

香港交易及結算所有限公司及香港聯合交易所有限公司對本公告的內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示，概不對因本公告全部或任何部分內容而產生或因倚賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。



Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Company Limited

鄭州煤礦機械集團股份有限公司

(在中華人民共和國註冊成立的股份有限公司)

(股份代碼：00564)

海外監管公告

本公告乃根據香港聯合交易所有限公司證券上市規則第13.10B條作出。

茲載列鄭州煤礦機械集團股份有限公司在上海證券交易所網站及中國報章刊登公告如下，僅供參閱。

承董事會命
鄭州煤礦機械集團股份有限公司
主席
焦承堯

中國，鄭州，2019年3月26日

於本公告日期，本公司執行董事為焦承堯先生、賈浩先生、向家雨先生、付祖岡先生、王新瑩先生及汪濱先生；而獨立非執行董事為劉堯女士、江華先生及李旭冬先生。

郑州煤矿机械集团股份有限公司

套期保值业务管理制度

第一章 总则

第一条 为适应郑州煤矿机械集团股份有限公司（简称“郑煤机”或“公司”）及子公司业务需求及全球化发展的需要，规范套期保值交易业务，有效防范和控制风险，维护公司及股东利益，依据《中华人民共和国证券法》、《上市公司信息披露管理办法》、《上海证券交易所股票上市规则》（“《上市规则》”）、《企业内部控制基本规范》、《企业会计制度》等法律、法规、规范性文件以及《郑州煤矿机械集团股份有限公司章程》（“《公司章程》”）的有关规定，结合公司实际情况，特制定本制度。

第二条 本制度适用于郑煤机及其控股子公司的套期保值业务。

第三条 本制度所涉及的套期保值业务主要针对与郑煤机及其控股子公司经营相关的大宗商品原材料、经营相关汇率价格变动。本制度所规定的套期保值业务相关的金融衍生品主要包括期货、期权、远期、互换等。

第四条 公司及其控股子公司应当以其公司法人名义开立套期保值交易账户，不得使用他人账户进行套期保值业务。

第五条 公司套期保值业务必须遵守所在国家和地方的法律法规，符合公司发展战略，与资产结构相适应、与经营需要相关，规模适度，不能影响自身主营业务的发展，注重风险防范和资金安全。

第六条 公司进行套期保值业务的资金来源为自有资金，不得使用募集资金直接或间接进行套期保值业务。

第七条 公司进行套期保值业务的数量原则上不得超过实际现货交易的数量，期货持仓量应不超过套期保值的现货量。

第二章 套期保值业务管理机构及职权

第八条 公司套期保值业务管理体系包括：公司董事会、套期保值业务领导小组、具体实施单位。职责分工如下：

1. 董事会职责如下

(1) 审议公司套期保值业务管理制度；

(2) 审议年度套期保值业务计划（超出董事会审批权限的需提交公司股东大会审议）。

2. 套期保值业务领导小组为日常执行机构，履行套期保值业务管理职责，其成员包括：总经理、财务总监、财务部负责人、法务审计部负责人及套期保值业务有关的其他人员；主要职责如下：

(1) 建立健全公司套期保值交易相关制度，并贯彻实施；；

(2) 负责召开套期保值业务工作会议，拟订年度套期保值业务计划，并提交公司董事会、股东大会（如需）审议；

(3) 在年度套期保值业务计划范围内，编制、审批、执行套期保值具体交易方案；

(4) 向公司董事会汇报套期保值业务工作情况；

(5) 负责对公司从事套期保值业务交易进行监督管理；

(6) 负责交易风险的应急处理；

(7) 其他与套期保值业务相关的日常联系和管理工作。

子公司内部，由其经营管理层或董事会承担前述小组的职责，子公司套期保值年度计划和方案需报郑煤机批准。

第九条 公司至少每 12 个月审议一次年度套期保值业务计划。公司董事会审议年度套期保值业务计划；按《上市规则》、《公司章程》及其他公司内部治理制度规定，年度套期保值业务计划金额超出董事会审批权限的，需提交公司股东大会审议通过；套期保值领导小组负责审批和执行该计划范围内的套期保值业务具体方案。

第十条 在授权有效期限内，经审议通过的年度套期保值业务计划金额可以循环使用。任一时点，公司套期保值协议合计金额不得超出已经审批的金额，超

出部分应该按照审批权限履行审批手续。

第三章 业务流程

第十一条 公司套期保值业务流程分为：套期保值业务计划和方案审批流程、套期保值业务执行流程。

第十二条 套期保值业务计划和方案审批流程如下：

1. 年度套期保值业务计划审批流程：

套期保值业务领导小组收集资料，起草公司年度套期保值计划，提交董事会、股东大会（如需）审议，并根据审议通过后的年度套期保值计划执行。

2. 套期保值业务方案审批流程：

公司相关业务部门根据实际业务情况制定套期保值方案，报公司套期保值业务领导小组审批，批准后由该业务部门组织实施。子公司套期保值方案由子公司套期保值业务领导小组制订并经子公司董事会集体决议，报公司套期保值业务领导小组审批，批准后方可实施。

第十三条 套期保值业务执行流程如下：

套期保值业务方案经审批通过后，由公司或子公司指定专员与金融机构按照规定的授权范围进行操作。财务部应每季度统一汇总公司内部各单位套期保值业务盈亏情况，上报套期保值业务领导小组，并根据风险大小和信息披露要求，及时将有关情况告知战略发展部。

公司审计部门应不定期对套期保值业务的实际操作情况、资金使用情况和盈亏情况进行审计，检查交易是否符合规定，并将审计结果向董事会报告。

第四章 风险管理

第十四条 公司及子公司在开展套期保值业务时，应建立严格有效的风险管理机制，利用事前、事中及事后的风险防控措施，防控和化解信用风险、市场风险、操作风险和法律风险。

第十五条 内部风险报告制度和风险处理程序

1. 内部风险报告制度：

(1) 当市场价格波动较大或发生异常波动的情况时，业务部门应立即向套期保值业务领导小组组长报告；出现影响套期保值业务方案继续实施的情况或参与人员出现违规违纪行为的，应立即向套期保值业务领导小组组长及上市公司董事长报告。

(2) 子公司套期保值业务出现重大风险或可能出现重大风险时，应立即向上市公司董事长报告。

(3) 触发上市公司信息披露要求的，公司应及时履行信息披露义务。

2. 风险处理程序：

1. 套期保值业务领导小组召集相关业务部门召开风险处理工作会议，分析风险情况及应采取的对策，形成风险控制方案并实施。必要时，召开董事会进行决策。

2. 如遇紧急情况，可先按套期保值业务方案中的风险控制措施执行，再召开套期保值风险处理工作会议。

第五章 保密及档案管理

第十六条 套期保值业务相关人员必须遵守公司相关的保密制度。

第十七条 相关人员未经允许不得泄露本公司及子公司套期保值方案、交易情况、结算概况、资金状况等与套期保值交易有关的信息。

第十八条 套期保值业务的开户文件、交易资料、结算资料等原始档案保存期限至少 15 年。

第六章 法律责任

第十九条 套期保值业务相关人员违反公司规章制度进行操作，因此对公司造成的损失，由违规操作者对交易风险或损失承担责任，若构成犯罪的依法追究其刑事责任。

第二十条 套期保值业务相关人员违反保密制度，因此对公司造成的损失，

由违规操作者对损失承担赔偿责任，若构成犯罪的依法追究其刑事责任。

第七章 附则

第二十一条 本制度未尽事宜，依照国家有关法律、法规、规范性文件以及本《公司章程》的有关规定执行。本制度与有关法律、法规、规范性文件以及《公司章程》的有关规定不一致的，以有关法律、法规、规范性文件以及《公司章程》的规定为准，并由公司董事会及时修订。

第二十二条 本制度由公司董事会负责解释，自公司董事会审议通过后生效并施行。

郑州煤矿机械集团股份有限公司

2019年3月26日