（上接B053版）

说明：关联交易定价原则见本公告第“三、关联交易主要内容”部分内容。

注：鞍山钢铁指鞍山钢铁集团有限公司。

鞍钢集团指鞍钢集团有限公司及其持股30%以上的子公司[不包括本公司及本公司子公司（简称“本集团”）]。

鞍钢财务公司指鞍钢集团财务有限责任公司。

（三）上一年度日常关联交易实际发生情况

金额单位：人民币百万元

关联交易类别	关联人	关联交易内容	实际发生金额	预计金额	实际发生额占同类业务比例（%）	实际发生额与预计金额差异（%）	披露日期及索引
向关联人采购原材料	鞍山钢铁	采购主要原材料	6,442	–	20.28	–	2018年3月29日刊登于《中国证券报》及巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn《鞍钢股份有限公司预计2018年度日常关联交易公告》
	鞍钢集团矿业弓长岭有限公司	采购主要原材料	3,480	–	10.95	–	
	鞍钢集团矿业有限公司	采购主要原材料	2,433	–	7.66	–	
	鞍钢集团鞍千矿业有限责任公司	采购主要原材料	1,210	–	3.81	–	
	鞍钢集团关宝山矿业有限公司	采购主要原材料	1,072	–	3.37	–	
	鞍钢集团国际经济贸易公司	采购主要原材料	792	–	2.49	–	
	攀钢钒钛集团	采购主要原材料	431	–	1.36	–	
	鞍钢集团其他子公司	采购主要原材料	593	–	1.86	–	
	小计	采购主要原材料	16,453	21,700	51.78	–24.18	
向关联人采购商品	朝阳钢铁	采购钢材产品	376	–	77.07	–100	
	攀钢集团国际经济贸易有限公司	采购钢材产品	112	–	22.93	–	
	小计	采购主要原材料	488	600	100	–18.67	
向关联人采购辅助材料	鞍山鞍钢维苏威耐火材料有限公司	采购辅助材料	893	–	7.52	–	
	鞍钢集团耐火材料公司	采购辅助材料	790	–	6.66	–	
	鞍钢集团其他子公司	采购辅助材料	1,303	–	10.99	–	
	小计	采购辅助材料	2,986	3,015	25.17	–0.96	
向关联人采购能源动力	鞍山钢铁	采购能源动力	1,699	–	54.92	–	2018年3月29日刊登于《中国证券报》及巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn《鞍钢股份有限公司预计2018年度日常关联交易公告》
	鞍钢集团其他子公司	采购能源动力	43	–	1.39	–	
	小计	采购能源动力	1,742	2,855	56.31	–38.98	
接受关联人提供的支持性服务	德邻陆港（鞍山）有限责任公司	接受支持性服务	793	–	8.52	–	
	鞍钢建设集团有限公司	接受支持性服务	707	–	7.6	–	
	鞍山钢铁	接受支持性服务	580	–	6.23	–	
	鞍钢冷轧钢板（莆田）有限公司	接受支持性服务	493	–	5.3	–	
	鞍钢集团工程技术有限公司	接受支持性服务	427	–	4.59	–	
	鞍钢集团其他子公司	接受支持性服务	2,709	–	29.11		
	小计	接受支持性服务	5,709	6,500	61.35	–12.17	
向关联人销售产品、商品	德邻陆港（鞍山）有限责任公司	销售产品	1,166	–	1.17	–	
	鞍钢集团国际经济贸易有限公司	销售产品	670	–	0.67	–	
	鞍钢绿色资源科技有限公司	销售产品	315	–	0.31	–	
	鞍钢集团其他子公司	销售产品	1,092	–	1.09	–	
	小计	销售产品	3,243	5,310	3.24	–38.93	
向关联人销售废钢料、废旧物资、筛下粉	鞍钢集团	销售废钢料、废旧物资、筛下粉	330	330	93.75	–	
	小计		330	–	93.75	–	
向关联人提供综合性服务	鞍山钢铁	提供综合性服务	769	–	28.45	–	
	鞍钢集团其他子公司	提供综合性服务	313	–	11.58	–	
	小计	提供综合性服务	1,082	1,500	40.03	–27.87	
接受关联人委托提供的金融服务	鞍钢财务公司	结算资金存款利息	21	50	74.74	58	
	鞍钢财务公司	最高存款每日余额	1,999	2,000	–	0.05	
	鞍钢财务公司	信贷业务利息	32	150	2.41	78.67	
	鞍钢财务公司	委托贷款利息	0	100	0	100	
公司董事会对日常关联交易实际发生情况与预计存在较大差异的说明（如适用）			2018年度，公司的日常关联交易总额并未超过日常关联交易协议上载明的适用于该等类别的相关上限。部分关联交易项目实际发生额较预计数额差异较大，是由于实际运营过程中商品的价格和交易量的变动影响，而原预计数据是预计的交易金额上限，因此存在差异属于合理情况，不影响亦不损害非关联股东和公司的利益。				
公司独立董事对日常关联交易实际发生情况与预计存在较大差异的说明（如适用）			2018年度，公司的日常关联交易总额并未超过日常关联交易协议上载明的适用于该等类别的相关上限。部分关联交易项目实际发生额较预计数额差异较大，是由于实际运营过程中商品的价格和交易量的变动影响，而原预计数据是预计的交易金额上限，因此存在差异属于合理情况，不影响亦不损害非关联股东和公司的利益。				

二、关联人介绍和关联关系

（一）关联方基本情况及与本公司的关联关系

序号	公司名称	相关信息
1	鞍钢集团有限公司	企业负责人：姚林 注册地址：辽宁省鞍山市铁东区东山街77号 注册资本：人民币500亿元 主营业务：钢、铁、钒、钛、不锈钢、特钢生产及制造，有色金属生产及制造，钢压延加工，铁、钒、钛及其他有色金属、非金属矿采选与综合利用等。 主要财务数据：截至2018年9月30日止，总资产为人民币347,383百万元，净资产为人民币106,113百万元；2018年1–9月份，鞍钢集团有限公司营业收入为人民币158,881百万元，净利润为人民币2,129百万元。 与本公司关系：为本公司的实际控制人，该关联人符合《深圳证券交易所股票上市规则》第10.1.3条第（一）款规定的关联关系情形。
2	鞍山钢铁集团有限公司	法定代表人：王义栋 注册资本：人民币260亿元 主营业务： 住所：辽宁省鞍山市铁西区 主要财务数据：截至2018年9月30日止，总资产人民币224,043百万元，净资产人民币90,839百万元；2018年1–9月份，主营业务收入人民币90,814百万元，净利润人民币4,249百万元。 与本公司关系：为本公司的直接控制人，该关联人符合《深圳证券交易所股票上市规则》第10.1.3条第（一）款规定的关联关系情形。
3	鞍钢集团财务有限责任公司	法定代表人：于万源 注册资本：人民币40亿元 住所：辽宁省鞍山市铁东区和平路8号 主要业务：对成员单位办理财务和融资顾问、信用鉴证及相关的咨询、代理业务、提供担保、办理票据承兑与贴现、办理贷款及融资租赁；吸收成员单位的存款；办理成员单位之间的委托贷款及委托投资；协助成员单位实现交易款项的收付；办理成员单位之间的内部转账结算及相应的结算、清算方案设计等；中国银行业监督管理委员会批准的其他业务。 主要财务数据：截至2018年9月30日止，总资产为人民币23,527百万元，净资产为人民币6,723百万元；2018年1–9月份，鞍钢财务公司营业收入为人民币807百万元，净利润为人民币565百万元。 与本公司关系：与本公司受同一实际控制人控制，该关联人符合《深圳证券交易所股票上市规则》第10.1.3条第（二）款规定的关联关系情形。
4	鞍钢集团矿业有限公司	法定代表人：邵安林 注册资本：人民币670,000万元 主营业务：黑色金属矿采、选、烧、球、石灰石，水泥，硝石灰，锰矿石，锰铁，矿石回收，碎石加工，机械运输；电力通讯，筑路，爆破拆除，电力蒸汽余热生产，转供电，机械加工等。 住所：鞍山市铁东区二一九路39号 主要财务数据：截至2018年9月30日止，总资产人民币62,081百万元，净资产人民币38,334百万元；2018年1–9月份，营业收入人民币9,908百万元，净利润人民币249百万元。 与本公司关系：与本公司受同一实际控制人控制，该关联人符合《深圳证券交易所股票上市规则》第10.1.3条第（二）款规定的关联关系情形。
5	鞍钢集团关宝山矿业有限公司	法定代表人：汪忠海 注册资本：人民币20,000万元 主营业务：铁矿露天、地下开采、铁矿石加工、销售、机械设备租赁等。 住所：鞍山市千山区千山镇山印子村 主要财务数据：截至2018年9月30日止，总资产人民币3,562百万元，净资产人民币3,498百万元；2018年1–9月份，营业收入人民币800百万元，净利润人民币109百万元。 与本公司关系：与本公司受同一实际控制人控制，该关联人符合《深圳证券交易所股票上市规则》第10.1.3条第（二）款规定的关联关系情形。
6	鞍钢集团矿业弓长岭有限公司	法定代表人：宋乃斌 注册资本：人民币393,496万元 主营业务：铁矿采选、矿产品深加工。机械加工；矿山设备制造、维修；土建工程；矿山工程施工；机电设备安装工程。 住所：辽宁省辽阳市弓长岭区苏家街 主要财务数据：截至2018年9月30日止，总资产人民币10,959百万元，净资产人民币9,458百万元；2018年1–9月份，营业收入人民币2,981百万元，净利润人民币186百万元。 与本公司关系：与本公司受同一实际控制人控制，该关联人符合《深圳证券交易所股票上市规则》第10.1.3条第（二）款规定的关联关系情形。
7	鞍钢集团鞍千矿业有限责任公司	法定代表人：熊宏启 注册资本：人民币139,500万元 主营业务：铁矿采选 住所：鞍山市千山区齐大山镇金朝新村 主要财务数据：截至2018年9月30日止，总资产人民币7,731百万元，净资产人民币5,481百万元；2018年1–9月份，营业收入人民币1,411百万元，净利润人民币350百万元。。 与本公司关系：与本公司受同一实际控制人控制，该关联人符合《深圳证券交易所股票上市规则》第10.1.3条第（二）款规定的关联关系情形。
8	鞍钢集团国际经济贸易有限公司	法定代表人：张三健 注册资本：人民币86,000万元 主营业务：经营货物及技术进出口；承包境外工业民用建筑工程和境内国际招标工程及境外工程所需的设备材料出口；仓储（不含危险品）、商务代理；原燃材料经销（不含危险品）；机械设备安装、调试、技术服务；金属材料（不含专营）经销；进口钢材业务、房屋租赁、设备租赁；钢材加工；承办海运、空运进出口货物的国际运输代理业务。 住所：辽宁省鞍山市铁东区南中华路322号 主要财务数据：截至2018年9月30日止，总资产人民币11,746百万元，净资产人民币2,751百万元，营业收入人民币21,650百万元，净利润人民币220百万元。 与本公司关系：与本公司受同一实际控制人控制，该关联人符合《深圳证券交易所股票上市规则》第10.1.3条第（二）款规定的关联关系情形。
9	鞍钢集团耐火材料有限公司	法定代表人：邱明金 注册资本：人民币50,000万元 主营业务：耐火材料及制品、耐火专业设备通用零部件制造。 住所：鞍钢厂区西部 主要财务数据：截至2018年9月30日止，总资产人民币1,039百万元，净资产人民币930百万元；2018年1–9月份，主营业务收入人民币617百万元，净利润人民币27百万元。 与本公司关系：与本公司受同一实际控制人控制，该关联人符合《深圳证券交易所股票上市规则》第10.1.3条第（二）款规定的关联关系情形。
10	鞍山鞍钢维苏威耐火材料有限公司	法定代表人：唐伟 注册资本：人民币20,000万元 主营业务：耐火材料制品制造等。 住所：鞍山市铁东区环钢路1号(鞍钢厂区内) 主要财务数据：截至2018年9月30日止，总资产人民币827百万元，净资产人民币124百万元；2018年1–9月份，主营业务收入人民币676百万元，净利润人民币40百万元。 与本公司关系：与本公司受同一实际控制人控制，该关联人符合《深圳证券交易所股票上市规则》第10.1.3条第（二）款规定的关联关系情形。
11	德邻陆港（鞍山）有限责任公司	法定代表人：王锋 注册资本：人民币15,366万元 主营业务：钢材销售、道路货物运输、仓储服务。 住所：鞍山市鞍刘路3号 主要财务数据：截至2018年9月30日止，总资产人民币722百万元，净资产人民币174百万元；2018年1–9月份，主营业务收入人民币1,563百万元，净利润人民币6百万元。 与本公司关系：与本公司受同一实际控制人控制，该关联人符合《深圳证券交易所股票上市规则》第10.1.3条第（二）款规定的关联关系情形。
12	鞍钢建设集团有限公司	法定代表人：褚乃立 注册资本：人民币61,120万元 主营业务：冶金、建筑、矿山、市政公用、电力、石油化工、铁路、机电工程总承包；建筑机电设备安装、钢结构、炉窑、起重设备安装、爆破与拆除、地基与基建、土石方、建筑装修装饰、防水防腐保温、环保、管道、消防设施、模板脚手架、建筑幕墙、城市及道路照明、输变电、特种工程；冶金、建筑行业、轻型房屋钢结构设计等。 住所：鞍山市铁东区安乐街34号 主要财务数据：截至2018年9月30日止，总资产人民币4,972百万元，净资产人民币886百万元；2018年1–9月份，营业收入人民币2,797百万元，净利润人民币18百万元。 与本公司关系：与本公司受同一实际控制人控制，该关联人符合《深圳证券交易所股票上市规则》第10.1.3条第（二）款规定的关联关系情形。
13	鞍钢冷轧钢板（莆田）有限公司	法定代表人：赵林 注册资本：人民币150,000万元 主营业务：钢压延加工销售 住所：福建省莆田市秀屿区东庄镇望山东路555号 主要财务数据：截至2018年9月30日止，总资产人民币2,196百万元，净资产人民币692百万元；2018年1–9月份，主营业务收入人民币451百万元，净利润人民币–50百万元。 与本公司关系：与本公司受同一实际控制人控制，该关联人符合《深圳证券交易所股票上市规则》第10.1.3条第（二）款规定的关联关系情形。
14	鞍钢绿色资源科技有限公司	法定代表人：张贺武 注册资本：人民币66,140万元 主营业务：钢渣制品及水渣粉销售 住所：鞍山市铁西区鞍钢厂内 主要财务数据：截至2018年9月30日止，总资产人民币1,032百万元，净资产人民币682百万元；2018年1–9月份，营业收入人民币437百万元，净利润人民币21百万元。 与本公司关系：与本公司受同一实际控制人控制，该关联人符合《深圳证券交易所股票上市规则》第10.1.3条第（二）款规定的关联关系情形。
15	攀钢钒钛	法定代表人：段向东 注册资本：人民币8,589,746,202元 主营业务：钒钛制品生产、加工和应用服务等。 住所：攀枝花市东区弄弄坪 主要财务数据：截至2018年9月30日止，总资产人民币111百万元，净资产人民币66百万元；2018年1–9月份，营业收入人民币39百万元，净利润人民币9百万元。 与本公司关系：与本公司受同一实际控制人控制，该关联人符合《深圳证券交易所股票上市规则》第10.1.3条第（二）款规定的关联关系情形。

（二）履约能力分析

上述关联人与本集团长期合作，一直为本集团提供原材料、钢材产品、能源动力、辅助材料、支持性服务、金融服务，同时也采购本集团部分产品、废旧物资及综合性服务等。相关协议中约定的定价原则是依据市场化原则制定，交易金额上限也是考虑了双方产能而确定。因此，上述关联人有能力按协议约定向本公司提供相关的原材料、钢材产品、能源动力、辅助材料、支持性服务、金融服务，并会按照协议约定采购本公司的相关产品、废旧物资及综合性服务等。

三、关联交易主要内容

（一）关联交易的主要内容

1、关联人向本集团提供的主要原材料、钢材产品、辅助材料、能源动力、支持性服务、金融服务。

2、本集团向关联人提供的产品、筛下粉、废钢料、废旧物资和综合性服务。

（二）关联交易协议情况

本次预计2019年度日常关联交易的项目及金额上限乃根据公司股东大会批准的《原材料和服务供应协议（2019–2021年度）》、《原材料供应协议（2019–2021年度）》和《金融服务协议（2019–2021年度）》所载的内容与交易金额预计上限而作出。相关交易的定价原则见下表：

关联交易类型	关联交易内容	关联交易定价原则
向关联方采购主要原材料	铁精矿	不高于（T–1）*月《SBB钢铁市场日报》每日公布的普氏65%铁CFR中国北方（青岛港）中点价的平均值，加上鲅鱼圈港到鞍钢股份的运费。其中品位调价以（T–1）*月普氏65%指数平均值计算每个铁含量的价格进行加减价。并在此基础上给予金额为（T–1）*月普氏65%指数平均值3%的优惠
	球团矿	市场价格
	烧结矿	铁精矿价格加上（T–1）*月的工序成本。（其中：工序成本不高于鞍钢股份生产同类产品的工序成本）
	卡拉拉矿产品	优质产品：市场价格
		标准产品：装货点完成装货所在月，《SBB钢铁市场日报》每日公布的普氏65%铁CFR中国北方（青岛港）中点价的平均值加上青岛港到辽宁鲅鱼圈的干吨运费差，除以65乘以实际品位计算价格
		低标产品：装货点完成装货所在月，《SBB钢铁市场日报》每日公布的普氏62%铁CFR中国北方（青岛港）中点价的平均值加上青岛港到辽宁鲅鱼圈的干吨运费差，除以62乘以实际品位计算价格
	废钢	市场价格
	钢坯、钢锭	市场价格
	合金和有色金属	市场价格
	焦炭、煤炭	市场价格
向关联方采购钢材产品	钢材产品	按鞍钢股份销售给第三方的价格扣除人民币20–35元/吨的代销费后的价格确定
向关联方采购能源动力	电	国家定价
	水	
	蒸汽	生产成本加5%毛利
	气体产品	市场价格或生产成本加5%的毛利
向关联方采购辅助材料	石灰石	不高于鞍钢有关成员公司售予独立第三方的价格
	白灰	
	耐火材料	
	备件备品	
	其他辅助材料	
	可再生资源	
向关联方采购支持性服务	铁路运输及服务	国家定价或市场价格
	道路、管道运输及服务	
	代理服务：	佣金不高于1.5%
	– 原燃材料、设备、备件和辅助材料进口	其中：原燃料代理费5元/吨
	– 产品出口	
	– 招投标、电商平台交易	
	设备检修及服务	市场价格
	设计及工程服务	
	职业技术教育、在职职工培训、翻译服务	
	报纸及其它出版物	国家定价
	电讯业务、电讯服务、信息系统	国家定价、市场定价或折旧费+维护费
	生产协力及维护	按市场价格支付劳务费、材料费及管理费
	生活协力及维护	
	公务车服务	市场价格
	环保、安全、节能检测、医疗卫生服务	国家定价
	业务招待、会议费用	市场价格
	绿化服务	按市场价格支付劳务费、材料费及管理费
	保卫服务	
	港口代理服务	市场价格
	土地租赁	市场价格
	废水处理费	市场价格
	水上运输及服务	市场价格
	带料加工	市场价格或不高于鞍钢股份集团加工成本加5%毛利
向关联方销售商品	钢材产品	鞍钢股份集团售予独立第三方的价格；就为对方开发新产品所提供的上述产品而言，定价基准则为如有市场价格，按市场价格定价，如无市场价格，按成本加合理利润原则，所加合理利润率不高于提供有关产品成员单位平均毛利率
	铁水	
	钢坯	
	焦炭	
	钢铁生产副产品	
	煤炭	采购成本价加价5元/湿吨
	进口矿	采购成本价加价5元/干吨
	烧结矿	市场价格
	球团矿	鞍钢集团销售给第三方的价格扣除不高于1.5%代销费后的价格确定
向关联方销售废钢料、废旧物资	废钢料	市场价格
	废旧物资	
	报废资产或闲置资产	市场价格或评估价格
向关联方销售综合服务	电、新水	国家定价
	净环水、污环水、软水、煤气、蒸汽、氮气、氧气、氩气、压缩空气、氢气、余热水、液氧、液氮、液氩、气体产品	市场价格或生产成本加5%的毛利
	产品测试服务	市场价格
	代理服务	佣金不高于1.5%
	资产委托管理	市场价格
	运输服务	市场价格
	取暖费	国家定价或市场价格
关联方向本公司提供金融服务	结算资金存款利息	结算资金以协定存款方式进行，利率水平按照中国人民银行统一颁布的协定存款年利率1.15%执行（随国家政策变化调整），高于中国人民银行统一颁布的活期存款年利率0.35%（随国家政策变化调整），也高于规定的活期存款年利率浮动上限。同时，不低于同期国内主要商业银行同类存款的存款利率，也不低于乙方向鞍钢其它成员单位提供存款业务的利率水平。
	最高存款每日余额	
	（包括应计利息）	
	贷款、贴现及委托贷款利息	利率不高于在国内其他金融机构取得的同期同类档次贷款利率

日常关联交易协议的具体内容见刊登于2018年10月17日《中国证券报》和巨潮资讯网www.cninfo.com.cn的《鞍钢股份有限公司关于签署日常关联交易协议的公告》、《鞍钢股份有限公司与鞍钢集团财务有限责任公司签署（金融服务协议（2019–2021年度））的关联交易公告》。

四、交易目的和对上市公司的影响

钢铁生产具有较强的连续性，公司大部分原料、服务采购于鞍钢集团及其下属公司，同时也要销售产品等给鞍钢集团及其下属公司。上述关联交易的存续，有利于保证公司的生产经营的连续性和稳定性，对公司的生产经营的正常运行有积极的影响。

五、独立董事意见

上述关联交易事项经过了公司独立董事事前审查，所有独立董事均同意将上述关联交易议案提交董事会审议。经过认真地审阅及审慎地调查，独立董事对本次交易发表独立意见如下：

1. 关联董事就该议案在董事会会议上回避表决，表决程序符合有关法律、法规和《公司章程》的规定，关联交易遵循了公正、公允的原则，符合法定程序。

2. 公司预计的2019年度日常关联交易（1）为公司在日常业务过程中进行的交易；（2）是按照一般商业条款进行，或不逊于独立第三方提供的交易条款进行，或（如无可参考比较者）对公司股东而言公平合理的条款进行的；（3）交易条款公平合理，且符合公司及公司股东的整体利益，不会损害非关联股东的利益及中小股东的利益；（4）预计2019年度日常关联交易上限符合公司未来发展需求，有利于公司的生产经营的正常运行；（5）预计2019年度日常关联交易上限未超过经股东大会批准的《原材料和服务供应协议（2019–2021年度）》、《原材料供应协议（2019–2021年度）》和《金融服务协议（2019–2021年度）》上载明的适用于该等类别的相关上限。

六、备查文件

1、本公司第七届董事会第五十三次会议决议；

2、独立董事事前意见及独立董事意见；

3、深交所要求的其他文件。

鞍钢股份有限公司

董事会

2019年3月18日

证券代码：000898　　证券简称：鞍钢股份　　公告编号：2019–006

鞍钢股份有限公司关于2019年开展商品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、误导性陈述或者重大遗漏。

为规避现货市场价格波动风险，确保公司稳健发展，根据《深圳证券交易所主板上市公司规范运作指引》等相关规定，结合公司业务发展的实际需要，2019年公司继续开展商品期货套期保值业务（以下简称“套期保值业务”），现将相关情况说明如下：

一、履行合法表决程序的说明

2019年3月18日，公司第七届董事会第五十三次会议以7票同意，0票反对，0票弃权的表决结果审议批准了《关于公司2019年度套期保值业务额度的议案》。

该业务不属于关联交易事项，无需履行关联交易表决程序。

公司计划2019年度进行套期保值的最高保证金为人民币5亿元，占公司最近一年经审计净资产的0.95%。根据《深圳证券交易所股票上市规则》、《香港联合交易所证券上市规则》及《公司章程》的有关规定，该事项获本公司董事会审议通过后，无需提交股东大会审议。

二、开展套期保值业务的目的及必要性

公司开展钢铁期货保值业务有利于企业通过套期保值回避价格波动风险，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，有利于形成良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。套期保值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、开展套期保值业务概述

1、交易品种

仅限于公司经营范围内的钢铁产业链品种，包括铁矿石、动力煤、焦煤、焦炭、螺纹钢、热轧卷板、有色金属、合金等产品。随其他品种（废钢、不锈钢、原油）上市，可根据公司生产实际需求，在批准的年度保证金最高金额范围内，适当调整交易品种与额度计划。

2、交易原则

依据公司生产经营计划，在采购和销售指标的90%范围内，开展期货业务。

3、交易数量

2019年度各品种的套期保值量为：钢材约140万吨，铁矿石约460万吨，焦煤、焦炭和动力煤约455万吨，有色金属约2.45万吨，铁合金约6万吨。

4、保证金最高金额

根据最高持仓量确定最高保证金，公司进行套期保值的年度最高保证金为人民币5亿元。

5、有效期

截至2019年12月31日止年度。

6、检查与监督

董事会要求公司企业管理部（期货交易的监督部门）对公司开展套期保值业务的必要性与合规性进行审查监督，负责对《鞍钢股份有限公司商品期货套期保值管理办法》的执行情况进行检查和监督。

四、管理制度

依据《鞍钢股份有限公司商品期货套期保值管理办法》。

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、公司为规范套期保值的交易行为，加强对套期保值业务的监督管理，在相关法律法规、政策的基础上，出台了《鞍钢股份有限公司商品期货套期保值管理办法》，对公司套期保值业务的原则、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交易部，按《鞍钢股份有限公司商品期货套期保值管理办法》规定程序对公司的套期保值策略、套期保值方案、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、套期保值业务风险管理策略说明

公司套期保值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，套期保值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套保。在制定套期保值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。套期保值计划设定止损目标，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、套期保值品种公允价值分析

公司套期保值交易品种为上海期货交易所上市的螺纹钢、线材、热轧卷板、镍、铝、锌、铜等有色金属；大连商品交易所上市的铁矿石、焦煤、焦炭；郑州商品交易所硅铁、锰硅等铁合金，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–套期保值》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如下：

（1）公司在保证正常生产经营的前提下，使用自有资金开展期货套期保值业务履行了相关的审批程序，符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定，有利于公司降低经营风险，不存在损害公司和全体股东利益的情况。

（2）公司建立了《鞍钢股份有限公司商品期货套期保值管理办法》，明确了业务操作流程、审批流程及风险防控等内部控制程序，对公司控制期货风险起到了保障的作用。

（3）公司确定的年度套期保值保证金的最高额度和交易品种合理，符合公司的实际生产经营情况，有利于公司合理的控制交易风险。

特此公告。

鞍钢股份有限公司

董事会

2019年3月18日

证券代码：000898　　证券简称：鞍钢股份　　公告编号：2019–008

鞍钢股份有限公司关于召开2018年度股东大会的通知

本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、召开会议基本情况

1、会议届次：鞍钢股份有限公司 2018年度股东大会

2、会议召集人：本公司董事会

2019年3月18日，本公司第七届董事会第五十三次会议批准本公司于2019年5月28日召开2018年度股东大会。

3、会议召开的合法、合规性：鞍钢股份有限公司 2018年度股东大会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。

4、会议召开的日期、时间：2019年5月28日14:00时整。

网络投票时间为：2019年5月27日–2019年5月28日，其中，通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的具体时间为：2019年5月28日9:30–11:30，13:00–15:00；通过深圳证券交易所互联网投票系统投票的具体时间为：2019年5月27日15:00至2019年5月28日15:00期间的任意时间。

5、会议召开方式：采用会议现场表决和网络投票相结合的方式召开。

公司将同时通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统（http://wltp.cninfo.com.cn）向公司 A 股股东提供网络形式的投票平台，A股股东可以在网络投票时间内通过上述系统行使表决权。同一表决权只能选择现场、网络或其他表决方式中的一种，同一表决权出现重复表决的，以第一次表决结果为准。

6、会议的股权登记日：2019年4月26日

7、出席对象：

（1）在股权登记日持有本公司股份的普通股股东或代理人。

于股权登记日下午深圳证券交易所营业时间结束时在中国证券登记结算公司深圳分公司登记在册的持有本公司 A 股股份的股东，以及于股权登记日下午香港联合交易所营业时间结束时在香港证券登记有限公司登记在册的持有本公司H 股股份的股东均有权出席股东大会，并可以以书面形式委托代理人出席会议和参加表决，该股东代理人不必是本公司股东。

（2）本公司董事、监事、高级管理人员。

（3）本公司董事会邀请的人员及见证律师。

（4）根据相关法规应当出席股东大会的其他人员。

因故不能出席会议的股东，可委托授权代理人出席，但需要授权人委托书（授权委托书样式见附件1）及本人身份证。

8、会议召开地点：鞍钢东山宾馆会议室（中国辽宁省鞍山市铁东区东风街 108 号）。

二、会议审议事项

以普通决议案方式审议如下事项：

议案1、审议《2018年度董事会工作报告》。

议案2、审议《2018年度监事会工作报告》。

议案3、审议《2018年度报告及其摘要》。

议案4、审议《2018年度审计报告》。

议案5、审议《2018年度利润分配方案》。

议案6、审议《关于2018年度董事及监事酬金的议案》。

议案7、审议《关于聘任信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）担任公司2019年度审计师并授权公司董事会决定其酬金的议案》。

以特别决议案方式审议如下事项：

议案8、审议《关于授予董事会增发公司H股股份及其他可转让权利的一般性授权的议案》。

议案9、审议《关于公司在深圳证券交易所发行资产支持证券的议案》。

以普通决议案方式审议如下事项：

议案10、审议《关于选举第八届董事会执行董事的议案》。

本议案采用累积投票方式表决。应选执行董事人数为4人。

（1）选举王义栋先生为公司第八届董事会执行董事。

（2）选举李镇先生为公司第八届董事会执行董事。

（3）选举马连勇先生为公司第八届董事会执行董事。

（4）选举谢俊勇先生为公司第八届董事会执行董事。

议案11、审议《关于选举第八届董事会独立非执行董事的议案》。

本议案采用累积投票方式表决。应选独立非执行董事人数为4人。独立非执行董事候选人的任职资格和独立性尚需经深圳证券交易所备案审核无异议，股东大会方可进行表决。

（1）选举吴大军先生为公司第八届董事会独立非执行董事。

（2）选举马卫国先生为公司第八届董事会独立非执行董事。

（3）选举冯长利先生为公司第八届董事会独立非执行董事。

（4）选举汪建华先生为公司第八届董事会独立非执行董事。

议案12、审议《关于选举第八届监事会股东代表监事的议案》。

本议案采用累积投票方式表决。应选股东代表监事人数为2人。

（1）选举路永利先生为公司第八届监事会股东代表监事。

（2）选举刘晓晖女士为公司第八届监事会股东代表监事。

特别提示：议案10、议案11、议案12采用累积投票方式表决。股东所拥有的选举票数为其所持有表决权的股份数量乘以应选人数，股东可以将所拥有的选举票数以应选人数为限在候选人中任意分配（可以投出零票），但总数不得超过其拥有的选举票数。

上述议案的具体内容见 2019年3月19日刊登于《中国证券报》、《证券时报》或巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn的《鞍钢股份有限公司第七届董事会第五十三次会议决议公告》、《鞍钢股份有限公司第七届监事会第十二次会议决议公告》、《鞍钢股份有限公司2018年度董事会工作报告》、《鞍钢股份有限公司2018年度监事会工作报告》、《鞍钢股份有限公司2018年度报告》及其摘要、《鞍钢股份有限公司2018年度审计报告》等。

公司独立董事将在本次年度股东大会上进行述职。

三、提案编码

表一：本次股东大会提案编码表

提案编码	提案名称	备注
		该列打勾的栏目可以投票
100	总议案：除累积投票提案外的所有提案	√
非累积投票提案		
1	议案1、审议《2018年度董事会工作报告》	√
2	议案2、审议《2018年度监事会工作报告》	√
3	议案3、审议《2018年度报告及其摘要》	√
4	议案4、审议《2018年度审计报告》	√
5	议案5、审议《2018年度利润分配方案》	√
6	议案6、审议《关于2018年度董事及监事酬金的议案》	√
7	议案7、审议《关于聘任信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）担任公司2019年度审计师并授权公司董事会决定其酬金的议案》	√
8	议案8、审议《关于授予董事会增发公司H股股份及其他可转让权利的一般性授权的议案》	√
9	议案9、审议《关于公司在深圳证券交易所发行资产支持证券的议案》。	√
累积投票提案		
10	议案10、审议《关于选举第八届董事会执行董事的议案》	应选人数4人
10.01	选举王义栋先生为公司第八届董事会执行董事	√
10.02