

鞍钢股份有限公司 第九届第十三次董事会决议公告

公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、董事会会议召开情况

鞍钢股份有限公司（以下简称公司）于2023年3月17日以电子邮件方式发出董事会会议通知，并于2023年3月22日以通讯方式召开第九届第十三次董事会。董事长王义栋先生主持会议。公司现有董事8人，出席本次会议的董事人数为8人。本次会议的召开符合有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和《公司章程》的规定。

二、董事会会议审议情况

议案一、以8票同意，0票反对，0票弃权的表决结果，通过《关于调整董事会专门委员会成员的议案》。

调整后第九届董事会战略委员会和提名委员会组成如下：

1. 战略委员会

召集人：王义栋

成员：张红军、冯长利、汪建华、王旺林、朱克实

2. 提名委员会

召集人：汪建华

成员：王义栋、田勇、冯长利、王旺林、朱克实

议案二、以8票同意，0票反对，0票弃权的表决结果，通过《关于修订〈鞍钢股份有限公司套期保值业务管理办法〉的议案》。

根据国资委《关于切实加强金融衍生品业务管理有关事项的通知》（国

资发财[2020]8号)、《国资委办公厅关于进一步加强金融衍生业务管理有关事项的通知文件的要求》(国资厅发财评[2021]17号)等文件的要求,公司对《鞍钢股份有限公司套期保值业务管理办法》进行了修订。《鞍钢股份有限公司套期保值业务管理办法》修订对照表见附件。

《鞍钢股份有限公司套期保值业务管理办法》全文刊登于2023年3月23日巨潮资讯网<http://www.cninfo.com.cn>。

议案三、以8票同意, 0票反对, 0票弃权的表决结果, 通过《关于<鞍钢股份有限公司套期保值业务交易授权变更书>的议案》。

根据《关于切实加强金融衍生业务管理有关事项的通知》(国资发财评规〔2020〕8号)的要求,公司对套期保值业务交易授权书进行了变更。

三、备查文件

1. 经与会董事签字并加盖董事会印章的本次董事会决议;
2. 深交所要求的其他文件。

鞍钢股份有限公司

董事会

2023年3月22日

附件：

《鞍钢股份有限公司套期保值业务管理办法》修订对照表

条款	修改前	修改后
全文		办法中条款涉及“风险控制岗位人员”都改为“风险控制部门”
第一章 第一条	第一条 为规范鞍钢股份有限公司（以下简称公司）境内套期保值业务，有效防范和控制风险，根据国资委《关于切实加强金融衍生品业务管理有关事项的通知》（国资发财[2020]8号）结合公司实际，制定本办法。	第一条 为规范鞍钢股份有限公司（以下简称公司）境内套期保值业务，有效防范和控制风险，根据国资委《关于切实加强金融衍生品业务管理有关事项的通知》（国资发财[2020]8号）、《国资委办公厅关于进一步加强金融衍生品业务管理有关事项的通知文件的要求》（国资厅发财评[2021]17号）结合公司实际，制定本办法。
第一章 第三条	<p>第三条 从事套期保值业务，应遵循以下原则：</p> <p>（一）在期货、期权市场，仅限于从事钢铁产业链相关产品套期保值业务，不得进行投机交易；</p> <p>（二）只限于在境内期货交易所进行场内市场交易；</p> <p>（三）进行套期保值数量必须符合公司生产计划量，不得超出国资委要求范围；商品类衍生业务年度保值规模不超过年度实货经营规模的90%；</p> <p>（四）套期保值持仓时间应与公司生产经营计划期相匹配，持仓时间一般不得超过12个月或现货合同规定的时间；</p> <p>（五）不得使用他人帐户进行套期保值业务；</p> <p>（六）应具有与套期保值保证金相匹配的自有资金，不得使用募集资金直接或间接进行套期保值。公司应严格控制套期保值的资金规模，不得影响公司正常经营。公司要保证资金及时到位，防范资金不足造成的强制平仓风险。</p>	<p>第三条 从事套期保值业务，应遵循以下原则：</p> <p>（一）在期货、期权市场，仅限于从事钢铁产业链相关产品套期保值业务，不得进行投机交易；</p> <p>（二）只限于在境内期货交易所进行场内市场交易；</p> <p>（三）进行套期保值数量必须符合公司生产计划量，不得超出国资委要求范围；商品类衍生业务年度保值规模不超过年度实货经营规模的90%；</p> <p>（四）套期保值持仓时间应与公司生产经营计划期相匹配，持仓时间一般不得超过12个月或现货合同规定的时间；</p> <p>（五）不得使用他人帐户进行套期保值业务；</p> <p>（六）应具有与套期保值保证金相匹配的自有资金，不得使用募集资金直接或间接进行套期保值。公司应严格控制套期保值的资金规模，不得影响公司正常经营。公司要保证资金及时到位，防范资金不足造成的强制平仓风险。</p> <p>（七）建立科学合理的激励约束机制，将金融衍生品业务盈亏与实货盈亏进行综合评判，客观评估业务套保效果，不得将绩效考核、薪酬激励与金融衍生品业务单边盈亏简单挂钩，防止片面强调金融衍生品业务单边盈利导致投机行为。</p>
第二章	第五条 公司成立套期保值业务领导小组	第五条 公司成立套期保值业务领导小组

条款	修改前	修改后
第五条	(以下简称“领导小组”), 领导小组根据董事会授权, 组织公司开展套期保值业务。	(以下简称“领导小组”), 领导小组根据董事会授权, 组织公司开展套期保值业务。 (一) 领导小组组成: 组长: 公司总经理; 副组长: 主管销售、采购副总经理, 总会计师。 (二) 期货交易所部长岗位执行公司领导人员管理规定; 考虑到工作的稳定性、衔接性, 套期保值业务相关岗位工作的最高年限为6年, 工作年限达到规定的年限后原则上必须进行岗位调整。如因工作需要, 可视情形随时轮换调整或适当延长。
第二章 第八条	第八条 风险控制岗位直接对领导小组负责, 对公司套期保值业务进行全过程监控, 主要职责: (一) 负责编写套期保值方案中风险控制部分内容; (二) 负责对套期保值方案合规性进行审核; (三) 负责核查交易员的交易行为是否符合套期保值计划和具体交易方案; (四) 审核套期保值交易数据日报表, 及时反馈存在的问题并提出相应的整改措施; (五) 发现、报告并按程序处理风险事故。	第八条 期货交易所: (一) 负责编制年度套期保值工作计划; (二) 负责制订、调整套期保值方案及资金需求计划, 并报领导小组批准; (三) 负责提出套期保值业务保证金申请; (四) 负责定期提交套期保值书面工作报告及编制年度报告。 (五) 负责每年向公司提报培训计划并按计划开展培训。
第二章 第九条	第九条 期货交易所: (一) 负责编制年度套期保值工作计划; (二) 负责制订、调整套期保值方案及资金需求计划, 并报领导小组批准; (三) 负责提出套期保值业务保证金申请; (四) 负责定期提交套期保值书面工作报告及编制年度报告。	第九条 财务运营部: (一) 负责制订套期保值财务管理办法等; (二) 负责在保证金限额内做好资金的安排和调度工作; (三) 负责套期保值交易账户开立及交易资金结算; (四) 负责套期保值业务相关账务处理及编制财务报告。
第二章 第十条	第十条 财务运营部: (一) 负责制订套期保值财务管理办法等; (二) 负责在保证金限额内做好资金的安排和调度工作; (三) 负责套期保值交易账户开立及交易资金结算; (四) 负责套期保值业务相关账务处理及编制财务报告。	第十条 审计部: 负责对套期保值业务进行审计, 及时防范业务中的风险。
第二章 第十一条	第十一条 审计部: 负责对套期保值业务进行审计, 及时防范业务中的风险。	第十一条 法律合规部: (一) 负责套期保值业务的合法性审查论证, 提出法律意见; (二) 负责套期保值业务涉及法律事项的审

条款	修改前	修改后
		查把关、审查有关合同,审查其他法律文件。 (三)为公司风险管理部门,负责内控与风险管理。
第二章 第十二条	第十二条 法律合规部: (一)负责套期保值业务的合法性审查论证,提出法律意见; (二)负责套期保值业务涉及法律事项的审查把关、审查有关合同,审查其他法律文件。	第十二条 风险管理部门直接对领导小组负责,对公司套期保值业务进行全过程监控,主要职责: (一)负责编写套期保值方案中风险控制部分内容; (二)负责对套期保值方案合规性进行审核; (三)负责核查交易员的交易行为是否符合套期保值计划和具体交易方案; (四)审核套期保值交易数据日报表,及时反馈存在的问题并提出相应的整改措施 (五)负责建立每日报告制度。
第二章 第十四条	第十四条 相关单位: (一)根据需求,提出套期保值业务申请并提供套期保值需要的相关材料; (二)收集、分析、处理市场行情与现货信息,定期形成报告,对套期保值业务提出建议; (三)协同期货交易部进行实物交割。	第十四条 相关需求单位: (一)根据需求,提出套期保值业务(建/平仓)申请并提供套期保值需要的相关材料; (二)收集、分析、处理市场行情与现货信息,定期形成报告,对套期保值业务提出建议; (三)协同期货交易部进行实物交割。
第四章 第十八条	第十八条 年度计划制定。期货交易部依据公司年度生产经营计划及原料、钢材的敞口风险编制年度套期保值工作计划,经领导小组审议后,报董事会批准。经董事会批准的年度计划范围内交易保证金申请,由领导小组负责批准。超过年度计划范围内新增的交易保证金,需经董事会批准。	第十八条 年度计划制定。期货交易部依据公司年度生产经营计划及原料、钢材的敞口风险编制年度套期保值工作计划,经领导小组审议通过,报鞍钢集团后由董事会批准,达到股东大会审议标准的还需提交股东大会审议批准。经董事会及股东大会批准的年度计划范围内交易保证金申请,由领导小组负责批准。超过年度计划范围内新增的交易保证金,需报鞍钢集团后报董事会批准,达到股东大会审议标准的还需提交股东大会审议批准。
第六章 第三十六条	第三十六条 期货交易部执行套期保值交易方案时,如遇市场发生重大变化等情况,导致继续进行该业务将造成风险显著增加、可能引发重大损失时,应及时报告领导小组,启动预警机制。	第三十六条 期货交易部执行套期保值交易方案时,如遇市场发生重大变化等情况,导致继续进行该业务将造成风险显著增加、可能引发重大损失时,应及时报告领导小组,启动预警机制,并由风险控制部门独立向鞍钢集团金融衍生业务归口管理部门报告。
第七章 第三十条	第三十九条 套期保值业务应遵守以下汇报制度:	第三十九条 套期保值业务应遵守以下汇报制度:

条款	修改前	修改后
九条	<p>(一)期货交易所根据每日交易情况建立套期保值统计核算台帐并向领导小组报告持仓状况、盈亏状况等信息。每个方案结束后,根据方案期货单边盈亏,结合现货评价套期保值效果,即期货端价值波动+现货端价值波动=期现综合盈亏,形成套期保值效果报告。</p> <p>(二)期货交易所每月初向领导小组提交上月套期保值业务报告,包括总体持仓状况、结算状况、未来价格趋势等相关分析。</p> <p>(三)每季度末,期货交易所按国资委快报要求向财务运营部提报业务持仓规模、资金使用、盈亏情况等情况。</p> <p>(四)期货交易所每年编制套期保值业务专门报告,报送财务运营部。</p>	<p>(一)期货交易所根据每日交易情况建立套期保值统计核算台帐并向领导小组报告持仓状况、盈亏状况等信息。每个方案结束后,根据方案期货单边盈亏,结合现货评价套期保值效果,即期货端价值波动+现货端价值波动=期现综合盈亏,形成套期保值效果报告。</p> <p>(二)风险控制部门每日根据套期保值统计核算台账独立向鞍钢集团金融衍生业务归口管理部门报告持仓状况、盈亏状况、风险状况、套保策略等信息。</p> <p>(三)期货交易所及风险控制部门每月初向领导小组提交上月套期保值业务报告,包括总体持仓状况、结算状况、风险状况、未来价格趋势等相关分析。</p> <p>(四)风险控制部门、期货交易所、财务运营部每月核对月结算单等信息。</p> <p>(五)每季度末,期货交易所按国资委快报要求向鞍钢集团金融衍生业务归口管理部门提报业务持仓规模、资金使用、盈亏情况等情况。</p> <p>(六)期货交易所及风险控制部门在年度终了1个月内对年度金融衍生业务开展情况和风险管理制度执行情况等形成专门报告报送鞍钢集团,报告内容包括年度业务开展情况(如业务品种、保值规模、盈亏情况、年末持仓风险评估等)、套期保值效果评估、审计检查中发现的问题及整改情况、其他重大事项等。</p>
第七章 第四十条	<p>第四十条 发生重大亏损、被强行平仓或发生法律纠纷等事项时,期货交易所应立即向公司汇报,并在事项发生后3个工作日内逐级向鞍钢集团、国资委报告相关情况,并对采取的应急处理措施及处理情况建立周报制度。</p>	<p>第四十条 发生重大亏损、被强行平仓或发生法律纠纷等事项时,期货交易所应立即向公司汇报。风险控制部门应当在事项发生后12小时内向鞍钢集团报告相关情况,并对采取的应急处理措施及处理结果报鞍钢集团。突发或特别紧急事项应先口头报告,并在1个工作日内补充书面报告。报告内容应包括事件概括、产生影响、亏损原因、货币现金价值或商品现货价值、已采取的处置措施及下一步工作安排等。</p>
第七章 第四十一条	<p>第四十一条 公司拟进行套期保值业务及每一年度拟进行的套期保值计划,应提交董事会审议。董事会应在做出相关决议后两个交易日内进行公告。并向证券交易所提交下列</p>	<p>第四十一条 公司拟进行套期保值业务及每一年度拟进行的套期保值计划,应提交董事会审议,达到股东大会审议标准的还需提交股东大会审议批准。董事会应在做出相关决</p>

条款	修改前	修改后
	文件： （一）董事会决议及公告； （二）套期保值事项公告，公司披露的套期保值事项至少应当包括：套期保值的目的、品种、拟投入资金、套期保值的风险分析及公司拟采取的风险控制措施等； （三）证券交易所要求的其他文件。	议后两个交易日内进行公告。并向证券交易所提交下列文件： （一）董事会决议及公告； （二）套期保值事项公告，公司披露的套期保值事项至少应当包括：套期保值的目的、品种、拟投入资金、套期保值的风险分析及公司拟采取的风险控制措施等； （三）证券交易所要求的其他文件。
第八章 第四十二条	第四十二条 当公司套期保值业务出现或可能出现重大风险或重大影响，套期保值业务交易达到证券交易所相关规则所要求的披露标准时，期货交易所向领导小组、董事会汇报后，公司应及时发布临时公告及披露相关情况。	第四十二条 当公司套期保值业务出现或可能出现重大风险或重大影响，套期保值业务交易达到证券交易所相关规则所要求的披露标准时，期货交易所及风险控制部门向领导小组、董事会汇报后，公司应及时发布临时公告及披露相关情况。
附件	附件：套期保值业务流程图	附件 1：套期保值业务流程图 附件 2：授权管理业务流程图 附件 3：期货公司选择与开户业务流程图 附件 4：方案制定业务流程图 附件 5：交易执行业务流程图 附件 6：错单处理业务流程图 附件 7：套期保值业务风险控制流程图 附件 8：档案管理业务流程图