

南京钢铁股份有限公司

关于 2021 年度继续开展钢铁产业链期货 及衍生品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。

南京钢铁股份有限公司（以下简称“公司”）于 2020 年 12 月 4 日召开第七届董事会第三十八次会议，审议通过了《关于 2021 年度继续开展钢铁产业链期货及衍生品套期保值业务的议案》，同意公司 2021 年度继续开展钢铁产业链期货及衍生品套期保值业务（以下简称“套期保值业务”）。有关情况具体如下：

一、开展套期保值业务的必要性及目的

今年以来，受新冠疫情影响，黑色商品价格大幅波动，给钢厂原燃料的采购，以及钢材和原燃料的库存管理带来很大挑战。与此同时，钢铁产业链期货及衍生品品种不断上市，为钢铁企业提供了对冲现货经营风险的工具。

公司开展套期保值业务，目的是规避和转移生产经营中原燃料和钢材价格波动的风险，稳定公司生产运营。一方面，对原燃料、钢材相关品种进行买入交易（以下简称“买入套保”），以锁定公司生产成本或贸易子公司的采购成本，防范成本上涨风险；另一方面，对钢材、原燃料相关品种进行卖出交易（以下简称“卖出套保”），以实现预销售或规避存货跌价风险。

二、开展期货套期保值业务概述

1、业务主要涉及品种

期货及衍生品套期保值交易品种仅限于与公司现有生产经营相关的钢材、铁矿石、焦煤、焦炭、铁合金、镍等境内外商品交易所或银行制定的标准合约及金融衍生品。

2、套期保值业务工具

公司使用境内外期货、掉期和场外或场内期权等衍生品工具进行套期保值，以降低业务风险管理成本和提高期现业务管理效率。

3、套期保值规模

公司买入套保数量原则上不得超过公司年度预算的原燃料采购量的 30%或贸易子公司钢材销售量的 30%，在实际操作中一般不超过订单所需原燃料相关品种或贸易子公司月度钢材采购的数量；卖出套保数量原则上不超过公司年度预算所列产量的 30%或原燃料采购量的 30%，在实际操作中一般不超过月度钢材产量和月度原燃料库存的数量。套期保值交易保证金占用资金总额不超过人民币 3 亿元。

4、资金来源

公司套期保值业务使用自有资金，但优先使用客户订单预付款，必要时使用银行授信资金。

三、管理制度

为规范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，依据《南京钢铁股份有限公司章程》、《南京钢铁股份有限公司投资管理制度》等有关规定，结合实际情况，公司制定了《南京钢铁股份有限公司钢铁产业链期货套期保值业务管理制度》，明确公司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、授权管理、风险管理、绩效评价等相关内容。公司将根据套期保值业务的需要，适时修订该项制度。

四、套期保值业务风险分析

公司开展商品期货套期保值业务可能存在基差、政策、资金流动性、操作、技术、对手方违约等方面的风险，具体如下：

1、政策风险

期货市场政策法规发生重大变化，可能引起市场波动或无法交易等风险。

2、基差风险

期货价格与现货价格走势背离所带来的期货市场、现货市场均不利的风险。

3、资金风险

在期货价格波动大时，可能产生因未及时补充保证金而被强行平仓造成实际损失的风险。

4、违约风险

场内对手交割方不具备履约能力，或场外做市商无力履约所造成的风险。

5、操作风险

期货及衍生品交易专业性较强，若专业人员配置不足、内控不完善，会产生相应风险。

6、技术风险

由于软件、硬件故障等造成交易系统非正常运行，使交易指令出现延迟、中断或数据错误等问题，从而带来相应的风险。

五、套期保值业务风险控制措施

1、规范套期保值业务行为

杜绝投机交易；严格执行公司套期保值业务流程和决策程序。

2、加强账户资金监管

依据账户风险程度，及时平衡、调拨账户可用资金，防范账户持仓风险。

3、提升业务能力

提高套期保值业务人员的专业知识和水平，深度期现融合，提升公司套期保值业务的整体水平。

4、优化交易环境

建立“快捷、安全”的软硬件交易环境，保证交易系统的正常运行。

本议案尚需提交公司 2020 年第四次临时股东大会审议。

特此公告

南京钢铁股份有限公司董事会

二〇二〇年十二月五日