

## 本钢板材股份有限公司关于开展期货业务的公告

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

为有效控制经营风险，提高公司抵御市场波动的能力，对冲公司采购的原燃料与销售的钢铁产品的现货库存价格风险，根据《深圳证券交易所主板上市公司规范运作指引》的相关规定，结合公司业务发展的实际需要，2016年公司拟开展期货业务，现将相关情况说明如下：

### 一、履行合法表决程序的说明

2016年5月26日，公司第七届董事会第一次会议以7票同意，0票反对，0票弃权的表决结果审议通过了《关于本钢板材股份有限公司2016年度开展期货业务的议案》。该业务不属于关联交易事项，无需履行关联交易表决程序。

### 二、开展期货业务的目的及必要性

公司开展期货业务有利于企业通过期货回避价格波动风险，有助于调节市场供求，减缓现货市场价格波动；通过期货市场的价格预期，有效抑制市场供求失衡和非正常价格波动，有利于形成即时反应市场供需情况的价格参考体系，为企业的发展创造良好的条件。期货业务可以为公司提供低成本、高效率的风险控制手段和贸易流转通道，提高企业管理水平，增强市场竞争力，推动经营活动的稳步发展。

### 三、开展期货业务概述

#### 1、交易品种

仅限于公司经营范围内的钢铁产业链品种，包括钢材、铁矿石、焦煤、焦炭、动力煤、废钢及合金等，增加交易品种需公司董事会确认。

#### 2、交易数量

年业务规模控制在采购和销售指标的20%以内。

#### 3、保证金最高金额

根据最高持仓量确定最高保证金。2016年度，公司进行套期保值的最高保证金为人民币20,000万元。

#### 4、有效期

自公司董事会批准时起一年内有效。

#### 5、检查与监督

董事会要求财务部及审计部对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《本钢板材股份有限公司期货管理办法》的执行情况进行检查和监督；年底通过对本年期货账务数据、原始流转单据等对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。

#### 四、管理制度

依据《本钢板材股份有限公司期货管理办法》。

#### 五、风险分析及控制措施

风险分析：因期货交易所交易制度设计完善、涉及的期货合约成交活跃、保证金监管严密，所以公司面临的系统性风险、流动性风险及信用和资金风险较小。鉴于期货的金融属性，交易合约价格走势可能存在阶段性的与基本面的反向偏离，导致不利基差（期现价差）的发生而面临一定的基差风险，但从一般规律来看，期货合约价格与现货价格变动趋势总体上趋于一致，因此基差风险属可控范围。

#### 控制措施：

1、公司为规范期货的交易行为，加强对期货业务的监督管理，在相关法律法规、政策的基础上，出台了《本钢板材股份有限公司期货管理办法》，对公司期货业务的原则、条件、交易的实施，资金管理、头寸管理等以及相应的审批流程和权限进行了详细规定；

2、公司成立期货领导小组与期货贸易室，按《本钢板材股份有限公司期货管理办法》规定程序对公司的期货策略、期货方案、交易管理进行决策与交易；

3、具体操作上，交易指令严格审批，交易资金严密监管，指令下达与交易下单分离，持仓情况透明化，动态风险预警报告等，均符合内控管理的要求。公司坚决禁止投机交易。

#### 六、期货业务风险管理策略说明

公司期货业务仅限于各业务单元自营现货保值、避险的运作，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。在制定期货计划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。期货计划设定止损目标，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。

#### 七、期货业务交易品种公允价值分析

公司期货业务交易品种为上海期货交易所上市的热轧卷板，大连商品交易所上市的铁矿石、焦煤、焦炭，郑州商品交易所上市的动力煤，市场透明度大，成交活跃，成交价格和当日结算单价能充分反映衍生品

的公允价值。

#### 八、会计政策及核算原则

公司衍生品交易相关会计政策及核算原则按照中华人民共和国财政部发布的《企业会计准则—金融工具确认和计量》及《企业会计准则—期货》相关规定执行。

#### 九、独立董事专项意见

公司独立董事发表了独立意见，认为：公司为开展期货业务，制定了《本钢板材股份有限公司期货管理办法》，明确了组织架构、业务流程、风险控制等相关制度及业务运行方式，符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定，开展期货业务。有利于公司降低经营风险，适应激烈的市场竞争、实现转型跨越发展。

公司确定的期货交易保证金的最高额度和交易品种合理，不影响公司正常的生产经营，不存在损害公司和全体股东利益的情况。

特此公告

本钢板材股份有限公司董事会

二〇一六年五月二十七日

