

证券代码：600282 证券简称：南钢股份 公告编号：临2024-020

南京钢铁股份有限公司

关于2024年度继续开展外汇衍生品交易业务暨关联交易的公告

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法律责任。

重要内容提示：

● **交易目的、交易品种、交易工具、交易场所：**鉴于南京钢铁股份有限公司（以下简称“公司”）进出口等相关业务结算币种与记账本位币存在差异且收支不平衡，为防范并降低外汇汇率波动带来的经营风险，公司及下属子公司拟与境内外金融机构开展外汇衍生品交易业务，交易品种为外汇远期，主要通过银行等金融机构（含中信银行股份有限公司及其下属子公司）进行。

● **中信银行股份有限公司（含下属子公司，下同，以下简称“中信银行”）**系本公司实际控制人中国中信集团有限公司控制的公司。根据《上海证券交易所股票上市规则》的相关规定，中信银行为本公司的关联法人，如公司与中信银行开展外汇衍生品交易，则构成关联交易，但不构成《上市公司重大资产重组管理办法》规定的重大资产重组。

● **交易金额：**交易最高额度为**1.5亿美元**（含交易的收益进行再交易的相关金额），在前述最高额度内，可循环滚动使用。其中，单笔交易限额不超过**1,000**万美元，期限不超过**6**个月。最高额度是指期限内任一时点的交易金额。

● **已履行及拟履行的审议程序：**公司于**2024年1月30日**召开第九届董事会第一次会议，审议通过了《关于**2024年度继续开展外汇衍生品交易业务暨关联交易的议案**》。该议案已分别经公司董事会审计与内控委员会、独立董事专门会议审议并全体通过。该议案尚需提交公司**2024年第二次临时股东大会**审议批准，与该关联交易有利害关系的关联人将放弃行使在股东大会上对该议案的投票权。

● 公司及下属子公司开展外汇衍生品交易业务是为提高应对外汇波动风险的能力，防范汇率波动对公司利润和股东权益造成不利影响，有利于增强公司财

务稳健性；交易主要通过银行等金融机构进行，公司将根据业务需要选择适当的金融机构，且交易遵循平等自愿、合作共赢的原则，不存在通过关联交易损害公司股东特别是中小股东利益的情形，对公司独立性没有实质性影响，公司不会因此类交易而对关联人形成依赖。

● 特别风险提示：公司拟开展的外汇衍生品交易业务遵循合法、谨慎、安全和有效的原则，但可能存在市场风险、流动性风险、履约风险、法律风险等风险，敬请投资者注意投资风险。

一、开展外汇衍生品交易业务基本情况概述

（一）交易目的

鉴于公司进出口等相关业务结算币种与记账本位币存在差异且收支不平衡，为防范并降低外汇汇率波动带来的经营风险，公司及下属子公司 2024 年拟与境内外金融机构开展外汇衍生品交易业务。公司及下属子公司外汇衍生品交易业务基于外币资产、负债状况以及外汇收支业务情况具体开展，遵循合法、审慎、安全、有效的原则，不会影响公司主营业务发展。

（二）交易对象

交易主要通过银行等金融机构（含关联人中信银行及其下属子公司）进行，其中，中信银行为公司实际控制人中国中信集团有限公司控制的企业，根据《上海证券交易所股票上市规则》第 6.3.3 条第二款第（二）项的规定，中信银行为本公司的关联法人，如公司与中信银行开展外汇衍生品交易，则构成关联交易。

（三）交易额度

公司及下属子公司 2024 年度开展外汇衍生品交易，申请交易最高额度为 1.5 亿美元（含交易的收益进行再交易的相关金额），在前述最高额度内，可循环滚动使用。其中，单笔交易限额不超过 1,000 万美元，期限不超过 6 个月。最高额度是指期限内任一时点的交易金额。

（四）资金来源

为自有资金，不涉及使用募集资金。

（五）交易方式

公司及下属子公司拟开展的外汇衍生品交易品种为外汇远期，即拟与金融机构按约定的外汇币种、数额、汇率和交割时间，在约定的时间按照合同规定条件完成交割的外汇交易。

（六）交易期限

在本次授权额度范围内于 2024 年度开展。

二、审议程序

公司于 2024 年 1 月 30 日召开第九届董事会第一次会议，审议通过了《关于 2024 年度继续开展外汇衍生品交易业务暨关联交易的议案》。

1、同意公司及下属子公司 2024 年度与金融机构（含关联人中信银行及其下属子公司）继续开展外汇衍生品交易，申请交易最高额度为 1.5 亿美元（含交易的收益进行再交易的相关金额），在前述最高额度内，可循环滚动使用。其中，单笔交易限额不超过 1,000 万美元，期限不超过 6 个月。最高额度是指期限内任一时点的交易金额。

2、同意将该议案提交公司 2024 年第二次临时股东大会审议，并提请股东大会授权公司管理层在此额度范围内根据业务情况、实际需要审批外汇衍生品交易业务申请。

公司董事会审议该议案时，关联董事黄一新、李国忠、郭家骅、陈浩荣、王海勇、肖玲回避对该议案的表决，其他 3 名独立董事一致同意。

该议案已分别经公司董事会审计与内控委员会及独立董事专门会议审议并全体通过。

该议案尚需提交公司 2024 年第二次临时股东大会审议批准，与该关联交易有利害关系的关联人将放弃行使在股东大会上对该议案的投票权。

三、关联交易情况

公司及下属子公司通过银行等金融机构（含关联人中信银行及其下属子公司）开展外汇衍生品交易业务，申请交易最高额度为 1.5 亿美元（含交易的收益进行

再交易的相关金额)，在前述最高额度内，可循环滚动使用。其中，单笔交易限额不超过 1,000 万美元，期限不超过 6 个月。最高额度是指期限内任一时点的交易金额。

（一）关联人基本情况

企业名称：中信银行股份有限公司

统一社会信用代码：91110000101690725E

成立时间：1987年4月20日

注册地址：北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层

法定代表人：方合英

注册资本：人民币48,934,796,573元

经营范围：保险兼业代理业务；吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；代理开放式基金业务；办理黄金业务；黄金进出口；开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。（市场主体依法自主选择经营项目，开展经营活动；依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事国家和本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）

股东情况：中信银行（证券代码：601998.SH）系在上海证券交易所和香港联合交易所上市的公司，其实际控制人为中国中信集团有限公司。

主要财务指标：经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，截至2022年12月31日，中信银行资产总额为85,475.43亿元、负债总额为78,617.13亿元、净资产为6,858.30亿元，资产负债率为91.98%。2022年，中信银行实现营业收入2,113.92亿元、净利润629.50亿元。（合并口径）

截至2023年9月30日，中信银行资产总额为89,220.23亿元、负债总额为

81,985.67亿元、净资产为7,234.56亿元，资产负债率为91.89%。2023年1-9月，中信银行实现营业收入1,562.28亿元、净利润522.62亿元。（合并口径，未经审计）

是否为失信被执行人：否

（二）与上市公司的关联关系

中信银行系本公司实际控制人中国中信集团有限公司控制的公司。根据《上海证券交易所股票上市规则》第6.3.3条第二款第（二）项的规定，中信银行为本公司的关联法人。

（三）履约能力分析

中信银行业务开展正常，经营和效益状况良好，有较强的履约能力。

（四）交易的定价政策及定价依据

公司通过银行等金融机构（含关联人中信银行及其下属子公司）开展外汇衍生品交易按照公平公允的原则进行，交易遵循市场化定价原则，具体将在业务实际开展过程中根据市场情况予以明确。

四、交易风险分析及风控措施

公司及下属子公司开展外汇衍生品交易遵循合法、谨慎、安全和有效的原则，但外汇衍生品交易操作仍存在一定风险，相关风险分析及风控措施如下：

（一）风险分析

1、市场风险

外汇衍生品交易合约汇率与到期日实际汇率的差异将产生交易损益；在外汇衍生品的存续期内，每一会计期间将产生重估损益，至到期日重估损益的累计值等于交易损益。

2、流动性风险

不合理的外汇衍生品的购买安排可能引发公司资金的流动性风险。

3、履约风险

不合适的交易方选择可能引发公司购买外汇衍生品的履约风险。

4、其他风险

在开展交易时，如交易合同条款不明确，将可能面临法律风险。

(二) 风控措施

1、公司外汇衍生品交易行为均以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，以规避和防范汇率风险为目的，遵循套期保值原则。

2、公司将结合外汇收支实际及计划，适时选择合适的外汇衍生品，所有外汇衍生品交易均以正常的贸易及业务背景为前提。

3、公司选择对手均应拥有良好信用且与公司已建立长期业务往来的金融机构，履约风险低。

4、公司将审慎审查与合作银行签订的合约条款，严格执行风险管理制度，以防范法律风险。

五、对公司的影响

公司及下属子公司开展外汇衍生品交易业务是为提高应对外汇波动风险的能力，防范汇率波动对公司利润和股东权益造成不利影响，有利于增强公司财务稳健性；交易主要通过银行等金融机构进行，公司将根据业务需要选择适当的金融机构，且交易遵循平等自愿、合作共赢的原则，不存在通过关联交易损害公司股东特别是中小股东利益的情形，对公司独立性没有实质性影响，公司不会因此类交易而对关联人形成依赖。

公司根据财政部《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》《企业会计准则第 24 号——套期保值》《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》相关规定及其指南，对拟开展的金融衍生品交易业务进行相应的核算处理，反映资产负债表及损益表相关项目。具体以年度审计结果为准。

特此公告

南京钢铁股份有限公司董事会

二〇二四年一月三十一日