证券代码：603989 证券简称：艾华集团 公告编号：2020-054
转债代码：113504 转债简称：艾华转债
转股代码：191504 转股简称：艾华转股

湖南艾华集团股份有限公司关于公司及子公司使用闲置自有资金购买理财产品的进展公告

本公司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：

委托理财受托方：中国农业银行股份有限公司、兴银基金管理有限责任公司、华泰证券（上海）资产管理有限公司、中信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司。

委托理财金额：人民币12,000.00万元、人民币3,000.00万元、人民币1,376.0627万元、人民币2,000.00万元、人民币2,000.00万元、人民币4,000.00万元，共计24,376.0627万元。

委托理财产品名称："汇利丰"2020年第5108期对公定制人民币结构性存款、兴银基金－福安5号FOF单一资产管理计划、华泰紫金月月购3个月滚动持有债券型证券投资基金、华泰紫金中国精选1号集合资产管理计划、中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划、方正证券艾华1号单一资产管理计划。

委托理财期限：除"汇利丰"2020年第5108期对公定制人民币结构性存款期限为41天，兴银基金－福安5号FOF单一资产管理计划为无固定期限、可随时支取外，其余理财产品均有相应的封闭期，封闭期分别为3个月、18个月、6个月、6个月。

履行的审议程序：公司分别于2020年3月27日召开第四届董事会第八次会议，2020年4月21日召开2019年年度股东大会，审议通过了《关于使用公司闲置自有资金购买理财产品的议案》，为提高公司闲置自有资金的使用效率，增加公司资金收益，提升股东回报，在确保日常经营资金需求前提下，公司使用最高额度不超过人民币15亿元闲置自有资金进行现金管理，自公司股东大会审议通过之日起12月之内有效。在上述额度及决议有效期内，资金可滚动使用。公司独立董事、监事会、保荐机构已分别对此发表了同意的意见。具体内容详见公司2020-020号、2020-030号及2020-038号公告。

一、委托理财概况

（一）委托理财目的

为合理利用闲置自有资金，增加公司现金资产收益，公司在保证日常经营运作资金需求、有效控制投资风险的情况下，使用闲置自有资金进行现金管理。

（二）资金来源

委托理财资金来源为自有资金。

（三）委托理财产品的基本情况

公司分别于2020年3月27日召开第四届董事会第八次会议，2020年4月21日召开2019年年度股东大会，审议通过了《关于使用公司闲置自有资金购买理财产品的议案》，为提高公司闲置自有资金的使用效率，增加公司资金收益，提升股东回报，在确保日常经营资金需求前提下，公司使用最高额度不超过人民币15亿元闲置自有资金进行现金管理，自公司股东大会审议通过之日起12月之内有效。在上述额度及决议有效期内，资金可滚动使用。公司独立董事、监事会、保荐机构已分别对此发表了同意的意见。具体内容详见公司2020-020号、2020-030号及2020-038号公告。

1. 在前次及此次授权下，公司及下属子公司自2020年4月21日至本公告日理财产品到期赎回情况如下：

委托方	受托方	产品名称	产品类型	委托理财金额（万元）	起息日期	赎回日期	赎回金额（万元）	收益类型	年化收益率	到期收回收益（万元）	结构化安排	是否构成关联交易
湖南艾华集团股份有限公司	方正证券股份有限公司	金大宝	非保本浮动收益	3,500	2019.10.18	2020.04.27	3,500	浮动收益	5%	91.10	无	否
湖南艾华集团股份有限公司	信达证券股份有限公司	中民永丰1号A25期	非保本浮动收益	3,000	2019.11.01	2020.05.05	3,000	浮动收益	5.2%	79.50	无	否
湖南艾华集团股份有限公司	财信证券有限责任公司	财富3个月定期开放（001期）集合资产管理计划	非保本浮动收益	3,000	2019.11.15	2020.05.15	续做	浮动收益	5.0%以上获得40%业绩报酬	76.50	无	否
湖南艾华集团股份有限公司	兴银基金管理有限责任公司	兴银基金福安2号FOF单一资产管理计划	非保本浮动收益	3,000	2019.12.06	2020.06.06	续做	浮动收益	业绩计提基准5.1%，超过基准以上管理人提取5%超额业绩报酬	91.20	无	否
湖南艾华集团股份有限公司	华融证券股份有限公司	质押宝23号A44	非保本浮动收益	500	2019.10.18	2020.5	续做	浮动收益	5.6%	14.81	无	否
湖南艾华集团股份有限公司	中国农业银行股份有限公司	"汇利丰"2020年第5108期对公定制人民币结构性存款	保本浮动收益	12,000	2020.05.20	2020.06.30	12,000	浮动收益	1.54%–3.3%	44.48	无	否
湖南艾华集团股份有限公司	长江证券股份有限公司	长江超越理财增强债券	非保本浮动收益	1,000	2020.02.27	2020.07.02	1,000	浮动收益	–	1.18	无	否

2. 在此次授权下，公司及子公司自2020年4月21日至本公告日使用闲置自有资金购买的的理财产品情况如下：

受托方名称	产品类型	产品名称	金额（万元）	预计年化收益率	预计收益金额（万元）
中国农业银行股份有限公司	银行理财产品	"汇利丰"2020年第5108期对公定制人民币结构性存款	12,000.00	1.54%或3.30%	20.76或44.48
兴银基金管理有限责任公司	其他类（基金公司及其子公司资产管理计划）	兴银基金－福安5号FOF单一资产管理计划	3,000.00	/	/
华泰证券（上海）资产管理有限公司	其他类（公募基金产品）	华泰紫金月月购3个月滚动持有债券型证券投资基金	1,376.0627	/	/
华泰证券（上海）资产管理有限公司	券商理财产品	华泰紫金中国精选1号集合资产管理计划	2,000.00	/	/
中信证券股份有限公司	券商理财产品	中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划	2,000.00	/	/
方正证券股份有限公司	券商理财产品	方正证券艾华1号单一资产管理计划	4,000.00	/	/
产品期限	收益类型	结构化安排	参考年化收益率	预计收益（如有）	是否构成关联交易
41天	保本浮动收益	无	1.54%或3.30%	20.76万元或44.48万元	否
存续期限为3年，无封闭期，可随时申购、赎回	浮动收益	无	/	/	否
存续期限不定期，封闭期3个月，3个月满后投资者可自由选择是否赎回，如不赎回将再次封闭3个月。	浮动收益	无	/	/	否
存续期限为10年，封闭期18个月，18个月满后投资者可自由选择是否赎回，如不赎回将再次封闭18个月。	浮动收益	无	/	/	否
存续期限为3年，封闭期6个月，6个月满后投资者可自由选择是否赎回，如不赎回将再次封闭6个月。	浮动收益	无	/	/	否
存续期限为5年，封闭期6个月，6个月满后投资者可自由选择是否赎回，如不赎回将再次封闭6个月。	浮动收益	无	/	/	否

（四）公司对委托理财相关风险的内部控制

针对投资风险，公司将采取以下措施：

1. 公司将严格遵守审慎投资原则，严格筛选发行主体，选择信誉好、合规性高、资金安全保障力强的发行机构。公司持有的理财产品等金融资产，不能用于质押。

2. 建立投资台账，及时跟踪、分析各理财产品的投向、项目进展情况，一旦发现或判断可能出现不利因素，及时采取相应保全措施，控制投资风险。

3. 公司审计部负责对各项理财品的投资情况进行审计与监督，每个季度应对具体投资情况进行审计，并向审计委员会进行报告。

4. 独立董事、监事有权对资金使用情况进行监督检查，必要时可聘请外部专门机构进行审计。

5. 公司将根据相关规定，及时披露该项授权下的具体投资情况及相应的损益情况。

二、委托理财的具体情况

（一）委托理财合同主要条款

1. 产品名称："汇利丰"2020年第5108期对公定制人民币结构性存款

受托方名称：中国农业银行股份有限公司

公司于2020年5月19日与中国农业银行股份有限公司签署了《中国农业银行结构性存款产品及风险和客户权益说明书》，具体内容如下表：

产品名称	"汇利丰"2020年第5108期对公定制人民币结构性存款产品
客户预期净年化收益率	3.30%/年或1.54%/年
产品类型	保本浮动收益
产品期限	41天
挂钩标的	欧元/美元汇率
认购开始日	2020年05月18日
认购结束日	2020年05月19日
产品起息日	2020年05月20日
产品到期日	2020年06月30日
结构性存款资金	投资人认购本结构性存款产品资金净额。
实际结构性存款天数	自本产品起息日（含）至产品到期日（不含）或提前终止日（不含）的自然天数
本金保证	本结构性存款产品由中国农业银行为投资人提供到期本金担保，100%保障投资者本金安全。
计息方式	1年按365天计算，计息天数按实际结构性存款天数计算。
计息说明	募集期内（起息前一日除外）投资者结构性存款资金计活期利息；清算期内结构性存款资金不计付利息。
税收规定	投资者因投资本结构性存款产品所导致的任何现有或将来的税收（包括但不限于利息税）、开支、费用及任何其它性质的支出由投资者自行承担，农业银行不为投资者预提此类费用。
投资范围	本结构性存款产品本金由中国农业银行100%投资于同业存款、同业借款等低风险投资工具，收益部分与外汇期权挂钩获得浮动收益。
产品收益说明	（1）如在观察期内，欧元/美元汇率始终位于参考区间内，则到期时预期可实现的投资年化收益率为3.30%/年。扣除中国农业银行收取的管理费0.00%/年后，实际支付给投资者的净收益率为3.30%/年。 （2）如在观察期内，欧元/美元汇率突破了参考区间，则到期时预期可实现的投资年化收益率为1.54%/年。扣除中国农业银行收取的管理费0.00%/年后，实际支付给投资者的净收益率为1.54%/年。投资人收益=结构性存款产品本金×实际支付给投资者的净年化收益率×结构性存款实际天数÷365，精确到小数点后2位，具体以中国农业银行股份有限公司实际派发为准。
欧元/美元汇率	取自每周一悉尼时间上午5点至每周五纽约时间下午5点之间，银行间外汇市场欧元/美元汇率的报价，具体数值以农业银行公布的信息为准。
观察期	产品起息日至产品到期前两个工作日北京时间下午2点之间。
参考区间	欧元/美元汇率（S-0.0551，S+0.0551）。其中S为产品起息日北京时间上午10:00彭博BFIX页面欧元中间价（四舍五入取到小数点后四位）。
还本付息	本结构性存款产品到期日后2个银行工作日内一次性支付结构性存款产品本金及收益。遇非银行工作日时顺延。 本结构性存款产品到期前不分配收益。
到期清算	结构性存款产品约定持有期到期日/产品终止日/提前终止日至结构性存款资金返还到账日（不含）为结构性存款产品清算期，清算期内结构性存款资金不计付利息。
产品质押	本结构性存款产品可质押
提前终止条款	本结构性存款产品投资者无权提前终止。产品存续期内，如出现《协议》约定的情况，中国农业银行有权利但无义务提前终止本结构性存款产品。 如果农业银行提前终止本结构性存款产品，中国农业银行将在提前终止日前2个工作日内向投资者发出提前终止公告。
提前终止清算	如农业银行决定提前终止此产品，提前终止日即为产品实际到期日，本结构性存款产品依产品实际投资收益率和实际结构性存款天数进行清算，具体以农业银行相关通告为准。 中国农业银行将在提前终止日后2个工作日内将结构性存款产品本金及收益（如有）划转至投资者原账户
申购和赎回	本结构性存款产品在产品到期日之前不对投资者开放产品申购和赎回。

2. 产品名称：兴银基金－福安5号FOF单一资产管理计划

受托方名称：兴银基金管理有限责任公司

公司于2020年5月21日与兴银基金管理有限责任公司签署了《兴银基金－福安5号FOF单一资产管理计划资产管理合同》，具体内容如下表：

名称	兴银基金－福安5号FOF单一资产管理计划
类别	固定收益类单一资产管理计划
运作方式	开放式
投资范围	本计划可投资于固定收益类私募证券投资基金、固定收益类资产管理计划、国内依法发行和上市交易的债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、地方政府债、次级债、可转换债券、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具）、债券型公开募集证券投资基金、货币市场基金、债券回购、银行存款、现金。其中，本计划主要投资于固定收益类私募证券投资基金。 本计划可以投资管理人发行并管理的公开募集证券投资基金。
投资比例	本计划投资于全部资产管理产品的比例合计高于本计划资产净值的80%，穿透投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于总资产的80%。
产品风险等级	本计划属于R2风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力C2及以上的合格投资者。
存续期限	3年
费用的计提标准	1、管理人的管理费 在通常情况下，资产管理计划管理费按前一日资产管理计划资产净值的0.19%年费率计提。 2、托管人的托管费 在通常情况下，资产管理计划托管费按前一日资产管理计划资产净值的0.01%年费率计提。 3、业绩报酬 本计划自成立日起，于委托人份额提取时或合同终止时，对每笔提取份额或终止时持有的份额提取业绩报酬。 业绩报酬计提日为提取日或终止日，当成立日或该笔份额追加日孰晚至计提日期间年化收益率超过5.3%时，提取超过部分的5%作为业绩报酬，业绩报酬从提取金额或者清算金额中扣除。
收益分配原则	1、资产管理计划存续期内，资产管理计划份额净值大于1.00元时，管理人可根据投资运作情况决定是否向委托人分配收益，且分配后净值不得低于1.00元，每一计划份额享有同等分配权。具体分配方案、分配比例及收益分配时间以管理人公告为准。在符合有关计划收益分配条件的前提下，资产管理计划收益每年多分配4次。 2、资产管理计划收益分配方式为现金分红，具体以管理人通知为准。 3、管理人在每个收益分配基准日确定收益分配方案后，在10个工作日内进行收益分配。 4、收益分配时，如果符合本合同约定的管理人业绩报酬计提条件的，将在收益分配的同时计提或提取管理人业绩报酬。 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。
清算	资产管理计划在发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算资产管理计划资产。 （1）资产管理计划终止时已计提但尚未支付的管理费、托管费等，经清算小组复核后从清算财产中支付。 （2）依据资产管理计划财产清算的分配方案，将计划财产清算后的全部剩余资产扣除清算费用后向委托人进行分配，将全部财产交还投资者自行管理。清算过程中如涉及非现金类资产的分配，由管理人负责办理有关财产移交事宜。 （3）在计划财产移交前，由托管人负责保管。清算期间，任何当事人均不得运用该财产。清算期间的收益归属于计划财产，发生的保管费用由被保管的计划财产承担。因委托人原因导致计划财产无法转移的，托管人和管理人可以在协商一致后按照有关法律法规进行处理。
违约责任	一、本合同当事人违反合同，应当承担违约责任。给其他当事人造成经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下，本合同能继续履行的，应当继续履行。 二、管理人、托管人及其他第三方机构在履行各自职责的过程中，因违反法律法规或者本合同约定，给计划财产或者委托人造成损害的，应按过错原则分别对各自的行为承担赔偿责任。发生下列情况的，当事人可以免责：1、不可抗力；2、管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；3、管理人由于按照本合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。4、在计划运作过程中，管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责，但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的；5、管理人和/或托管人因所引用的证券经纪商及其他中介机构提供的信息的真实性、准确性和完整性存在瑕疵所引起的损失；6、委托人理解委托财产的投资、运作、托管面临本合同、风险揭示书中列举的各类风险，管理人及托管人就委托财产面临的上述固有风险免于承担责任。 三、本合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。 四、因一方当事人违约而导致其他当事人损失的，委托人应先于其他受损方获得赔偿。 五、由于管理人、托管人不可控制的因素导致业务出现差错，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成计划财产或委托人损失，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。 六、本合同一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接损失。

3. 产品名称：华泰紫金月月购3个月滚动持有债券型证券投资基金

受托方名称：华泰证券（上海）资产管理有限公司

公司于2020年5月11日与华泰证券（上海）资产管理有限公司签署了《华泰紫金月月购3个月滚动持有债券型证券投资基金基金合同》，具体内容如下表：

名称	华泰紫金月月购3个月滚动持有债券型证券投资基金
类别	债券型证券投资基金
运作方式	契约型开放式 1、本基金定期开放申购 本基金自基金合同生效之日起不超过3个月内开始办理申购业务，之后本基金将每月开放集中申购。首个开放期详见基金管理人的公告，第二个开放期的首日为首个开放期首日1个月后的对应日（指自然月度，如该对应日为非工作日或无对应日期，则顺延至下一工作日），以此类推。每个开放期不少于一个工作日、不超过五个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。 2、运作期 对于每份基金份额，第一个运作期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日3个月后的对应日（指自然月度，即第一个运作期到期日。如该对应日为非工作日，则顺延到下一工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一日起，至基金合同生效日或基金份额申购申请日6个月后的对应日（指自然月度，如该日为非工作日，则顺延至下一工作日）止。以此类推。每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起该基金份额进入下一个运作期。 如发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。
份额面值和认购费用	本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。 本基金A类基金份额具体认购费率按招募说明书及基金产品资料概要的规定执行。本基金C类份额不收取认购费。
存续期限	不定期
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的80%，但在每个开放日的前5个工作日和后5个工作日以及每个开放日不受前述投资组合比例的限制。基金投资于股票资产的比例不高于基金资产的20%。每个运作期到期日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%；非运作期到期日不受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率×95%+沪深300指数收益率×5%
费用计提方法	1、基金管理人的管理费 本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。 2、基金托管人的托管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。 3、基金销售服务费 本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.30%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。
收益分配原则	1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配； 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红； 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值； 4、同一类别每一基金份额享有同等分配权； 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会。
清算	自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。 清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。 依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。
违约责任	一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《基金合同》约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是如发生下列情况，当事人免责：1、不可抗力；2、基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；3、基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则行使或不行使投资权造成的损失等。 二、在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，《基金合同》能继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。 三、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

4. 产品名称：华泰紫金中国精选1号集合资产管理计划

受托方名称：华泰证券（上海）资产管理有限公司

公司控股子公司益阳艾华富贤电子有限公司于2020年5月20日与华泰证券（上海）资产管理有限公司签署了《华泰紫金中国精选1号集合资产管理计划资产管理合同》，具体内容如下表：

名称	华泰紫金中国精选1号集合资产管理计划
类型	固定收益类QDII集合资产管理计划
运作方式	开放式
投资范围	投资范围包含如下资产： （1）固定收益类资产 境内资产包括现金、银行存款、协议存款、同业存单、货币市场基金、债券型基金、债券回购、国债、政策性金融债、央票、地方债、金融债（含次级债和混合资本债）、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、资产支持证券、资产支持票据、永续债、可转换债券、可交换债券、结构化存款、结构化票据、收益凭证等。 境外资产包括政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的货币型基金、债券型基金（包括ETF）等。 （2）权益类资产 仅限于投资可转债转股（包括可交债换股）所得的股票。本集合计划可持有可转债转股（包括可交债换股）所得的股票，但不可直接从二级市场上买入股票。 （3）商品及衍生品类资产 境内资产包括国债期货。 境外资产包括本计划可投资于远期合约、互换和经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生品。 本计划可以依法参与证券正、逆回购交易。 如法律法规或监管机构以后允许本资产管理计划投资其他证券市场或者其他品种，资产管理计划资产管理人在征得合同各方书面同意并履行适当程序后，可以相应调整本资产管理计划的投资范围、投资比例规定，并应为资产管理人和资产托管人相关系统准备以及投资组合调整留出必要的时间。
产品风险等级	本集合计划属中风险产品，适合合格投资者中风险承受能力匹配的专业投资者和稳健型及以上的普通投资者。
存续期限	本集合计划的存续期限为10年，从集合计划成立日起计算。
分级安排	本集合计划不根据风险收益特征进行分级。
各项费用	1、参与费：0% 2、退出费：0% 3、管理费：1.5%/年 4、业绩报酬：详见本合同第二十章"资产管理计划的费用与税收" 5、托管费：0.12%/年 6、其他费用（如有）：年度专项审计费用、律师费、信息披露费用、银行结算费用、开户费等集合计划运营过程中发生的相关费用。
退出的方式	1）"未知价"原则，即人民币份额退出价格以受理申请当日人民币集合计划份额净值为基准进行计算；美元份额退出价格以受理申请当日美元集合计划份额净值为基准计算。 2）采用份额退出的方式，即退出以份额申请。
流动性安排	在开放退出期内，本集合计划资产组合中七个工作日可变现资产的价值不低于该计划资产净值的10%。
费用计提方法	1、集合计划管理人的管理费 本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的1.5%年费率计提。 2、集合计划管理人的业绩报酬 业绩报酬计提比例：业绩报酬计提比例不超过业绩报酬计提基准以上投资收益的10%。 3、集合计划托管人的托管费 本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.12%年费率计提。
计划收益分配原则	1、在符合收益分配原则的前提下，计划管理人每1年最多进行1次收益的分配； 2、计划收益分配基准日的份额净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值，即计划收益分配基准日的人民币份额净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于人民币份额面值；对于美元份额，由于汇率因素影响，存在收益分配后美元份额的份额净值低于对应的份额面值的可能； 3、同一类别的每一计划份额享有同等分配权； 4、每次收益分配不得低于基准日可供分配收益的10%； 5、收益分配币种与其对应份额的认购/参与币种相同。外币每单位收益分配金额按收益分配基准日中国人民银行最新公布的人民币对外币汇率中间价折算为相应的外币金额。 6、法律法规另有规定的从其规定。 在符合法律法规和计划合同约定，并对计划份额持有人利益无实质不利影响的前提下，管理人在与托管人协商一致后可对收益分配原则进行调整，并在管理人网站上公告。
清算	自集合计划终止之日起五个工作日内成立清算小组，清算小组成员由管理人和托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。 清算费用是指清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用（包括但不限于审计费、诉讼费、仲裁费、律师费、财产保全费、公证费、拍卖费及其他形式的资产处置费等费用），清算费用由清算小组从集合计划财产中优先支付。 依据集合计划财产清算的分配方案，将集合计划财产清算后的全部剩余资产扣除集合计划财产清算费用、税款及其他债务后，按份额持有人持有的份额比例进行分配。清算期间，管理人可以根据委托财产清算安排和投资者服务需要，对同一级别计划财产按份额持有人持有的份额比例进行分次做清算分配。 对于本计划因证券交易等原因按登记结算机构规定缴纳的保证金（包括但不限于最低结算备付金和交易单元保证金）、以及保证金和存款账户的未结利息等资产，需要在登记结算机构退回保证金及利息结息后才能收回。管理人可选择在上述资产收回后或以管理人财产先行垫资方式，将剩余委托财产分配给投资者。本计划归属投资者所有的权益全部清算分配后，本计划自投资者款项划出日起至托管账户销户完成期间产生的孳息损益归属管理人享有承担。 若本计划在终止之日因委托财产流动性受限等原因需要延期清算的，管理人应及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，并通过管理人网站进行披露。 对于本计划在终止之日流动性受限的委托财产，管理人将在对应委托财产恢复流通或交易后及时进行变现，扣除相关费用后按份额持有人持有的份额比例进行分配，清算期间变现的委托财产不得再进行投资。
违约责任	1、管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律、行政法规的规定或者本合同约定，给计划财产或者投资者造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给计划财产或者投资者造成损害的，根据实际情况，由双方分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：（1）不可抗力，不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同生效之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件。一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知另一方，并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止集合计划资产损失扩大。任何一方当事人延迟履行合同义务后，发生了上述不可抗力事件致使合同当事人无法全部或部分履行本合同，该方不能减轻或免除相应责任。（2）管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；（3）管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等；（4）在计划运作过程中，管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责，但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的。（5）本合同当事人应保证向本合同另一方提供的数据、信息真实完整，并承担相应的法律责任。如果该方提供的信息和数据不真实或不完整是由于另一方提供的数据或信息不真实、不完整等原因所致，由此造成的损失由初始过错方承担。（6）管理人及托管人对由于第三方（包括但不限于交易所、注册与过户登记人等）发送的数据错误给集合计划资产造成的损失等。（7）因资产管理人所明确的被授权人发送的相关指令违反境外投资市场所在地的法律、法规、监管规章之规定或监管机构之要求，导致资产托管人和/或境外托管人无法履行本合同项下之义务或委托财产损失的，由过错方承担责任。因境外投资市场所在地的法律、法规、监管规章之规定或监管机构之要求的变更导致资产托管人和/或境外托管人无法履行本合同项下之义务或委托财产损失的，由过错方承担责任。 2、合同当事人违反本合同，给其他当事人造成直接经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方当事人违约的情况下，合同能继续履行的，应当继续履行。 3、本合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。 4、由于管理人、托管人不可控制的因素导致业务出现差错，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成计划财产或投资者损失，管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。 5、一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接损失。 6、管理人违反法律、行政法规的有关规定，被中国证监会依法撤销证券资产管理业务许可、责令停业整顿，或者因停业、解散、撤销、破产等原因不能履行职责的，应当按照有关监管要求妥善处理有关事宜。 7、投资者的债权人通过司法机关对集合计划资产采取强制措施，由此造成集合计划资产损失的，由相关责任方承担责任。 8、资产托管人应根据《QDII试行办法》的要求以谨慎、尽职的原则选择、委任和监督境外托管人，并对境外托管人在履行职责过程中因过错、疏忽等原因而导致委托财产的损失承担相应责任。然而，在决定境外托管人是否有过错、疏忽等不当行为，应根据资产托管人与境外托管人之间的协议、相关法律及当地的证券市场惯例决定。本条不受本合同终止的影响。资产托管人在已根据《QDII试行办法》的要求谨慎、尽职的原则选择、委任和监督境外资产托管人，且境外资产托管人已按照当地法律法规的要求保管托管资产的前提下，对境外资产托管人的破产而产生的损失，资产托管人不承担责任。但资产托管人应根据资产管理人的指令采取措施进行追偿，资产管理人应予配合。资产托管人存在故意或过失行为的，应承担赔偿责任。 9、若贷记或应付委托财产账户中的金额不足以支付对资产托管人及境外托管人的所有负债，资产管理人应当按照资产托管人及其境外托管人的通知，从委托财产向境外托管人补足所需现金缺额，否则除任何给予托管人的费用和补偿外，托管人对托管资产享有持续留置权或相关适用法律规定的其他权利，并享有处置相应证券的权利，直至乙方因履行本协议而产生的债务及费用得到清偿为止。资产托管人及其境外托管人通知并非资产托管人及境外托管人行使相关权利的前提。

5. 产品名称：中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划

受托方名称：中信证券股份有限公司

公司于2020年5月20日与中信证券股份有限公司签署了《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》，具体内容如下表：

名称	中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划
类别	债券型集合资产管理计划
运作方式	契约型开放式 （1）每个运作期到期日前，集合计划份额持有人不能提出赎回申请 对于每份计划份额，第一个运作期指资产管理合同生效日（对本资产管理合同生效前相应计划份额而言，下同）或计划份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作期起始日），至资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满6个月对应的月度对日（即第一个运作期到期日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一工作日起，至资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满12个月对应的月度对日，第三个运作期指第二个运作期到期日的次一工作日起，至资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满18个月对应的月度对日止。以此类推。 （2）每个运作期到期日，集合计划份额持有人可提出赎回申请每个运作期到期日，集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一工作日起该计划份额进入下一个运作期。 集合计划份额持有人在运作期到期日申请赎回的，集合计划管理人按照资产管理合同和招募说明书的约定为集合计划份额持有人办理赎回事宜。
份额面值	本集合计划份额面值为人民币1.00元。
存续期限	本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3年。本集合计划自资产管理合同变更生效日起3年后，按照中国证监会有关规定执行。
投资范围	本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、地方政府债等）、资产支持证券、债券回购、债券逆回购、同业存单、银行存款，以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。 本集合计划不投资于股票等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。 如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，集合计划管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于债券资产比例不低于集合计划资产的80%；本集合计划保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为：【中债综合财富（1年以下）指数收益率*80%+一年期定期存款利率（税后）*20%】
费用计提方法	1、集合计划管理人的管理费 本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值0.3%年费率计提。 2、集合计划托管人的托管费 本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的0.1%的年费率计提。 3、销售服务费 本集合计划A类计划份额的年销售服务费率为【0.3】%，C类计划份额的年销售服务费率为【0.01】%。
收益分配原则	1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数最多为12次，每份集合计划份额每次集合计划收益分配比例不得低于集合计划收益分配基准日每份集合计划份额可供分配利润的10%，若《资产管理合同》生效不满3个月可不进行收益分配。 2、本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红。 3、集合计划收益分配后各类集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位该类集合计划份额收益分配金额后不能低于面值。 4、本集合计划同一类别每一集合计划份额享有同等分配权。 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不影响投资者利益的情况下，集合计划管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上集合计划收益分配原则，此项调整不需要召开集合计划份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。
清算	自出现《资产管理合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，集合计划管理人组织集合计划财产清算小组并在中国证监会的监督下进行集合计划清算。 清算费用是指集合计划财产清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划财产中支付。 依据集合计划财产清算的分配方案，将集合计划财产清算后的全部剩余资产扣除集合计划财产清算费用、交纳所欠税款并清偿集合计划债务后，按集合计划份额持有人持有的集合计划份额比例进行分配。
违约责任	一、集合计划管理人、集合计划托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《资产管理合同》约定，给集合计划财产或者集合计划份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给集合计划财产或者集合计划份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是如发生下列情况，当事人免责：1、不可抗力；2、集合计划管理人和/或集合计划托管人按照届时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；3、集合计划管理人由于按照资产管理合同规定的投资原则行使或不行使其投资权造成的损失等。 二、在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护集合计划份额持有人利益的前提下，《资产管理合同》能继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。 三、由于集合计划管理人、集合计划托管人不可控制的因素导致业务出现差错，集合计划管理人和集合计划托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成集合计划财产或投资者损失，集合计划管理人和集合计划托管人免除赔偿责任。但是集合计划管理人和集合计划托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

6. 产品名称：方正证券艾华1号单一资产管理计划

受托方名称：方正证券股份有限公司

公司于2020年7月6日对前期在方正证券股份有限公司购买的方正证券艾华1号单一资产管理计划进行追加购买，具体内容如下表：

名称	方正证券艾华1号单一资产管理计划
类别	证券公司固定收益类单一资产管理计划
运作方式	开放式； 本单一计划委托人可不定期追加委托资金，每笔委托资金自参与本计划之日起锁定6个月，锁定期满后委托人可不定期提取委托资金。委托人追加/提取委托资金需提前10个工作日以本合同约定的方式通知管理人；当提取委托资产导致计划资产少于100万元人民币时，管理人有权终止本计划。
主要投资方向与投资范围	国债、地方政府债、中央票据、政策性金融债、金融债（含证券公司次级债券）、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具PPN、资产支持证券、资产支持票据、债券逆回购、同业存单、银行存款（包括但不限于活期存款、定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、货币市场基金等标准化固定收益类资产、股票型证券投资基金、混合型证券投资基金。本计划投资的证券投资基金仅限于公募证券投资基金。本计划可参与债券正回购业务。 如法律法规或监管机构以后允许单一资产管理计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 本委托资产不投资证券市场发行交易的股票及法律、行政法规和中国证监会的明文禁止的金融工具及产品。
产品风险等级	本资管计划属于单一资产管理计划，面向合格投资者通过非公开方式发行，属于R3风险收益的投资品种。
存续期限	本合同项下单一资产管理业务存续期限为5年。经三方法定代表人（负责人）或授权代表签字或盖章并加盖公章后于本计划成立日起算。本计划提前终止时存续期限提前届满。
业绩比较基准	本资管计划不设置业绩比较基准。
费用计算方法	1、管理人的管理费 资产管理计划财产的年管理费率为1.20%。 2、托管人的托管费 资产管理计划财产的年托管费率为0.03%。 3、业绩报酬 业绩报酬核算日首先按照如下约定计算业绩报酬V： <table><tr><th>期间年化收益率</th><th>业绩报酬V</th></tr><tr><td>R<5.5%</td><td>V=0</td></tr><tr><td>5.5%≤R</td><td>$V = B\times(R-5.5\%)\times 50\%\times\frac{T}{365}$</td></tr></table>
收益分配	本计划不进行收益分配。
清算	托管人负责资产管理计划财产买卖证券交易的清算交收。证券交易所场内资金结算由托管人根据中国结算结算数据办理；其他场外资金汇划由托管人根据管理人的指令具体办理。 如果因为托管人自身过错在清算上造成资产管理计划财产的直接损失，应由托管人负责赔偿，但因中国人民银行、中国结算和银行间市场登记结算机构资金结算系统以及其他机构的结算系统发生故障等非托管人的过错造成清算资金无法按时到账的情形，托管人免责；如果因为管理人未事先通知托管人增加交易单元等事宜，致使托管人接收数据不完整，造成清算差错的责任由管理人承担；如果因为管理人未事先通知需要单独结算的交易，造成资产管理计划财产损失的由管理人承担；管理人应采取合理措施，确保在T日日终有足够的资金头寸用于T+1日中国结算的资金交收。如因管理人原因导致资金头寸不足，管理人应在T+1日上午12:00前补足头寸，确保资金交收。如果未遵循上述规定备足资金头寸，影响了资产管理计划财产自身的清算交收及托管人与中国结算之间的一级交收，由此给托管人、本资产管理计划财产及托管人托管的其他资产造成的损失由管理人负责。 如果由于管理人违反市场操作规则的规定进行超买、超卖及质押券欠库等原因造成资产管理计划财产投资清算困难和风险的，托管人在预清算结束后应通知管理人预透支和预欠库事项，管理人应保持联系方式畅通，后续补缴等事宜由管理人负责解决，由此给托管人、本资产管理计划财产和托管人托管的其他资产造成的损失由管理人承担。 根据中国结算结算规定，管理人在进行融资回购业务时，用于融资回购的债券将作为偿还融资回购到期购回款的质押券。如因管理人原因造成债券回购交收违约或因折算率变化造成质押欠库，导致中国结算欠库扣款或对质押券进行处置造成的投资风险和损失由管理人承担。 实行场内T+0非担保交收的资金清算按照托管人的相关规定流程执行。
违约责任	（一）因本合同当事人的违约行为造成本合同不能履行或者不能完全履行的，由违约的一方承担违约责任；如属本合同当事人双方或多方当事人的违约，根据实际情况，由违约方分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况，当事人可以免责： 1、管理人或托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规的作为或不作为而造成的损失等。 2、在没有故意或重大过失的情况下，管理人由于按照本合同规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等。 3、不可抗力。 4、在没有故意或重大过失的情况下，托管人由于按照管理人的有效指令执行而造成的损失等。 5、托管人对因所引用的证券经纪商及其他中介机构提供的信息的真实性、准确性和完整性存在瑕疵所引起的损失不承担任何责任； 6、委托人理解委托财产的投资、运作、托管面临本合同第十九条中列举的各类风险，管理人及托管人就委托财产面临的上述固有风险免于承担责任。 7、委托人签署本合同视同已同意管理人对委托财产所进行的本合同投资范围内的投资，此类投资或资产转让等所产生的直接或间接经济损失，如非因管理人过错引起的损失，管理人不予承担。 8、委托人未能事前向管理人及托管人履行信息披露义务（如告知关联证券或其他禁止交易证券等），致使发生违规投资行为的，管理人与托管人均不承担任何责任，委托人需就管理人与托管人由此遭受的损失承担赔偿责任。 9、法律法规规定及本合同约定的其他情况。 （二）管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反相关法律法规的规定或者本合同规定，给委托财产或者委托人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任。 （三）在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护委托人利益的前提下，本合同能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。 不论本合同前文对"损失"是否做出限定，本合同提及的"损失"，均指"直接损失"。任何一方向其他方赔偿时，仅限于赔偿其他方因一方的违约行为给其他方造成的直接损失。

（二）委托理财的资金投向

1. "汇利丰"2020年第5108期对公定制人民币结构性存款资金投向

本结构性存款产品本金由中国农业银行100%投资于同业存款、同业借款等低风险投资工具，收益部分与外汇期权挂钩获得浮动收益。

2. 兴银基金－福安5号FOF单一资产管理计划资金投向

本计划可投资于固定收益类私募证券投资基金、固定收益类资产管理计划、国内依法发行和上市交易的债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、地方政府债、次级债、可转换债券、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具）、债券型公开募集证券投资基金、货币市场基金、债券回购、银行存款、现金。其中，本计划主要投资于固定收益类私募证券投资基金。

3. 华泰紫金月月购3个月滚动持有债券型证券投资基金资金投向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

4. 华泰紫金中国精选1号集合资产管理计划资金投向

（1）固定收益类资产

境内资产包括现金、银行存款、协议存款、同业存单、货币市场基金、债券型基金、债券回购、国债、政策性金融债、央票、地方债、金融债（含次级债和混合资本债）、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券，非公开定向债务融资工具、资产支持证券、资产支持票据、永续债、可转换债券、可交换债券、结构化存款、结构化票据、收益凭证等。

境外资产包括政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的货币型基金、债券型基金（包括ETF）等。

（2）权益类资产

仅限于投资可转债转股（包括可交债换股）所得的股票。本集合计划可持有可转债转股（包括可交债换股）所得的股票，但不可直接从二级市场上买入股票。

（3）商品及衍生品类资产

境内资产包括国债期货。

境外资产包括本计划可投资于远期合约、互换和经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生品。

本计划可以依法参与证券正、逆回购交易。

如法律法规或监管机构以后允许本资产管理计划投资其他证券市场或者其他品种，资产管理计划资产管理人在征得合同各方书面同意并履行适当程序后，可以相应调整本资产管理计划的投资范围、投资比例规定，并应为资产管理人和资产托管人相关系统准备以及投资组合调整留出必要的时间。

5. 中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、地方政府债等）、资产支持证券、债券回购、债券逆回购、同业存单、银行存款，以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本集合计划不投资于股票等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

6. 方正证券艾华1号单一资产管理计划

国债、地方政府债、中央票据、政策性金融债、金融债（含证券公司次级债券）、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具PPN、资产支持证券、资产支持票据、债券逆回购、同业存单、银行存款（包括但不限于活期存款、定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、货币市场基金等标准化固定收益类资产、股票型证券投资基金、混合型证券投资基金。本计划投资的证券投资基金仅限于公募证券投资基金。本计划可参与债券正回购业务。

如法律法规或监管机构以后允许单一资产管理计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本委托资产不投资证券市场发行交易的股票及法律、行政法规和中国证监会的明文禁止的金融工具及产品。

（三）风险控制分析

公司将风险控制放在首位，对理财产品投资严格把关，谨慎决策，公司选择的上述理财产品风险等级不高，预期收益受风险因素影响较小，符合公司内部资金管理的要求。在理财期间，公司将与产品发行方保持紧密联系，跟踪资金的运作情况，加强风险控制和监督，保证资金安全。

三、委托理财受托方的情况

1. "汇利丰"2020年第5108期对公定制人民币结构性存款受托方为中国农业银行股份有限公司，为已上市金融机构（证券代码：601288）。受托方符合公司委托理财的各项要求，与公司、公司控股股东及实际控制人之间不存在关联关系。

2. 兴银基金－福安5号FOF单一资产管理计划受托方为兴银基金管理有限责任公司（以下简称"兴银基金"）。

（1）兴银基金基本情况

名称	成立时间	法定代表人	注册资本（万元）	主营业务	主要股东及实际控制人	是否为本次交易专设
兴银基金管理有限责任公司	2013年10月25日	张贵云	14,300	基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。	华福证券有限责任公司（76%）、国脉科技股份有限公司（24%）。实际控制人为华福证券有限责任公司。	否

（2）兴银基金最近一年又一期主要财务指标

单位：万元

项目	2020年3月30日	2019年12月31日（经审计）
总资产	97,774.18	98,845.23
净资产	81,600.93	82,508.77
项目	2020年1-3月	2019年1-12月（经审计）
营业收入	4,962.88	29,385.02
净利润	1,869.35	11,833.99

兴银基金符合公司委托理财的各项要求，与公司、公司控股股东及实际控制人之间不存在关联关系。

3. 华泰紫金月月购3个月滚动持有债券型证券投资基金、华泰紫金中国精选1号集合资产管理计划受托方均为华泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称"华泰资产"）

（1）华泰资产基本情况

名称	成立时间	法定代表人	注册资本（万元）	主营业务	主要股东及实际控制人	是否为本次交易专设
华泰证券（上海）资产管理有限公司	2014年10月	崔春	260,000	证券资产管理业务，公开募集证券投资基金管理业务。	华泰证券股份有限公司	否

（下转C62版）