

安徽金禾实业股份有限公司

关于拟认购资产管理计划的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

安徽金禾实业股份有限公司（以下简称“公司”）于2018年1月11日召开第四届董事会第二十八次会议审议通过了《关于拟认购资产管理计划的议案》，同意公司在保障公司日常生产经营资金需求以及投资建设项目资金需求的前提下，同时在有效控制风险的前提下，使用不超过人民币5亿元的自有闲置资金认购“财通证券资管财慧道101号定向资产管理计划”。本议案尚需提交公司2018年第一次临时股东大会审议。

一、投资概述

（一）投资目的

财通证券资产管理有限公司是财通证券股份有限公司的全资子公司，于2014年12月完成工商注册登记，并于2015年1月获得中国证监会颁发的《经营证券业务许可证》，2015年12月获准开展公募基金管理业务，拥有专业的投研团队，具有专业的投资和风险控制能力。

公司在保障公司日常生产经营资金需求以及投资建设项目资金需求的前提下，同时在有效控制风险的前提下，使用自有闲置资金委托财通证券资产管理有限公司进行投资，借助专业投资机构的力量提高公司存量资金使用效率与效益，实现公司和股东收益最大化，并有效控制风险。

（二）资金来源

公司自有闲置资金，不涉及募集资金，也不向银行借款。

（三）关联关系说明

公司与管理人财通证券资产管理有限公司、托管人宁波银行股份有限公司无关联关系。

（四）投资额度

总额度不超过人民币5亿元，在该额度内，资金可以滚动使用。上述所称投

资额度，包括将投资收益进行再投资的金额，即在投资期限内任一时点投资的金额不超过人民币 5 亿元。本额度纳入公司风险投资额度范围内。

本次拟认购的额度不等于公司实际投资金额，公司将根据日常生产经营资金需求和投资建设项目资金需求情况，按照资产管理计划合同的约定，在此额度内认购、追加和提取委托资产或收益，以公司实际发生的投资金额为准。董事会提请股东大会授权公司董事长，代表公司签署本次投资额度内的有关的合同、协议等各项法律文件。

二、投资的基本情况

（一）管理人

名称：财通证券资产管理有限公司

注册地址：浙江省杭州市上城区白云路 26 号 143 室

办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 28 层

法定代表人：马晓立

（二）托管人

托管人：宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁东路 345 号

办公地址：宁波市鄞州区宁东路 345 号

法定代表人：陆华裕

（三）资产管理计划合同主要内容

1、资产管理计划名称

财通证券资管财慧道 101 号定向资产管理计划

2、委托资产的种类、数量、金额

（1）委托人初始委托资产形态为现金资产，不低于人民币 4000 万元。

（2）在委托期限内，委托人可以按照本合同的约定追加或提取委托资产，追加或提取委托资产后的委托金额按照本合同约定计算。

3、投资范围及投资比例

（1）投资范围

本计划主要投资于现金、银行存款（含定期存款、协议存款和其他银行存款）、货币市场基金、债券逆回购等现金类资产，可转换债券、可交换债券（含非公开发行的可交换债券），信托计划、保险公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其子公司资产管理计划、基金公司及其子公司特定多个客户资产管理计划、期

货公司及其子公司资产管理计划等中国证监会允许投资的金融工具，在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人所发行的私募基金。

(2) 资产配置比例

a. 现金类资产：占计划资产总值的 0-100%。包括现金、银行存款（含定期存款、协议存款和其他银行存款）、货币市场基金、债券逆回购等。

b. 固定收益类资产：占计划资产总值的 0-100%。包括可转换债券、可交换债券（含非公开发行的可交换债券）。

c. 其他类资产：占计划资产总值的 0-100%。包括信托计划、保险公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其子公司资产管理计划、基金公司及其子公司特定多个客户资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划等中国证监会允许投资的金融工具，在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人所发行的私募基金。

4、投资限制

为切实维护委托人的合法权益，委托资产的投资不得违反本资产管理合同中有关投资范围、投资比例以及相关法律法规的规定。

5、投资策略

本计划主要资产投资于金融市场工具，并在严格控制风险的基础上，通过对全球经济形势、中国经济发展（包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况）、证券市场估值水平等的研判，动态调整计划各类资产的投资比例，力争为计划资产获取稳健回报。

(1) 资产配置策略

本计划将在产品合同约定的投资范围内结合定性以及定量分析，自上而下地实施整体资产配置策略，以灵活的多元化，多产品，多市场，多主体的分散投资配置方式，通过预测各大类资产未来收益变化情况，在不同资产大类种进行动态调整和优化，力求规避市场风险，提高计划收益率。

(2) 固定收益类资产投资策略

本计划将灵活运用利率预期策略、信用债券投资策略、收益率利差策略、套利交易策略、个券选择策略等多种投资策略，构建以信用类债券为主的固定收益类资产组合。

a. 利率预期策略

利率风险是债券投资最主要的风险来源和收益来源之一，衡量债券利率风险

的核心指标是久期。本计划将通过对宏观经济以及货币政策等因素的深入研究，判断利率变化的方向和时间，利用情景分析模拟利率变化的各种情形，最终结合组合风险承受能力确定债券组合的目标久期。本计划通过对收益率曲线的研究，在所确定的目标久期配置策略下，通过分析和预测收益率曲线可能发生的形状变化，在期限结构配置上适时采取子弹型、哑铃型或者阶梯型等策略，进一步优化组合的期限结构，力争获取较好收益。

b. 信用债券投资策略

信用类债券是本计划重要投资标的，信用风险管理对于提高债券组合收益率至关重要。本计划将根据宏观经济运行状况、行业发展周期、公司业务状况、公司治理结构、财务状况等因素综合评估信用风险，确定信用类债券的信用风险利差，有效管理组合的整体信用风险。同时，本计划将依托管理人的信用研究团队，在有效控制组合整体信用风险的基础上，深入挖掘价值低估的信用类债券品种，力争准确把握因市场波动而带来的信用利差投资机会，获得超额收益。

c. 收益率利差策略

在预测和分析同一市场不同板块之间（比如金融债和信用债之间）、不同市场的同一品种、不同市场的不同板块之间的收益率利差基础上，本计划采取积极策略选择合适品种进行交易来获取投资收益。收益率利差策略主要有两种形式：

d. 套利交易策略

在我国的固定收益市场中，合理运用套利交易策略可以获得超额收益，本计划将在法律法规和监管机构许可的条件下，积极运用以下套利交易策略：

e. 个券选择策略

在前述债券目标久期、信用债券配置比例确定基础上，本计划将选择最具有投资价值优势的债券品种进行投资以获得超额收益。具有以下一项或多项特征的债券，是本计划构建固定收益类资产组合的重点投资对象。

（3）私募基金选择策略

所投私募基金需进行资产托管或保管。通过投研团队、公司环境、合规风控、研发能力、交易执行、投资策略、业绩及归因、资产配置等方面的综合分析挑选投资能力、专业资质、及运营能力较强的基金管理人。通过历史波动率、夏普值、最大回撤、贝塔值、集中度等风险收益特征筛选业绩优异的基金。

6、委托资产的管理方式、投资执行流程

委托人将资金委托给管理人后，管理人根据本合同投资范围及投资限制的要

求，自行决定做出投资决策。

7、委托期限

本计划不设固定管理期限，但当符合所约定的终止清算条件时，将会进入终止清算程序，终止本计划。

三、对外投资存在的风险和对公司的影响

1、存在的风险

(1) 如本次投资获股东大会审议通过后，完成合同签订后，本次资产管理计划尚需取得中国证券投资基金业协会备案，存在因未在该协会履行登记备案手续导致本次资产管理计划不能进行投资运作的风险及募集失败风险。

(2) 资产管理计划在运营过程中存在运营风险及资金损失风险，不能保证财产中的认购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

(3) 其他风险如流动性风险、税收风险及法律与政策风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险等其他风险。

2、对公司的影响

针对本次投资事项，公司将积极关注管理人的运作情况，督促管理人防范各方面的投资风险，努力维护公司投资资金的安全。

公司在保障公司日常生产经营资金需求以及投资建设项目资金需求的前提下，使用自有闲置资金进行一定的财务投资，对公司生产经营无重大影响。

四、其他

1、公司目前不处于使用闲置募集资金暂时补充流动资金期间；本次董事会审议该议案之日前十二个月内公司亦不存在将募集资金投向变更为永久性补充流动资金和将超募资金永久性用于补充流动资金或归还银行贷款的情况。

2、公司承诺在此项风险投资后的 12 个月内，不使用闲置募集资金暂时补充流动资金、将募集资金投向变更为永久性补充流动资金、将超募资金永久性用于补充流动资金或归还银行贷款。

3、本次投资事项将提交公司 2018 年第一次临时股东大会审议。

五、备查文件

1、第四届董事会第二十八次会议决议；

2、《财通证券资管财慧道 101 号定向资产管理计划管理合同》。

特此公告。

安徽金禾实业股份有限公司

董事会

二〇一八年一月十二日