

快意电梯股份有限公司

关于对使用闲置自有资金购买理财产品的补充公告

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

快意电梯股份有限公司（以下简称“公司”）分别于2020年4月11日、2020年6月20日披露了《关于使用闲置自有资金购买理财产品的进展公告》（2020-028、2020-047），公司使用闲置自有资金分别向东莞证券股份有限公司（以下简称“东莞证券”）和国信证券股份有限公司（以下简称“国信证券”）购买了集合资产管理计划（以下简称“资产管理计划”或“集合计划”），现将相关事项补充公告如下：

一、资产管理计划的基本情况

公司目前使用闲置自有资金购买的尚未到期的资产管理计划如下：

| 产品名称 | 鼎信恒睿12个月1号集合资产管理计划 | 旗峰半年盈10号集合资产管理计划 | 旗峰季季盈3号集合资产管理计划 |
|---------|--|--|-------------------------|
| 管理人名称 | 国信证券 | 东莞证券 | 东莞证券 |
| 理财金额 | 2000万元 | 5000万元 | 2000万元 |
| 起息日 | 2020-04-08 | 2020-04-15 | 2020-06-23 |
| 到期日 | 2021-04-07 | 2020-10-16 (以产品公告为准) | 2020-12-08 (以产品公告为准) |
| 预计年化收益率 | 4.40% | 4.70% | 4.70% |
| 投资范围 | 1、固定收益类资产，包括：债券、在证券交易所和银行间市场上市的资产支持证券（票据）优先级、债券逆回购、银行存款、公募债券型基金、公募货币市场基金等。 2、在证券期货交易所等国务院同意设立的交易场所集中交易清算的期货及期权合约等标准化金融衍生品类资产，仅包括国债期货。 3、本集合计划可以参与债券正回购交易。 法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。 | 国内依法发行的国债、金融债、中期票据、公司债、企业债、地方政府债券、可转债、分离交易可转债、可交换债、短期融资券、债券逆回购、非公开定向债务融资工具（PPN）、银行存款、同业存单、央行票据、债券型基金、货币市场基金。 | |

二、管理人东莞证券针对资产管理计划的风险管控措施

东莞证券建立了完善的风险管理制度及组织架构，对投资的事前、事中、事后均进行全流程的风险管控。

（一）风险管理理念和相关制度、组织架构

（1）东莞证券已建立完善的风险控制组织结构

东莞证券建立以董事会为最高决策机构，经营管理层为执行管理机构，风险管理部门为监督、统筹、协调部门，各部室、各分支机构为执行落实主体的风险管理组织架构。董事会和经营管理的主要负责人对东莞证券风险管理的有效性负最终责任。各部室、各分支机构的负责人对本部门风险管理的有效性承担直接责任。东莞证券所有员工应坚持诚信、勤勉的执业原则，依据有关规定自觉履行风险管理职责。

a、公司层级的风险管理制度，为加强风险管理，东莞证券制定了一系列内部控制管理制度。

b、资产管理部内部控制制度,除东莞证券的公司内部控制制度之外,管理人的具体执行部门也制定了一系列行之有效的内控制度,主要有:

①投资管理制度,包括《东莞证券资产管理部投资决策小组议事规则》、《东莞证券资产管理部投资管理办法》、《东莞证券资产管理部投资交易管理办法》。

②风险控制制度,包括《东莞证券资产管理部风险控制管理办法》、《东莞证券资产管理部风险控制小组议事规则》。

③其他相关制度。

A、东莞证券资管管理业务已建立完善的风险控制组织结构

a、东莞证券资产管理部设有专职风控专员岗位,负责对业务流程的事前、事中、事后进行风险控制。

b、东莞证券资产管理部设有投资决策小组,负责对投资策略、投资品种、投资金额等事项进行决策。c、资产管理部内部控制制度,除东莞证券的公司内部控制制度之外,管理人的具体执行部门也制定了一系列行之有效的内控制度,主要有:

①投资管理制度,包括《东莞证券资产管理部投资决策小组议事规则》、《东莞证券资产管理部投资管理办法》、《东莞证券资产管理部投资交易管理办法》。

②风险控制制度,包括《东莞证券资产管理部风险控制管理办法》、《东莞证券资产管理部风险控制小组议事规则》。

③其他相关制度。

d、建立证券投资库，由投资决策小组、东莞证券的公司资产管理投资决策委员会讨论决定入库证券名单，投资经理只能对证券投资库内的品种进行投资。

e、资产管理部已安装并运行专门的投资管理软件，通过标的库的设置、防止对敲、买卖控制等专业手段对投资业务进行实时监控，能实时进行风险监控、识别和预警；对于网下交易则实行实时控制；公司合规与风险管理部对资产管理业务同时进行风险监控。

f、投资经理发出具体的投资指令，由投资总监审核后方可由交易员完成投资指令。

g、资管管理计划的资产与管理人资产以及其他资产完全分开，独立设立账户，进行独立管理与核算。资管管理计划的会计核算与管理人会计核算在业务岗位上进行严格分离。

h、实施信息隔离墙制度，资管管理计划运作部门和管理人的自营部门在场地、人员、交易席位、资金、账户和投资研究方面实行严格分离，各自独立运作。一直以来，资产管理业务的分管领导与自营业务的分管领导一直分设并从未相互调换，资产管理业务的主要部门领导、业务人员也从未与自营业务的有关人员相互调换。

i、实行投资授权制度，明确规定公司资产管理投资决策委员会、分公司投资决策小组、投资经理三个层次的投资权限。

j、根据《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《证券公司客户资产管理业务规范》的相关规定、《东莞证券资产管理部投资管理办法》以及资产管理合同的约定，建立风险控制指标体系，通过投资管理软件实现风险控制。

k、公司合规与风险管理部对资产管理计划的资金、证券投资情况进行实时监控，并定期进行稽核检查，对资产管理计划的运作进行事前、事中和事后的监督。

(二) 投资的事前、事中、事后风控管理

(1) 事前严控标的入池标准：

a、债券发行主体为国企，其中主体是城投的，主体和债项至少一项评级为AA+以上，主体是产业的，债项评级必须为AAA，主体AA及以上。且优选有专业担保公司担保，在市场中属于流动性较好的标的，流动性有较大保障。

b、规避市场敏感区域和负债较高区域；

(2) 事中严格执行入池流程：

a、信评人员根据入库标准筛选债券，根据内部评级模型评估，并进行相应的尽调，综合评级债券资质和收益率，形成打分结果，优选性价比高债券

b、信评人员对所选债券进行入库，资产管理部固收投资管理小组进行审核并出具意见

c、投资经理根据固收小组出具的意见进行额度和久期控制，并根据市场变化作出仓位调整

(2) 事后持续跟进评估：

a、信评人员跟踪持仓主体和债券的信用变化，并定期和不定期对债券进行信用评估；

b、定期对持仓债券评估，根据评估的结果对债券进行打分，并形成不同等级，经固收小组审议，投资经理根据审议结果进行相应的处理。

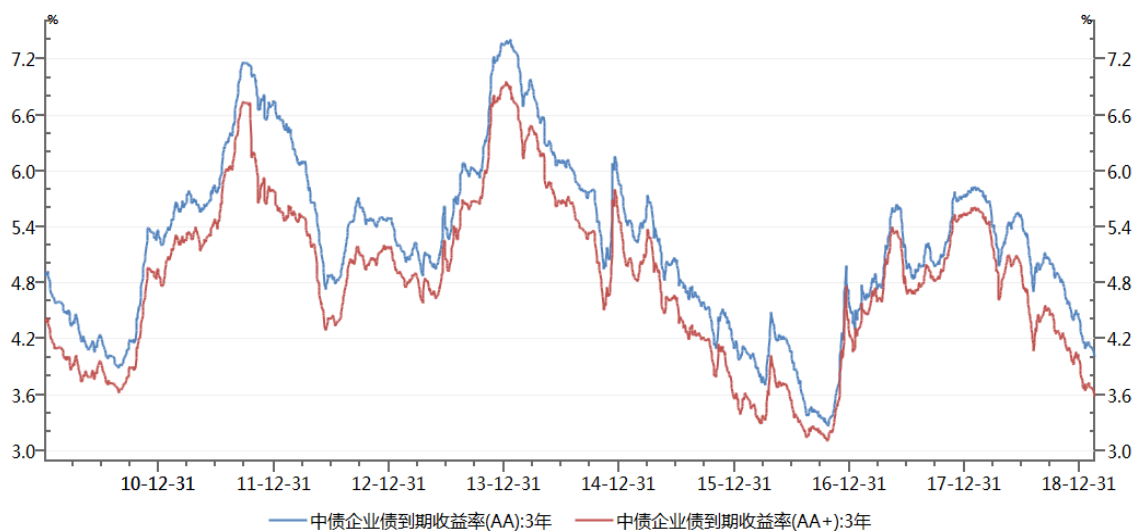
(三) 风险的应对措施：

(1) 信用风险

固收类资产管理计划主要投资于债项评级为 AA+ 及以上的债券，同时要求明确“当信用类债券的债项评级或短期融资券债券评级或主体评级下降而导致信用类债券评级不符计划产品投资规定时，要求计划产品在 15 个交易日内将不符合规定的信用类债券卖出”。在当前环境下，此类债券风险较低，信用风险可控。

(2) 利率风险

债券利率波动风险



数据来源:中国债券信息网 Wind

从 2010 年以来，3 年期 AA 和 AA+ 的收益率最大变动在 250BP 附近，以此考虑，产品受收益率影响年度最大回撤在 6.25% 以内，单位净值大概回落至 0.938，能控制在预警线以上。这是按照最悲观的情况来测算，由此可以推断，该集合计划的净值回撤幅度有限，能够得到控制。

（3）流动性风险

正回购融资流动性风险

固收类集合计划配债评级要求在 AA+ 及以上，在当前的流动性环境下，能够满足质押回购的要求；且东莞证券制定有流动性应急机制，在流动性出现紧张问题时，会启动应急流程，确保回购不会出现违约风险。最近多年的产品头寸管理经验来看，尚未出现过 1 起回购风险事件。

（4）市场风险

固收类集合计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。东莞证券对于资管产品持仓债券跌幅设定限制，一旦持仓债券达到预警值及止损值，会召开固收小组会议，在流动性满足的情况下，启动止损程序，将损失控制在可接受范围内。

三、管理人国信证券针对资产管理计划的风险管控措施

国信证券的资产管理总部将采取有效措施控制集合计划风险，管理人对本集合计划面临的各项风险进行有效评估，严格控制风险，并对风险控制负相应责任。

为了对投资风险进行防范和控制，本集合计划将严格遵循以下的控制措施：

（1）研究质量控制

- （a）制定详细的研究工作流程；
- （b）深入和全面地拟定对投资对象的调查程序；
- （c）建立相关投资人员的定期考核制度；

（2）投资执行的程序控制

本集合计划投资交易的执行实行分类授权管理，将投资经理、交易员、风控人员的权限予以划分，保证投资执行过程严格按既定程序执行，所有交易指令都有书面或电话录音记录。

（3）投资比例风险控制

投资经理定期检查组合中的投资比例，若与集合计划现行法规和《集合资产管理合同》规定的比例不符，应立即予以调整。风险管理总部通过投资管理系统对可在系统中进行设置的相应阈值进行设置。资产管理总部风控人员对组合中的投资比例进行检查，发现问题立即向投资经理指出并敦促调整。

（4）投资禁止行为控制

资产管理总部建立相应机制，确保严格按照集合资产管理合同要求进行投资。资产管理总部风控人员根据本集合计划《集合资产管理合同》的规定对集合计划的投资禁止行为情况进行检查，发现问题立即向有关人员指出，并向管理人的高级管理层汇报。

（5）信息资料保密控制

本集合计划管理人建立内部信息密级制度，进行授权管理，对各类业务信息的流向做出规定。建立多层次信息隔离防火墙，对有关投资交易、会计核算等核心业务信息严格控制。

（6）期货投资风险控制

为控制公司资产管理业务投资国债期货的业务风险，根据《证券公司参与股指期货、国债期货交易指引》等法律法规，管理人制定了资产管理业务参与期货的相关内部制度，对内部投资决策流程、业务操作程序和权限、风险事项处理等事项作出详细规定。

期货交易风险防范措施和责任承担具体如下：

（a）流动性风险及其应急处理机制

期货投资的流动性风险主要包括持仓组合的流动性风险以及资金流动性风险。

持仓的流动性风险通过如下措施进行管理：参与交易时主要选择成交活跃、流动性好的合约作为标的；突发情况导致市场流动性严重不足，制定应急措施和处理方案。

资金流动性风险通过如下风险指标与措施进行管理：日常保证金头寸管理与资金调度、划转由专人负责，并设置风险监控指标；建立特殊事件应急处理机制。其中，期货保证金的流动性应急处理机制为：期货保证金账户上，期货资金账户可用保证金/期货持仓占用保证金 $>50\%$ 。如果期货保证金账户上的现金低于上述比例，由投资经理将集合计划资产中的现金或其他资产变现后，划转至期货保证

金账户，补充保证金，以满足上述比例要求。上述补充保证金的操作导致的损失由委托资产承担。

(b) 强制平仓或爆仓风险

风险防范措施：实时监控风险指标（预留现金及现金等价物与期货合约价值的比例），并进行分级警示，确保预留保证金能应对市场绝大部分情况下的波动。当市场持续出现极端不利行情时，投资决策人员可以根据市况提前平掉部分仓位，或者通过调整其他持仓增加预留保证金，避免出现期货爆仓等不利情形。

责任承担：期货价格波动导致爆仓或被强行平仓，属于正常的市场风险，由投资者自行承担净值损失；系统故障导致金融衍生品爆仓或被强行平仓，由系统供应商承担责任。

(c) 信用风险

风险防范措施：在出现重大突发事件可能导致期货交易信用风险时，召开投资决策会议，适当调整投资策略，采取及时平仓或者其他必要措施尽力规避信用风险。

责任承担：期货交易过程中如出现信用风险，有过错的一方应承担相应责任。

(d) 结算风险

风险防范措施：本集合计划将选择具有证券、期货经纪业务资格且风险管控能力强的机构进行证券交易，并定期了解所选机构的信用和合规状况，尽可能降低本集合计划承担的结算风险。

责任承担：当证券公司、期货经纪公司由于违规经营或者风险管控不力导致金融衍生品出现结算风险并造成损失时，由相关证券公司和期货经纪公司承担责任。

四、快意电梯公司针对理财产品的风险管控措施

(一) 公司将实时分析和跟踪购买的理财产品净值变动情况，如评估发现存在可能影响公司资金安全的风险因素，将及时采取相应措施，控制投资风险。

(二) 公司审计部负责审计、监督理财产品的资金使用与保管情况，将定期对所有理财产品项目进行全面检查，并根据谨慎性原则，合理地预计各项投资可能发生的收益和损失。

(三) 董事会对投资理财资金使用情况进行监督，公司独立董事、监事会有权对资金使用情况进行监督与检查，必要时可以聘请专业机构进行审计。

(四) 公司将根据深圳证券交易所的有关规定，及时履行信息披露义务。

特此公告。

快意电梯股份有限公司董事会

2020年6月23日