

多喜爱集团股份有限公司股东
上海骏胜资产管理有限公司
关于对深圳证券交易所中小板关注函的回复

上海骏胜资产管理有限公司（以下简称“上海骏胜”，“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《关于对上海骏胜资产管理有限公司的关注函》（中小板关注函【2018】第425号）（以下简称“关注函”）。2018年12月21日多喜爱集团股份有限公司收到上海骏胜回函，现将有关回复公告如下：

上海骏胜资产管理有限公司：

2018年12月13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，你公司因触发了与平安证券股份有限公司（以下简称“平安证券”）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13日被平安证券股份有限公司强制平仓，平仓股数为935.25万股，占多喜爱总股本的4.59%。本次被动减持前，你公司持有多喜爱股份1614.51万股，占多喜爱总股本的7.91%。本次被动减持后，你公司持有多喜爱股份679.26万股，占多喜爱总股本的3.33%。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，触发了与平安证券签订的《融资融券合同》中约定的强制平仓条件，平安证券于2018年12月13日强制平仓导致你公司被动减持多喜爱股份935.25万股。

我部对此表示高度关注，请你公司对以下问题作出说明：

1、请说明你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等。

【回复】：

我司作为产品通道方，以管理费形式收取通道费0.1%，未对产品进行任何推介募集，投资资金来源于鲁证期货股份有限公司（以下简称“鲁证期货”）管理的FOF产品，实际

交易团队、投资者及托管方均由鲁证期货指定，我司仅与鲁证期货指定的联系人保持沟通，对于实际交易团队的成员、运作等信息并不了解。产品投资人明细如下表所示：

骏胜晓旭 1 号私募证券投资基金	
成立时间：2018 年 5 月 21 日；规模：1.02 亿元	
钱玉丝	100 万
李彬剑	100 万
鲁证万泰 FOF 六期资产管理计划	10000 万
骏胜晓旭 2 号私募证券投资基金	
成立时间：2018 年 5 月 21 日；规模：1.35 亿元	
鲁证万泰 FOF 六期资产管理计划	8000 万
鲁证万泰 FOF 七期资产管理计划	3000 万
鲁证万泰 FOF 五期资产管理计划	2500 万
骏胜晓旭 3 号私募证券投资基金	
成立时间：2018 年 5 月 28 日；规模：5100 万元	
鲁证万泰 FOF 六期资产管理计划	500 万
鲁证万泰 FOF 三期资产管理计划	400 万
鲁证万泰 FOF 四期资产管理计划	4200 万

晓旭系列产品投资策略为股票多头和场外期权，产品托管方由鲁证期货指定为兴业银行股份有限公司西宁分行（以下简称“兴业银行”）。

产品成立后，实际交易团队主导与上海侨江金融服务有限公司（以下简称“侨江金融”）开展以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》，函中称“鲁证期货认可包含骏胜晓旭系列产品在内的 9 个私募基金产品开展以产品净值为标的的场外衍生品，认同私募基金产品管理人与外包服务机构协商一致的估值方式，即场外衍生品买方按照实际支付权利金金额计入产品成本，场外衍生品卖方按照实际

收取权利金金额计入产品收入。”在此估值方式下，侨江金融作为期权买方向晓旭系列产品共支付权利金 1242.17 万元。实质达到维持晓旭系列产品净值不低于 1 的目的。

产品成立后，我司在平安证券股份有限公司（以下简称“平安证券”）为产品开立股票普通账户和两融账户，并将账户密码给予了鲁证期货指定团队。晓旭系列产品交易及风控主要通过平安证券提供的 PB 系统进行，因此我司申请为实际交易团队开通了交易权限及风控权限。12 月 3 日当天实际交易团队操作风控角色关闭了产品风控设置，晓旭系列产品持有上市公司股份的仓位不受限制，因此交易员角色下单不受风控设置的约束，随后进行了大量买入多喜爱股份的操作，导致晓旭系列产品作为一致行动人违规举牌。

违规举牌行为发生当日，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了《简式权益变动报告书》。

2、请你公司说明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。若否，则说明实际信息披露义务人的名称。

【回复】：

由于我司作为晓旭系列产品的通道方，仅以管理费形式收取通道费 0.1%，不收取其他任何费用。多喜爱股份为鲁证期货指定实际交易团队买入，股份权益归投资者所有，我司对该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》第二条、第四十九条、《证券法》第七十四条第一款第（二）项、《上市公司收购管理办法》第十二条、第十三条规定，该股份权益登记在我司名下的，虽然我司为通道方，但我司作为产品名义上的管理人，具有相关信息披露义务。

3、你公司与国亚金控资本管理有限公司（以下简称“国亚金控”）同时增持多喜爱股份超过 5%但未停止增持，请说明你公司是否同国亚金控存在关联关系，是否受同一实际控制人或投资人控制。

【回复】：

我司以及我司的股东、董事、监事、高级管理人员、主要关联方均未在国亚金控资本管理有限公司中拥有权益，不存在关联关系。

2018 年 8 月 15 日鲁证期货向兴业银行提供的《告知函》中，明确提到认可骏胜晓旭系列产品与《国亚金控-汇信 2 号证券私募基金》、《国亚金控-汇信 3 号证券私募基金》采

取相同估值方式，目前我司通过上市公司公告得知，国亚金控举牌多喜爱股份的正是这两只私募基金。

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》和《上市公司收购管理办法》的情况，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】：

我司在上述违规事实发生过程中，不存在其他违反《证券法》和《上市公司收购管理办法》的情况。

12月3日违规举牌当晚，由实际交易团队联系人整理交易信息，并发给我们一份《多喜爱集团股份有限公司简式权益变动报告书》，由我司补充公司基本信息并盖章扫描，实际交易团队联系上市公司出具公告。因为实际交易都由实际交易团队负责，相关文书由他们草拟，我们对于他们的交易目的及交易行为并不进行干预，只是出于通道方的身份，根据当时与鲁证期货的约定，完成盖章义务，以我们名义发出而已，简式权益变动书中所陈述的权益变动目的非我司真实意见。

5、你认为需要说明的其他内容

【回复】：

举牌事件发生后我司发现实际交易团队修改了产品账户的密码。

由于实际交易团队的操作触发了与平安证券签订的《融资融券合同》中约定的强制平仓条件，平安证券于2018年12月13日强制平仓导致我司被动减持多喜爱股份935.25万股。截至报告反馈日，我司并未主动买卖过多喜爱股份。

上海骏胜资产管理有限公司

2018年12月21日