

股票代码：600399 股票简称：抚顺特钢 编号：临 2016-014

抚顺特殊钢股份有限公司 关于开展 2016 年度期货套期保值业务的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，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。

抚顺特殊钢股份有限公司（以下简称“公司”）第六届董事会第九次会议审议通过了《关于开展 2016 年度期货套期保值业务的议案》，议案需要提交公司股东大会表决。公司拟开展原材料镍的套期保值业务，具体方案如下：

一、套期保值目的

公司高温合金、不锈钢产品对镍和镍铁等有色金属原料需求很大。随着公司业务规模和领域的扩展，公司市场规模逐渐扩大，对原材料镍和镍铁的需求逐渐增多。而镍和镍铁的市场价格变动较大，为规避原材料成本大幅波动对运营利润的影响，利用期货的套期保值功能进行风险控制，减少因原材料价格波动造成的产品成本波动，公司拟开展关于镍的套期保值业务。

二、套期保值的期货品种

公司期货套期保值业务仅限于运营所需原材料镍的期货交易合约。

三、投入资金及业务期间

公司进行套期保值业务期间为 2016 年 1 月 1 日至 12 月 31 日，镍期货套期保值保证资金投入限额为人民币 5,000 万元，或不超过 2016 年镍和镍铁的实际使用数量（约不超过 7,000 吨金属镍）所需要的资金对应的保证资金。镍期货套期保值业务使用公司自有资金，依据相关内部控制制度及业务流程进行操作。

四、风险分析与控制

（一）风险分析

- 1、价格波动风险：期货行情变动较大，可能产生价格波动风险，造成投资损失。
- 2、资金风险：期货交易采取保证金和逐日盯市制度，可能会带来相应的资金风险。
- 3、流动性风险：国内镍期货品种成交不活跃，可能因为难以成交而带来流动风险。
- 4、内部控制风险：期货交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于内部控制体系不完善造成的风险。
- 5、技术风险：可能因为计算机系统不完备导致技术风险。

（二）风险控制措施

1、公司已制订《商品期货套期保值业务管理制度》(见同日公告),规定公司进行套期保值业务只能以规避生产经营所需原材料及产品价格波动等风险为目的。

2、严格控制套期保值的资金规模,合理使用保证金,合理使用自有资金用于套期保值业务。

3、根据《上海证券交易所股票上市规则》等有关规定,对期货业务进行管理,避免制度不完善、工作程序不恰当等造成的操作风险。

4、进一步完善并加强计算机系统及相关设施建设,尽量保证交易工作正常开展。

五、商品期货套期保值业务管理制度

公司根据商品期货套期保值业务控制和管理的需要,拟定了《商品期货套期保值业务管理制度》,具体制度内容见同日公告。

特此公告。

抚顺特殊钢股份有限公司董事会

二〇一六年三月三十日