

## 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二十六次会议审议通过了《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14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，交易总额不超过公司上年度外汇收入额的100%，即折美元不超过76483.06万美元。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保值需要，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2019年7月1日至2020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76483.06万美元。

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

公司的日常资金支出币别主要为人民币、美元、越盾、缅币。国内公司资金支出中超过70%用人民币结算，结汇量较大；境外子公司支出除美元外，还有一

部分需以美元兑换为本国或其他币别支出。因此，汇率的波动对公司自有美元外汇构成较大的风险。

至2019年3月31日，公司共有美元借款13976.71万元、越南盾借款150.97亿，利率的波动也可能增加公司财务费用。为了防范外汇市场风险，降低汇率、利率波动对公司生产经营、成本控制的不利影响，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》，公司第七届董事会第十五次会议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、市场风险:当国际、国内经济形势发生变化时,相应的汇率、利率变化可能对公司金融衍生品交易产生不利影响。

2、流动性风险和信用风险: 若合约到期公司或交易对手因流动性或流动性以外的其它因素导致不能按合约规定履约，都会产生信用风险，进而会给公司造成经济损失。

3、操作风险：衍生品交易专业性较强，复杂程度较高，不完善的内部操作流程、员工以及外部事件会导致公司在衍生品交易过程中承担风险。

4、法律风险：公司从事衍生品交易必须严格遵守国家相关法律法规，若没有规范的操作流程和严格的审批程序，易导致所签署的合同、承诺等法律文件的有效性和可执行性存在合规性风险和监管风险。

#### **六、备查文件**

- 1、鲁泰纺织股份有限公司衍生品交易计划。
- 2、鲁泰纺织股份有限公司第八届董事会第二十六次会议决议。

鲁泰纺织股份有限公司董事会

二零一九年四月三十日