

**多喜爱集团股份有限公司股东**  
**国亚金控资本管理有限公司**  
**关于对深圳证券交易所中小板关注函的回复**

国亚金控资本管理有限公司（以下简称“国亚金控”，“我司”，“公司”）近日收到深圳证券交易所中小板公司管理部出具的《关于对国亚金控资本管理有限公司的关注函》（中小板关注函【2018】第 429 号）（以下简称“关注函”）。2018 年 12 月 24 日多喜爱集团股份有限公司收到国亚金控回函，现将有关回复公告如下：

国亚金控资本管理有限公司：

2018 年 12 月 18 日，多喜爱集团股份有限公司（以下简称“多喜爱”）披露《关于持股 5%以上股东股份被动减持的公告》和《简式权益变动报告书》，称你公司所持多喜爱股票被动减持。根据公告，你公司因触发了与华林证券股份有限公司（以下简称“华林证券”）签订的《融资融券合同》中约定的强制平仓条件，你公司持有的多喜爱部分股份已于 2018 年 12 月 18 日被华林证券股份有限公司强制平仓，平仓股数为 547.63 万股，占多喜爱总股本 2.68%。本次被动减持前，你公司持有多喜爱股份 1245.79 万股，占多喜爱总股本 6.11%。本次被动减持后，你公司持有公司股份 698.16 万股，占多喜爱总股本 3.42%。

你公司在披露的《简式权益变动报告书》中称，本次被动减持多喜爱股份，是由于违规开展了通道业务并将交易、风控权限交予了投资者指定交易团队，该交易团队于 2018 年 12 月 3 日盘中违规增持多喜爱股份，触发了与华林证券签订的《融资融券合同》中约定的强制平仓条件，华林证券于 2018 年 12 月 18 日强制平仓导致你公司被动减持多喜爱股份 547.63 万股。

我部对此表示高度关注，请你公司对以下问题作出说明：

**1、请说明公司违规开展通道业务的具体情况，包括但不限于投资方的具体名称、通道业务的具体安排、交易权的安排、对基金产品风险控制的安排。**

**【回复】：**

我司于 2018 年 2 月 6 日在中国证券投资基金业协会备案成立并发行的“国亚金控-汇信 2 号”和“国亚金控-汇信 3 号”两只基金产品，通道产品管理费为 0.1%，2018 年

6月5日起将管理费率调整至0.2%，两只基金产品成立募集过程中，我司并未对基金产品进行任何的对外推介和募集，产品投资人为鲁证期货股份有限公司（以下简称“鲁证期货”）发行管理的“鲁证万泰 FOF 五期资产管理计划”。两只基金产品实际交易团队、投资者及托管方均由鲁证期货相关工作人员指定安排。鲁证期货团队指定相关的联系人与我司进行日常工作的沟通，我司对于实际交易团队的成员及其交易运作情况等信息并不了解。截止2018年12月3日违规举牌当日，两只基金产品的投资者明细如下表所示：

产品名称	投资者名称	申购金额（万元）	总规模（万元）
国亚金控-汇信2号证 券私募基金	鲁证万泰 FOF 五 期资产管理计划	10000	18159.83
国亚金控-汇信3号证 券私募基金	鲁证万泰 FOF 五 期资产管理计划	10000	19611.69

两只基金产品在鲁证期货指定的兴业银行西宁分行进行托管。两只基金产品成立后，由实际交易团队进行风控和交易的管理，两只基金产品与渤海融盛资本管理有限公司及上海侨江金融服务有限公司开展了以“基金产品净值为标的”的场外期权交易。

2018年8月15日，鲁证期货向兴业银行出具告知函，函中表明鲁证期货认可包括“国亚金控-汇信2号”及“国亚金控-汇信3号”在内的9只私募基金产品开展以“基金产品净值为标的”的场外衍生品交易。并要求托管行即兴业银行以“场外衍生品买方按照实际支付权利金金额计入成本，场外衍生品卖方按照实际收取实际权利金金额计入收入”的估值方法对基金产品进行估值和复核。

渤海融盛资本管理有限公司及上海侨江金融服务有限公司作为期权买方，向“国亚金控-汇信2号”和“国亚金控-汇信3号”共支付权利金13301.93万元，渤海融盛资本管理有限公司共支付权利金4362.44万元，上海侨江金融服务有限公司共支付了8939.48万元，这种交易的实质是通过场外期权交易的方式使“国亚金控-汇信”系列基金产品净值不低于1。

基金产品成立后，鲁证期货指定我司在华林证券深圳龟山路营业部为“国亚金控-汇信2号”及“国亚金控-汇信3号”两只基金产品开立股票账户，同时将账户密码给予了鲁证

期货指定交易团队。“国亚金控-汇信”系列产品的 PB 交易系统由华林证券提供，PB 系统的风控权限给予了鲁证期货进行管理，PB 系统的交易权限由鲁证期货指定的实际交易团队管理。2018 年 11 月 30 日，实际交易团队通知我司要求华林证券断开两只基金产品 PB 系统与其网上柜台交易系统的连接。在 2018 年 12 月 3 日当天，两只基金产品风控设置被关闭，导致“国亚金控-汇信”系列基金产品持有上市公司股份的仓位不受限制。因此实际交易团队下单买入多喜爱股份的操作导致了“国亚金控-汇信”系列基金产品违规举牌。违规举牌发生当日，实际交易团队联系上市公司进行公告并要求我司配合出具《简式权益变动报告书》。在此之前，我司与上市公司从未进行过任何的联系。

**2、请说明公司对多喜爱股份权益是否存在实际控制权，是否为信息披露义务人。若无，则说明实际信息披露义务人的名称。**

**【回复】：**

由于我司作为“国亚金控-汇信 2 号”和“国亚金控-汇信 3 号”两只基金产品通道方，只收取产品规模的 0.1%作为管理费用，后期为 0.2%的管理费用，未收取任何其他的后端费用。上市公司股票由实际交易团队进行交易买入，股份权益归投资者即鲁证期货资管产品所有。我司对上市公司股份权益不存在实际控制权。

依据《上市公司信息披露管理办法》第四十九条规定“通过接受委托或者信托等方式持有上市公司 5%以上股份的股东或者实际控制人，应当及时将委托人情况告知上市公司，配合上市公司履行信息披露义务”，该上市公司股份权益登记在我司名下，故我司作为两只基金产品名义上的管理人具有相关信息的披露义务。

**3、12 月 3 日你公司与上海骏胜资产管理有限公司（以下简称“上海骏胜”）同时增持多喜爱股份超过 5%但未停止增持，请你公司说明是否同上海骏胜存在关联关系，是否受同一实际控制人或投资人控制。**

**【回复】：**

我司与上海骏胜资产管理有限公司不存在任何关联关系。我司两只基金产品的实际投资人为“鲁证万泰 FOF 五期资产管理计划”。我司于鲁证期货 2018 年 8 月 15 日下发的告知函中知悉了上海骏胜资产管理有限公司发行的“骏胜晓旭”系列产品的投资人同为鲁证期货发行的资管计划，但对上海骏胜所发行产品的实际情况并不知情。

**4、请你公司认真自查并说明在上述违规事实发生过程中，是否存在其他违反《证券法》、《上市公司收购管理办法》的情形，以及所披露的信息是否真实准确，是否存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。**

**【回复】：**

在 2018 年 12 月 3 日，我司作为通道产品的名义管理人，发生了违规举牌行为，由实际交易团队整理交易信息并联系上市公司，草拟并出具《简式权益变动报告书》发送至我司，我司对实际交易团队的交易行为及交易动机没有任何了解，仅作为通道方进行相关日常事务处理的工作，当日发送给上市公司的《简式权益变动报告书》中所陈述的权益变动目的等描述并非为我司真实意见。

2018 年 12 月 18 日，“国亚金控-汇信 3 号”因触发了与华林证券签订的《融资融券合同》中约定的强制平仓条件，华林证券当日对“国亚金控-汇信 3 号”实施强制平仓导致该基金被动减持上市公司股份 547.63 万股，我司按照上市公司要求出具了《短线交易承诺函》，承诺“在短线交易行为发生之日起 6 个月内，不再买卖【多喜爱集团股份有限公司】股票”。2018 年 12 月 19 日，华林证券对“国亚金控-汇信 2 号”实施强制平仓导致该基金产品被动减持上市公司股份 526.38 万股。此交易行为系华林证券主动强制平仓所导致，并非我司行为。

**5、请补充说明其他你认为其他需要说明的内容**

**【回复】：**

(1) 2018 年 2 月 6 日我司在中国证券投资基金业协会备案发行了“国亚金控-汇信 2 号”和“国亚金控-汇信 3 号”两只基金产品，2018 年 4 月 27 日《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》即“资管新规”颁布，资管新规禁止开展通道类业务，“国亚金控-汇信 2 号”和“国亚金控-汇信 3 号”为存续通道类产品，我司在新规出台之后未开展任何的通道类业务。

(2) 我司为此次开展通道类业务所造成的影响深感歉意，同时也对我司产生了负面的社会影响。在该事件发生后我司立即召开了董事会，对此次公司通道业务的开展的进行了深刻的检讨和严格的自查，禁止任何通道类业务产品的发行，对存续的产品、未来产品的发行、公司内部合规风控管理及业务的拓展进行了规划，公司董事会决议对此次通道类

业务相关风控人员和业务人员予以严肃处理，同时我司会积极配合相关部门的检查和监督。

**国亚金控资本管理有限公司**

**2018年12月24日**