

新余钢铁股份有限公司

关于全资子公司新钢国贸公司开展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个别及连带责任。

2020年4月18日，新余钢铁股份有限公司（以下简称“公司”或“新钢股份”）第八届董事会第十次会议审议并通过了《关于下属全资子公司新钢国贸公司开展钢材套期保值业务的议案》，本议案需提交股东大会审议。现将有关情况公告如下：

一、开展套期保值业务控股子公司基本情况

（一）企业名称：新钢国际贸易有限公司（简称“新钢国贸公司”）。

（二）注册地址：江西省新余市渝水区冶金路。

（三）注册资本：人民币 30,000 万元。

（四）股权结构：新钢股份持有新钢国贸公司 100% 股权。

（五）财务状况：截至 2019 年 12 月末，资产总额 114,104.57 万元，净资产合计 12,195.86 万元。2019 年实现利润总额为 2,263.46 万元，净利润 1,685.95 万元。

（六）开展套期保值的目的：新钢国贸公司开展钢铁期货套期保值业务有利于通过期货市场对冲现货价格波动风险，对冲现货因价格风险导致的或有损失。利用期货市场价格发现功能，有利于公司构建即时反应市场供需情况的现货价格参考体系，为企业生产经营提供参考。期货市场可以为公司提供低成本、高效率的风险控制手段和贸易流通通道，提高企业管理水平，维护公司生产经营的稳定。

二、拟开展的套期保值业务情况

（一）套期保值品种。依据套期保值业务实际需求、风险管理周期和基差波动状况，套期保值品种仅限于钢铁产业链品种，即铁矿石、焦煤、焦炭、铁合金等原燃料期货品种，以及螺纹钢、线材、热轧卷板等钢材期货品种，或其他标准期货合约。增加品种需公司股东大会审议通过并确认。

（二）套期保值业务规模。根据最高持仓量确定最高保证金，新钢国贸公司进行套期保值最高保证金不超过人民币 1,000 万元。

（三）资金来源。套期保值业务资金为新钢国贸公司自有资金或公司单独批复资金。

（四）投资决策。公司成立了新钢期货业务领导小组，具有较为完善的套期保值决策机制，新钢国贸公司设立期货运营部，接受集团期货业务领导小组的领导。

（五）财务核算。公司对期货业务考核单列，期货盈亏列入公司总账，如需要进行实物交割的，也要在原料和销售中剔除考核。新钢国贸公司只适当收取资金占用费和人员业务开支费用。

（六）检查监督。为规范公司钢铁产业链期货及衍生品套期保值业务的决策、操作及管理程序，结合公司实际情况，新钢国贸公司制订了钢铁产业链期货套期保值业务管理制度等制度，明确开展期货套期保值业务的组织机构及职责、业务流程和审批报告、风险管理、绩效评价等相关内容。公司将根据套期保值业务制度进行监督和检查。

公司市场管理、财务、风险管理等相关职能部门对新钢国贸公司开展期货业务的必要性与合规性进行审查监督，负责对套期保值业务管理制度的执行情况进行检查和监督；定期或不定期对期货账务数据、原始流转单据等公司期货操作情况进行核查，核查后应出具正规核查报告报送总经理及相关领导和部门。

（七）授权有效期：自公司股东大会审议通过决议之日起 12 个月。

三、风险控制措施

（一）套期保值业务风险管理策略。公司期货业务仅限于各业务单元自营现货保值、避险的关联匹配运作，严禁以投机为目的而进行的任何交易行为，期货头寸控制在现货库存合理比例以内。针对现货库存适时在期货市场进行卖出或买入交易。在制定期货交易方案同时制定资金调拨计划，防止由于资金问题造成持仓过大导致保证金不足被强行平仓的风险。期货交易方案设定止损目标，将损失控制在一定的范围内，防止由于市场出现系统性风险时造成严重损失。

（二）构筑顺序递进的监控防线：一是加强岗位制约，即建立完善的岗位责任制度和规范的岗位管理措施，实行双人、双职、双责制度，交叉核对、资产双重控制和双人签字等，以确立岗位间相互配合、相互督促、相互制约的工作关系；二是部门制约，即建立起相关部门、相关岗位之间相互监督制约的工作程序，交易部门受到财务部门的约束等；三是内部稽核制约，对各岗位、各部门、各项业务实施全面的监督，及时发现问题，确保各种规章制度的执行和各项决策的实施，避免不正当行为所构成的风险隐患。

（三）公司将制定规章制度，搭建科学规范的组织架构和内控制度体系，对新钢国贸公司的套期保值业务实行审批制。

（四）注重人才培养，加强对原有重点人员进行上岗培训和专题培训的同时，要大力引进一些关键岗位的人才，不断充实公司期货人员队伍。

特此公告

新余钢铁股份有限公司董事会

2020年4月21日