

# 江苏汇鸿国际集团股份有限公司

## 关于子公司认购私募基金份额的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

重要内容提示：

投资标的：爱晖良辰3号私募证券投资基金，金额2,000万元。

特别风险提示：基金所直接投资的项目以及通过子基金投资的项目均可能存在程度不同的风险，包括但不限于市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、预期投资收益不能实现风险、操作或技术风险及其他风险。

### 一、对外投资概述

江苏汇鸿国际集团股份有限公司（以下简称“公司”）于2017年12月19日召开的第八届董事会第十五次会议审议通过《关于确定公司2018年度金融证券投资额度的议案》，同意2018年度公司金融证券投资额度存量总规模为不超过32亿元，存量投资退出后可以滚动投资。为促进公司金融资产结构调整，进一步优化公司资产和业务结构，提升资产回报率，推进公司创新转型，公司于2018年7月19日第八届董事会第十九次会议审议《关于增加金融证券投资额度的议案》，公司自董事会通过之日起至2018年末，增加6亿元金融证券投资额度，即年度存量规模不超过38亿元。在该额度范围内，资金可循环使用。董事会授权公司或公司专业投资平台通过自营投资或通过信托、证券、基金公司等第三方通道和私募平台进行投资。2018年6月29日，公司控股子公司江苏汇鸿国际集团中嘉发展有限公司（以下简称“汇鸿中嘉”）以自有资金共计3,000万元整通过公司专业投资平台江苏汇鸿国际集团资产管理有限公司（以下简称“汇鸿资管”）认购爱晖良辰3号私募证券投资基金份额。

具体详见公司在上海证券交易所网站的披露的《关于确定公司2018年度金融证券投资额度的公告》（公告编号：2017-090）、《关于子公司认购私募基金

份额的公告》（公告编号：2018-044）、《关于增加金融证券投资额度的公告》（公告编号：2018-048）。

鉴于爱晖良辰3号私募证券投资基金运行稳健，2018年12月10日，公司控股子公司汇鸿中嘉以自有资金共计2,000万元整通过公司专业投资平台汇鸿资管追加认购爱晖良辰3号私募证券投资基金份额。

根据《公司章程》、《对外投资管理制度》及其他相关规定，本次投资事项在董事会审议通过额度内，由经营层负责具体实施，无需股东大会批准。

根据《上市公司重大资产重组管理办法》和《上海证券交易所股票上市规则》的有关规定，本次对外投资不构成重大资产重组，不属于关联交易。

## 二、本次对外投资的基本情况

### （一）基金管理人

1、名称：爱晖资产管理（上海）有限公司（以下简称“爱晖资产”）

2、成立时间：2014年10月

3、管理模式：公司实缴资本5,000万元。公司实行高效、集约、科学的管理体制，建立由董事会领导的业务管理架构。董事会设有投资决策委员会和风险管理委员会，由公司董事长、总经理和公司监事等组成。

4、主要管理人员：滕响君、赵见见

5、主要投资领域：国内股票二级市场，债券二级市场、证券投资基金，期货、期权、其他衍生品等。

6、近一年经营状况：截止2017年12月底，资产总额7,297万元，负债总额2,656万元，资产负债率36.4%，主营业务收入353万元，实现净利润-262万元，净利润率-74.2%。

7、爱晖资产是在中国基金业协会登记备案（备案编号P1008117）的管理非公开募集基金的专业投资管理机构，并取得会员资格。

8、公司及子公司与该基金公司不存在关联关系，该基金公司不持有公司股份，不拟增持公司股份，不存在其他利益关系。

### （二）投资基金的基本情况

1、基金名称：爱晖良辰3号私募证券投资基金

（1）成立背景：固定收益类资产收益率下滑，权益类资产收益率较高但波

动较大，故采用量化对冲套利策略，使用阿尔法选股策略、日内回转、网下打新等策略，追求稳健回报。

(2) 本次投资规模：2,000万

(3) 投资人及投资比例：汇鸿中嘉通过公司专业投资平台汇鸿资管认购，汇鸿资管为本基金单一投资人。

(4) 资金来源：汇鸿中嘉自有资金。

(5) 出资进度：汇鸿资管在认购时一次性全额出资。

(6) 投资基金的管理模式

①管理及决策机制：本基金为私募证券投资基金，投资于二级市场股票、债券、期货、现金管理等金融工具。管理过程中涉及主体和其职责如下：

基金份额持有人：汇鸿资管以其拥有合法所有权或处分权的财产投资于本基金。

基金管理人：爱晖资产依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本基金财产。

基金托管人：恒泰证券股份有限公司。依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管本基金财产。

外包服务机构：恒泰证券股份有限公司。接受基金管理人委托，进行估值核算等服务。

②各投资人的合作地位和主要权利义务：汇鸿资管为本基金投资人之一，对拥有的该基金份额，享有包括但不限于以下权利：

1) 分享基金财产收益；

2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

3) 按照合同的约定申购与赎回基金和转让基金；

4) 根据基金合同的规定，参加或申请召集基金份额持有人大会，行使相关职权；

5) 监督基金管理人及基金托管人履行投资管理和托管义务的情况；

6) 按照合同约定的时间和方式获得基金的运作信息资料；

7) 因私募基金管理人、私募基金托管人违反法律法规或基金合同的约定导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿。

主要义务包括但不限于：

- 1) 认真阅读基金合同，保证投资资金的来源及用途合法；
- 2) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和承担能力问卷，如实承诺资产或者收入情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署《合格投资者确认书》；
- 3) 以合伙企业、契约等非法人形式汇集多数投资者资金直接或者间接投资于私募基金的，应向私募基金管理人充分披露上述情况及最终投资者的信息，但符合《暂行办法》第十三条规定的除外；
- 4) 认真阅读并签署风险揭示书；
- 5) 交纳购买基金份额的款项及规定的费用；
- 6) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者终止的有限责任；
- 7) 及时、全面、准确地向基金管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况；
- 8) 向基金管理人或其代理销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合基金管理人履行反洗钱义务；
- 9) 保守商业秘密，不得泄露私募基金的投资计划或意向等；
- 10) 不得违反合同的规定干涉基金管理人的投资行为；
- 11) 不得从事任何有损基金及其投资人、基金管理人管理的其他资产及基金托管人托管的其他资产合法权益的活动；
- 12) 按照合同的规定缴纳管理费、托管费、外包服务费及业绩报酬，并承担因基金财产运作产生的其他费用；
- 13) 法律法规、中国证监会及中国基金业协会规定和合同规定的其他义务。

③管理费或业绩报酬及利润分配安排方式：

基金管理费：2%，按日计提。

业绩报酬：

- a. 本基金管理人提取业绩报酬。
- b. 在基金终止时，基金份额累计净值大于等于1.000 时，按照份额持有人持有份额比例进行分配。

(7) 投资基金的投资模式

**投资领域：**本基金投资范围包括商品期货、金融期货、商品期权，依法发行上市的股票(包含中小板、新股、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、交易所债券、银行理财、银行存款、债券逆回购、货币市场基金、证券公司资产管理计划、期货公司资产管理计划、在基金业协会登记的私募基金管理人发行并由具有证券投资基金托管资格的机构托管的契约式私募投资基金。

**投资项目和计划：**本基金主要投资于证券二级市场，核心策略为alpha市场中性策略，以通过量化手段，从市场中选入具备阶段超额收益的一篮子股票，以股指期货对冲，通过高换手率，降低资金波动，获取稳定的绝对回报。

**盈利模式：**投资标的公允价值变动。

**投资后的退出机制：**证券二级市场交易类投资产品通过二级市场交易退出，非证券二级市场交易类投资产品通过相关产品到期清算、赎回等方式退出。

### 三、风险提示

本次认购的基金份额所投资的项目均可能存在程度不同的风险，包括但不限于市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、预期投资收益不能实现风险、操作或技术风险及其他风险，并且投资周期较长。针对主要的投资风险，汇鸿资管将及时了解基金管理人的运作情况，关注投资项目实施过程，督促基金管理人防范各方面的投资风险，尽力维护本公司投资资金的安全。

### 四、对上市公司的影响

鉴于爱晖资产作为基金管理人资源优势明显，团队经验丰富，品牌影响力大和往期投资基金的良好业绩与发展态势，自首次认购以来，该基金运行风险控制能力强，运行稳健，公司认为追加认购爱晖良辰3号私募证券投资基金份额，将其作为资产配置的一部分，风险可控，收益可期。公司子公司汇鸿中嘉在保证公司正常经营所需流动资金的情况下，使用自有资金认购上述基金，有利于提高自有资金的使用效益，增加现金管理收益，并可以充分发挥公司的专业投资平台的作用，为公司实现可持续发展奠定基础。综上，该基金投资不会影响公司主营业务的正常开展，不会损害公司股东利益。

特此公告。

江苏汇鸿国际集团股份有限公司董事会

二〇一八年十二月十二日