

## 鞍钢股份有限公司 第八届董事会第二十二次会议决议公告

本公司及其董事保证信息披露内容的真实、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”）第八届董事会第二十二次会议于2020年4月28日以书面通讯形式召开。公司现有董事8人，出席会议董事8人，达到《公司章程》规定的法定人数，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，批准《公司2020年第一季度报告》全文及正文。**

《鞍钢股份有限公司2020年第一季度报告》全文及正文刊登于2020年4月29日《中国证券报》、《证券时报》或巨潮资讯网<http://www.cninfo.com.cn>。

**议案二、以8票同意，0票反对，0票弃权的表决结果，批准《关于制定<鞍钢股份有限公司规章制度管理规定>的议案》。**

为加强和规范公司规章制度管理，增强规章制度的执行力和控制力，实现制度管理规范化、系统化和科学化，特制定《鞍钢股份有限公司规章制度管理规定》。

本规定包括公司规章制度体系建立、规章制度管理、监督检查与评价考核等内容。

《鞍钢股份有限公司规章制度管理规定》不属于公司治理基本管理制

度文件，也不属于公司信息披露事务管理制度。该规定为公司管理层面的普通商密文件，因此不全文挂网。

**议案三、以 8 票同意，0 票反对，0 票弃权的表决结果，批准《关于修订<鞍钢股份有限公司商品期货套期保值业务管理办法>的议案》。**

随着金融衍生品市场的不断发展，钢铁产业链相关品种金融衍生工具的不断丰富，原《鞍钢股份有限公司商品期货套期保值业务管理办法》（以下简称“原办法”）已无法满足业务需要，同时为满足国资委《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）文件的要求，现拟对原办法进行修订。具体修改如下：

	修改前	修改后
文件名称	《鞍钢股份有限公司商品期货套期保值业务管理办法》	《鞍钢股份有限公司套期保值业务管理办法》
全文		办法中条款涉及“期货”都改为“期货、期权”
全文		办法中条款涉及“向期货领导小组副组长汇报”改为“向期货领导小组汇报”
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）境内商品期货套期保值业务，有效防范和控制风险，根据国资委《关于进一步加强中央企业金融衍生业务监督管理办法》（国资发评价[2009]19 号）、《关于建立中央企业金融衍生业务临时监管机制的通知》（国资发评价[2010]187 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）结合公司实际，制定本办法。
第五章 第二十九条	第二十九条 期货交易所负责对资金风险等进行测算。 （一）资金风险：测算已占用的保证金金额、浮动盈亏、可用保证金金额及拟建头寸需要的保证金金额、应追加保证金额度； （二）套保头寸价格变动风险：根据公司期货套期保值方案测算已建仓头寸和拟建仓头寸在价格出现变动后的保证金需求和盈亏风险。	第二十九条 风险控制岗位负责对资金风险等进行测算。 （一）资金风险：测算已占用的保证金金额、浮动盈亏、可用保证金金额及拟建头寸需要的保证金金额、应追加保证金额度。公司将总账户保证金使用率划分为 A、B、C 三个等级，A 级：保证金使用率大于 50%；B 级：保证金使用率大于 40%，小于等于 50%；C 级：保证金使用率大于 30%，小于等于 40%。当保证金使用率达到 A 级时，应及时调拨资金或调整仓位；当保证金使用率达到 B 级时，风险控制岗位人员立即向期货领导小组汇报；当保证金使用率达到 C 级时，风险控制

	修改前	修改后
		<p>岗位人员向期货交易所发出预警。</p> <p>(二)套保头寸价格变动风险:根据公司套期保值方案测算已建仓头寸和拟建仓头寸在价格出现变动后的保证金需求和盈亏风险。</p>
第五章 第三十一条	<p>第三十一条 公司建立风险报告和处理机制。</p> <p>(一)当市场价格波动较大或发生异常波动情况时,交易员应立即报告期货交易所部长和风险控制岗位人员,期货交易所部长和风险控制岗位立即启动风险处理程序或向上级报告。</p> <p>(二)当发生以下情况时,风险控制岗位人员应立即向领导小组副组长报告:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 期货套期保值业务有关人员违反风险管理政策和风险管理工作程序;</li> <li>2. 期货公司的资信情况不符合公司的要求;</li> <li>3. 有违反期货套期保值方案的操作行为;</li> <li>4. 期货套期保值头寸的风险状况影响到期货套期保值过程的正常进行;</li> <li>5. 期货套期保值业务出现或将出现有关的法律风险。</li> </ol> <p>(三)公司期货套期保值业务(单笔或累计)出现浮动亏损金额超过 2000 万元人民币等重大风险或可能出现重大风险时,风险控制岗位人员须向期货领导小组副组长汇报,期货领导小组副组长向组长汇报。</p> <p>(四)风险处置。期货领导小组组长负责组织召开期货套期保值相关人员参加的会议,分析、讨论风险情况,制定对策并组织实施。</p>	<p>第三十一条 公司建立风险报告和处理机制。</p> <p>(一)当市场价格波动较大或发生异常波动情况时,交易员应立即报告期货交易所负责人,期货交易所负责人和风险控制岗位立即启动风险处理程序或向上级报告。</p> <p>(二)当发生以下情况时,风险控制岗位应立即向领导小组报告:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 套期保值业务有关人员违反风险管理政策和风险管理工作程序;</li> <li>2. 期货公司的资信情况不符合公司的要求;</li> <li>3. 有违反套期保值方案的操作行为;</li> <li>4. 套期保值头寸的风险状况影响到套期保值过程的正常进行;</li> <li>5. 套期保值业务出现或将出现有关的法律风险。</li> </ol> <p>(三)设置预警线。公司将套期保值品种的期货、期权合约保证金比率设为基础值,基础值的 1.5 倍设为预警线,即套期保值品种的期货、期权合约上涨或下跌幅度达到预警线时,风险控制岗位须向期货领导小组汇报,启动预警机制。</p> <p>(四)公司期货套期保值业务(单笔或累计)出现浮动亏损金额超过 2000 万元人民币时,风险控制岗位人员须向期货领导小组汇报,启动预警机制。</p> <p>(五)风险处置。期货领导小组负责组织召开套期保值相关人员参加的会议,分析、讨论风险情况,制定对策并组织实施。</p>
第五章 第三十二条	<p>第三十二条 建立止损机制。套保业务(单笔或累计)出现浮动亏损金额超过 2000 万元人民币时,启动止损机制,期货交易所将亏损情况向期货领导小组汇报,期货领导小组制定应对方案,设定具体止损目标,组织期货套期保值交易相关人员按照应对方案进行止损操作。</p>	<p>第三十二条 建立止损机制。套保业务(单笔或累计)出现浮动亏损金额超过 4000 万元人民币时,启动止损机制:期货交易所及风险控制岗位将亏损情况向期货领导小组汇报,期货领导小组组织现货部门、期货交易所、财务运营部、风险控制岗位等根据现货市场及期货、期权市场情况,制定风控方案,设定具体止损目标,风险控</p>

	修改前	修改后
		制岗位按照应对方案进行操作。
第七章 第三十九条	<p>第三十九条 期货套期保值业务应遵守以下汇报制度：</p> <p>（一）期货交易所根据每次交易情况建立期货套期保值统计核算台帐并向期货领导小组报告新建头寸、计划建仓、平仓头寸，汇总持仓状况、结算盈亏状况及保证金使用状况等信息，防止被交易所强制平仓的情况发生。</p> <p>（二）期货交易所每月初向期货领导小组提交上月期货套期保值业务报告，包括新建仓位状况、总体持仓状况、结算状况、期货套期保值效果、未来价格趋势等相关分析。</p> <p>（三）每季度末 5 个工作日内，期货交易所按国资委快报要求向计划财务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期货套期保值业务专门报告，报送计划财务部。</p>	<p>第三十九条 套期保值业务应遵守以下汇报制度：</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期货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期货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>
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

修订后的《鞍钢股份有限公司套期保值业务管理办法》刊登于 2020 年 4 月 29 日巨潮资讯网 <http://www.cninfo.com.cn>。

### 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

2020 年 4 月 28 日