

## 鲁泰纺织股份有限公司

### 衍生品交易计划公告

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、对外投资概述

公司第八届董事会第七次会议审议通过了《鲁泰纺织股份有限公司衍生品交易计划的议案》，表决情况为13票同意、0票反对、0票弃权。董事会同意公司开展包括但不限于远期结售汇、远期外汇买卖、货币互换、货币和利率掉期、期权及其组合等金融衍生交易品种投资，交易币种包括但不限于美元、欧元、日元、瑞郎、港币，交易总额不超过公司上年度外汇收入额的100%，即折美元不超过64885万美元。公司第八届独立董事已就该衍生品交易计划发表了独立意见。该衍生品交易计划不需股东大会审议。

#### 二、对外投资的主要内容

公司开展金融衍生品投资业务是为了满足生产经营进出口业务的风险管理需要，不做投机性、套利性的交易操作。

1、金融衍生品交易主要品种：公司拟开展的金融衍生品交易业务主要针对进出口业务和外币债务，利用各商业银行提供的远期结售汇、远期外汇买卖，货币和利率掉期、货币互换、期权及其组合等金融衍生产品规避汇率和利率风险，最大限度降低汇率、利率波动对公司的影响。

2、业务期间、交易对手和金融衍生品交易金额：业务期间为2017年7月1日至2018年6月30日；交易对手为相关金融机构；所做衍生品交易总金额折美元不超过64885万美元。

3、金融衍生品交易流动性安排：所有金融衍生品交易业务均对应正常合理的进出口业务和外币债务，与收付款时间相匹配，不会对公司的流动性造成影响。

#### 三、对外投资的目的

公司业务以进出口为主，产品出口比例一直在70%左右，出口收汇几乎全部是美

元，其中超过70%需结为人民币在国内用于支付，因此，每年结汇量较大。人民币汇率的波动对公司以美元计价的出口收入构成较大的风险。2017年计划进口除支付美元外，还有部分欧元、日元、瑞朗等，也面临着汇率波动风险。

至2017年3月31日，公司共有外币借款美元8017万、欧元361万，利率的波动也可能对公司产生不利影响。对这些外币支付需求及负债带来的风险，有必要采取措施加以规避。

#### **四、公司投资衍生品的准备情况**

公司第六届董事会第一次会议审议通过了《鲁泰公司衍生品交易管理制度》，公司七届十五次董事会对该制度进行了修订，更加明确了衍生品交易的相关组织机构、人员职责与分工、审批流程、操作流程及风险控制等相关内容。

#### **五、对外投资存在的风险和影响**

1、信用风险：本交易计划区间控制在12个月之内，分批、分阶段实施，交易对手为境内外金融机构，因此违约风险很低。即便出现非常特殊的情况不能按期交割，也可通过掉期交易加以展期，使公司有能力严格控制违约风险的发生。

2、市场风险：当国际、国内经济形势发生变化时，相应的汇率、利率波动将可能对公司金融衍生品交易产生不利影响，公司将及时根据市场变化调整交易策略。

3、资金流动性风险：如果公司未能在合约到期时及时结算或不能收回合约约定的额度的外汇，将会给公司的资金流动性造成影响。

#### **六、备查文件**

- 1、鲁泰纺织股份有限公司2017年衍生品交易计划。
- 2、鲁泰纺织股份有限公司第八届董事会第七次会议决议。

鲁泰纺织股份有限公司董事会

二零一七年四月二十八日