公司股东大会审议批
准。
三、交易风险分析
公司进行期货和衍生品交易始终以降低价格、汇率、利率等波动风险为目标，
将风险控制放在首位，同时获取一定投资收益，但同时由于期货和衍生品交易的特
性，业务开展过程中依然会存在一定的风险,主要如下：
（一）市场风险
受国内外经济政策和形势、汇率和利率波动、证券市场波动等多种因素影响，
交易标的市场价格产生较大波动时，公司的资金安全及收益存在一定的不确定性。
公司将根据经济形势以及金融市场的变化适时适量的介入。
（二）流动性风险
投资产品的赎回、出售及投资收益的实现受到相应产品价格因素影响，需遵守
相应交易结算规则及协议约定，相比于货币资金存在着一定的流动性风险；当公司
没有及时补足保证金时，可能会被强制平仓而遭受损失。
（三）信用风险
开展金融衍生品业务存在合约到期无法履约造成违约而带来的风险。公司将
审慎选择交易对手和金融衍生产品，与具有合法资质的金融机构开展金融衍生品
交易业务，最大程度降低信用风险。
（四）操作风险
金融衍生品交易业务专业性较强，复杂程度较高，在开展交易时，如操作人员

未按规定程序进行交易操作或未能充分理解投资产品信息，将带来操作风险。
（五）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、风险控制措施
（一）公司及子公司以国家金融监管法律法规为规范发展依据，坚持审慎投资
原则，加强市场分析和研究，遵守大类资产组合配置原则，搭建完整的风险管理组
织架构，开展全面风险管理工作。公司已建立较为完善的期货和衍生品流程，公司
及子公司有权机构将严格在股东大会授权范围内对期货和衍生品交易业务进行决
策。
（二）公司及子公司已制定《大宗商品套期保值管理办法》《资金管理办法》
《套期保值实施细则》《全面风险管理制度》及各项工作管理制度与业务管理等制
度，详尽规定期货和衍生品业务风险控制、审批程序、后续管理等，严格执行投资
工作规则和止损机制，合理计划和使用保证金，有效防范交易业务风险。公司已配
备了负责期货和衍生品业务的专业团队，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。
（三）公司及子公司金融业务风险管理遵循全面性原则、独立性原则、权责匹
配原则、一致性原则和适时有效性原则；在风险识别、评估、应对、报告和监控及
管理体系评价的过程中，注重各环节之间的相互关联、相互影响，循环互动，并在
内部环境、市场环境、法规环境等发生变化时及时更新完善，同时运用信息科技手
段，保障风险控制有效落地。
五、会计政策及核算原则
公司根据财政部《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》《企业会计准则第 39 号—公允价值计量》《企业会
计准则第 24 号—套期保值》等相关规定及其指南，对拟开展的期货与衍生品业务
进行相应的核算处理，在资产负债表及损益表相关项目中反映。

六、对公司的影响
在不影响公司正常经营及风险有效控制的前提下，公司金融板块下属公司适
度进行投资，旨在降低市场波动风险的同时获取一定投资收益，不会影响公司主营
业务的正常开展，有利于充分发挥公司有关牌照、平台资源优势及金融业务板块的
投资职能，可提高资金使用效率。同时，公司及子公司在授权期和拟定额度内开展
期货和衍生品交易业务，并已制定相关制度，对具体业务的操作原则、审批权限、
操作程序及后续管理作出了明确规定，能够有效规范交易行为，风险可控，不存在
损害全体股东利益的情形。
特此公告。

紫金矿业集团股份有限公司
董 事 会
二〇二四年三月二十三日