

鲁泰纺织股份有限公司衍生品交易计划公告

公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

一、履行的表决程序：公司审计委员会审核了衍生品交易计划的可行性和必要性，并出具了书面意见。公司第六届董事会第二十八次会议以14票同意、0票反对、0票弃权的表决结果审议通过《鲁泰纺织股份有限公司2013年衍生品交易计划的议案》，同意公司提报的衍生品交易计划，开展包括但不限于远期结售汇、远期外汇买卖、货币互换、货币掉期和利率掉期等金融衍生交易品种，交易币种包括但不限于美元、欧元、日元、瑞郎、港币等外币，交易总额折美元不超过2012年度创汇额的100%，即70,300万美元。

二、开展金融衍生品交易的必要性

2013年3月底以来，人民币对美元汇率持续升值，5月2日人民币汇率中间价为1美元对人民币6.2082元，创人民币中间价纪录新高水平。从年初至5月2日人民币已升值1.31%。公司业务以进出口为主，产品出口比例一直在70%以上，2013年，计划出口额56664万美元，出口收汇几乎全部是美元，采购支出中超过60%在国内用人民币支付，因此，每年结汇量较大，人民币升值对公司以美元计价的出口收入构成极大的风险。2013年计划进口额折美元14960万，其中欧元739.19万元、日元61903.93万元、瑞朗83.29万元，因此面临着较大的汇率波动风险。至2013年4月30日止，公司共有外币借款美元6653万元，利率的波动也可能增加公司财务费用。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。

三、金融衍生品交易计划的概述：公司拟开展的金融衍生品交易业务与日常经营紧密联系，以真实的进出口业务为依托，以规避和防范汇率、利率风险为目的。

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，为规避公司所面临的种种汇率和利率风险，利用各商业银行提供的远期结售汇、远期外汇买卖，货币及利率掉期、货币互换等金融衍生产品规避

汇率风险和利率风险，最大限度降低汇率、利率波动对公司的影响。

2、业务期间、对象和金融衍生品交易金额：业务期间为2013年7月1日至2014年6月30日，交易对象为境内金融机构，业务总金额累计不超过2012年度创汇额的100%，即70,300万美元。

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。

四、前期准备

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》，2010年6月5日刊登在巨潮资讯网站（<http://www.cninfo.com.cn>）。该制度明确了相关组织机构、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。公司第六届董事会第二十八次会议审议通过了《鲁泰纺织股份有限公司2013年衍生品交易计划》。

五、金融衍生品交易业务的风险分析

1、信用风险：本方案交易区间控制在12个月之内，可预见性强，交易对方均为境内金融机构，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、利率将可能对公司金融衍生品交易产生不利影响，比如人民币发生大幅度贬值，执行交易合同可能会给公司造成重大损失。但是根据目前人民币总体走势以及国际国内政治经济形势判断，未来12个月内人民币发生大幅度贬值的可能性比较小。如果签约后发生人民币大幅贬值的情况，公司将及时寻求各专业银行帮助，采取力所能及的措施将损失减小到最低限度。

六、风险管理策略

公司将按照《鲁泰公司衍生品交易管理制度》、《鲁泰纺织股份有限公司2013年衍生品交易计划》的规定严格履行相应的审批监管程序，财务部作为公司金融衍生品交易的经办部门，将严格执行公司的相关规定，时时关注汇率市场变化，注重对外汇相关知识的学习和对外汇交易信息的收集并根据汇率变化情况及时调整，多询价、多比价、分批次、分金额，及时向公司有关部门汇报。严格控制交易规模，集体研究，控制重大风险发生。

七、公允价值分析：公司按照《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》

相关规定进行确认计量，公允价值按照银行提供的价格厘定，企业每季进行公允价值计量与确认，并按有关规定履行信息披露义务。

八、会计政策及核算原则： 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37号—金融工具列报》相关规定及其指南，对已开展的金融衍生品业务进行相应的核算处理。

九、独立董事意见： 公司出口收入占公司总收入的 70% 以上，目前面临人民币升值的压力，董事会提出的衍生品交易计划，是在保证正常经营的前提下，使用自有资金进行衍生品交易有利于规避人民币汇率变动风险，是规避汇率风险的有效工具。通过加强内部控制，落实止损和风险防范措施，有利于提高公司抵御汇率波动的能力，提高经营管理水平。董事会提出的衍生品交易计划是可行的，必要的、风险是可以控制的，不存在损害公司和全体股东利益的情况。

特此公告

鲁泰纺织股份有限公司董事会

二零一三年五月十六日