

## 重庆水务集团股份有限公司委托理财公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实、准确和完整承担个别及连带责任。

重要内容提示：

- 委托理财受托方：长江证券股份有限公司
- 委托理财金额：人民币 20,000 万元
- 委托理财投资类型：结构化收益产品
- 委托理财期限：182 天

### 一、委托理财概述

（一）为提高暂存资金效益，重庆水务集团股份有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）近日与长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）签署了《中国证券期货市场场外衍生品交易主协议（2014 年版）》（协议编号：2014-0608 号）、《中国证券期货市场场外衍生品交易主协议（2014 年版）补充协议》（协议编号 2014-0609 号）及《长江证券股份有限公司“掌柜理财”交易确认书》（协议编号 2014-0610 号），并于 2014 年 9 月 24 日出资 20,000 万元人民币投资长江证券“掌柜理财”产品（以下简称“本理财产品”），期限 182 天，预期年化收益率不低于 6.1%。

本次委托理财不构成关联交易。

（二）公司内部需履行的审批程序

公司本次购买委托理财产品已经公司投融资及担保管理小组审议通过。

## 二、委托理财协议主体的基本情况

本次委托理财协议主体的对方为长江证券股份有限公司，与本公司不存在产权、人员等关系。

## 三、委托理财合同的主要内容

### （一）基本说明

1、长江证券“掌柜理财”产品是已向中国证券业协会备案、与符合条件的机构客户通过签订《中国证券期货市场场外衍生品交易主协议》、《中国证券期货市场场外衍生品交易主协议补充协议》和《交易确认书》的形式约定本金、收益率和投资期限等条款，到期向客户偿付本金并支付协议约定的结构化收益的产品。

长江证券“掌柜理财”产品的投资者为符合条件的机构投资者，其交易对手（即资金募集方）为长江证券，其交易本金投向为长江证券融资融券业务、股票质押融资业务以及约定式购回业务等信用类业务。

2、公司本次以自有资金 20,000 万元人民币投资长江证券“掌柜理财”的期限为 182 天，预期年化收益率不低于 6.1%。

### （二）产品核心要素

1、交易起始日：以甲方（长江证券，下同）在实际收到本条款规定的交易本金之日起下一交易日为本交易的起始日；

2、交易到期日：自交易起始日起第 182 个自然日，如到期日为节假日，则自动顺延至下一个工作日；若发生本条第 10 款“交易的提

前终止”中约定的提前终止事件，则交易到期日为协议提前终止日。

3、交易本金及币种：20,000万元人民币，乙方（本公司，下同）应在本协议签订后的五个工作日内完成交易本金的划付，若乙方未在该期限内完成交易本金的划付，则本协议自动失效；

4、本交易的交易本金投向为长江证券融资融券业务、股票质押融资业务以及约定式购回业务等信用类业务；

5、交易挂钩标的：沪深 300 指数（代码：399300）；

6、期初价格：交易起始日沪深 300 指数前一日收盘点数；

7、期末价格：交易到期日沪深 300 指数当日收盘点数；

8、约定收益：

（1）若挂钩标的从交易起始日（含）至交易到期日（含）涨跌幅不低于-50%且不高于 100%，乙方的约定年化收益率为6.1%；

（2）若挂钩标的从交易起始日（含）至交易到期日（含）累计上涨超过 100%或累计下跌超过 50%，乙方的约定年化收益率为7.1%；

即：

挂钩标的到期涨跌幅： $R = \text{挂钩标的的期末价格} / \text{挂钩标的的期初价格} - 1$ ；

乙方的约定年化收益率： $I$ ；

(1) 当  $-50\% \leq R \leq 100\%$  时,  $I = \underline{6.1}\%$ ;

(2) 当  $R > 100\%$  或  $R < -50\%$  时,  $I = \underline{7.1}\%$ ;

#### 9、交易结算:

本交易的结算金额 = 交易本金  $\times$  (1 + 约定收益率  $\times$  交易起始日 (含) 至交易到期日 (含) 的自然日天数 / 365 );

甲方确保在交易到期日后的一个交易日内将交易本金和本条第 8 款规定的约定收益足额支付至乙方账户。

#### 10、交易的提前终止:

(1) 由于相关法律、法规、规章等外部强制性规定的变动导致本次交易不再具有合法性或相关监管机构对本次交易内容提出异议的, 甲方有权提前终止本协议并不承担违约责任, 乙方对此不持异议。

(2) 由于因自然灾害、重大意外事故、战争等双方不可控制的 因素, 导致甲乙双方任何一方无法或延后履行本协议的有关义务, 受影响方可提前终止本协议。

(3) 若甲方主动提出提前终止, 乙方的收益计算以协议实际存续天数为准, 预期年约定收益率不变; 若乙方主动提出提前终止, 乙方的收益计算以协议实际存续天数为准, 约定收益率以同期中国人民银行活期存款为准。其中, 实际存续天数为交易起始日 (含) 至交易到期日 (含) 的自然日天数。

(4) 当发生本条款规定的提前终止情形, 甲乙双方应友好协商

确定协议提前终止日，协议提前终止日应在有权提前终止一方正式提出提前终止要求起的三个工作日内。

(5) 除本条款规定的情形外，甲乙双方均不可提前终止本协议。

### (三) 风险控制分析

根据公司与长江证券签订的《长江证券股份有限公司“掌柜理财”交易确认书》的约定，本次公司投资长江证券“掌柜理财”产品，长江证券作为直接对方，通过协议确定交易本金及约定产品收益，并确保在产品到期日后一个交易日内向本公司足额支付交易本金和约定收益。因此，该产品风险低。

四、截至本公告日，公司累计委托理财余额为 280,000 万元人民币。

特此公告。

重庆水务集团股份有限公司

2014 年 9 月 26 日