

上海菲林格尔木业股份有限公司
关于使用闲置自有资金投资金融产品的进展公告

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：

- 投资金融产品受托方：中信证券股份有限公司
- 投资金融产品金额：1 亿元
- 投资金融产品类型：开放式混合类集合资产管理计划
- 投资金融产品期限：12 个月
- 特别风险提示：管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划本金不受损失，也不保证最低收益。
详见“三、投资金融产品合同的主要内容（二）风险揭示”。

一、投资金融产品概述

（一）投资金融产品的基本情况

为提高资金使用效率，上海菲林格尔木业股份有限公司（以下简称“公司”）与中信证券股份有限公司签署了《中信证券估值优选 7 号集合资产管理计划资产管理合同》。

- 1、产品名称：中信证券估值优选 7 号集合资产管理计划
- 2、产品类型：开放式混合类集合资产管理计划
- 3、产品成立日：2018 年 12 月 17 日
- 4、投资期限：12 个月
- 5、认购金额：1 亿元
- 6、资金来源：公司闲置自有资金
- 7、关联关系说明：公司与中信证券股份有限公司之间不存在关联关系。

（二）公司内部履行的审批程序

公司于 2018 年 6 月 21 日召开了 2017 年年度股东大会，审议通过了《关于公司以闲置自有资金投资金融产品的议案》，授权公司管理层在符合法律法规要求、风险可控且不影响公司流动性的前提下，利用公司的闲置自有资金投资银行、证券公司、保险公司或信托公司等金融机构产品，授权的有效期为 2017 年年度股东大会审议通过之日起至 2018 年年度股东大会审议通过新的授权为止。授权额度为单笔 2.6 亿元以下，同时累计最高余额不超过上述规定为限，可以滚动购买。

二、投资金融产品协议主体的基本情况

（一）公司投资的金融产品受托方为中信证券股份有限公司，公司已对交易对方的基本情况、信用评级情况及其交易履约能力进行了必要的尽职调查，认为交易对方具备履约能力。

（二）协议主体的基本情况

- 1、受托人：中信证券股份有限公司
- 2、企业性质：股份有限公司(上市)

3、注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

4、法定代表人：张佑君

5、注册资本：人民币1211690.840000万元

6、经营范围：证券经纪（限山东省、河南省、浙江省天台县、浙江省苍南县以外区域）；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；股票期权做市。

三、投资金融产品合同的主要内容

（一）产品说明

1、产品名称：中信证券估值优选7号集合资产管理计划

2、管理人：中信证券股份有限公司

3、托管人：中信银行股份有限公司总行营业部

4、产品类型：开放式混合类集合资产管理计划

5、产品规模及人数限制：本集合计划具体募集规模上限以管理人公告为准，但不超过50亿份。本集合计划委托人数量为2人以上（含）200人以下（含）。

6、产品存续期：本集合计划存续期限为10年，出现集合资产管理合同约定的终止情形时，终止清算。

7、产品投资范围：（1）银行存款、同业存单，以及符合《指导意见》规定的标准化债权类资产，包括在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动性机制的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、经银行间市场交易商协

会批准注册发行的各类债务融资工具（如短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、非公开发行公司债；债券回购、债券逆回购；

（2）国内依法发行的股票（含新股申购、定向增发）、“港股通”股票以及其他经中国证监会允许的集合资产管理计划可以通过内地其他证券交易所和香港联合交易所建立的技术连接机制买卖的特定范围内的香港联合交易所上市股票（管理人在进行投资前应提前与托管人进行沟通，上述投资标的的实际投出，须以资产管理人与托管人系统可支持该投资标的的风控、运营为前提）。

（3）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股指期货、国债期货、商品期货；

（4）公开募集证券投资基金（以下简称公募基金），以及中国证监会认可的比照公募基金管理的资产管理产品。

8、预警线设置：本集合计划设置预警线 0.90 元。

9、止损线设置：本集合计划设置止损线 0.85 元。

10、托管费用及管理费用：托管费（年费率）：0.1%；管理费（年费率）：1.35%。

11、业绩报酬：在本集合计划分红权益登记日、委托人退出日和计划终止日，将根据委托人的期间年化收益率，对期间年化收益率超过 8%（即业绩报酬计提基准）的部分按照 20%的比例收取业绩报酬，但若分红权益登记日距本集合计划的成立日或上一个计提业绩报酬的分红权益登记日的间隔期间不足 6 个月的，管理人在本次分红权益日不得提取业绩报酬。

12、管理方式：本集合计划由管理人进行主动管理，在本合同约定的投资范

围及比例限制内，独立运作集合计划的资产。

13、收益分配方式：集合计划默认分红方式为现金分红，投资者可以选择现金分红或红利再投资分红方式。

（二）风险揭示

本集合资产管理计划面临的风险，包括但不限于：

1、市场风险：市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的价格波动，导致收益水平变化，产生风险。

2、管理风险：在集合资产管理计划运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如变更投资经理、管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响集合资产管理计划的收益水平，从而产生风险。

3、流动性风险：集合资产管理计划不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

4、信用风险：信用风险是指债券等固定收益类产品发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

5、参与债券正回购的风险：债券回购为提升集合计划的组合收益提供了可能，但也存在风险。用于融资回购的债券将作为资产托管人相关结算备付金账户偿还融资回购到期购回款的质押券，若资产管理人债券回购交收违约，资产管理人和委托人面临结算公司依法对质押券进行处置的风险。

6、委托人参与、退出集合计划风险

7、合同变更风险

8、电子合同风险：本集合计划采用电子签名合同方式签订，在合同签订过程中可能存在无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障，从而导致电子合同无法及时签订，从而影响委托人的投资收益。电子合同签订后，委托人凭密码进行交易，委托人通过密码登陆后所有操作均将视同本人行为，如委托人设置密码过于简单或不慎泄露，可能导致他人在未经授权的情况下操作委托人账户，给委托人造成潜在损失。

9、管理人、托管人风险：担任集合资产管理计划管理人的证券公司、资产托管机构，因停业整顿、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能给委托人带来一定的风险。

10、金融衍生品投资风险

11、所投资公募基金的特别风险：本集合计划可能投资于公募基金，集合计划管理人对发行公募基金公司的内控信息获取不全，控制力不强，并且所投资公募基金的管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如变更投资经理、管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响公募基金的收益水平，从而产生风险。

12、新股申购风险：新股申购风险是指获配新股上市后其二级市场交易价格下跌至申购价以下的风险。由于网下获配新股有一定的锁定期，锁定期内股票价格受各种市场因素、宏观政策因素等的影响，股票价格有可能下跌到申购价以下。

13、定向增发的特别风险：本集合计划可能以定向增发形式参与股票投资，此类投资除股票投资的共有风险外，与二级市场直接买入相比，通过定向增发购买的股票一般会设置一定期限的锁定期，锁定期内不得交易。所以定向增发策略整体流动性低于二级市场交易策略，有可能给投资者带来损失。2017年5月27

日，证监会发布《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》（证监会公告[2017]9号），股东减持比例缩小导致减持周期拉长，影响本集合计划的流动性，委托人委托资产变现周期拉长，定增投资的不确定性提高。

14、止损风险：本集合计划虽然设有止损线，但由于所投资标的市场流动性较差等原因，管理人不保证本集合计划的份额净值能够保持在止损线以上或附近，在极端情况下，本集合计划终止日的份额净值可能远低于止损线。同时将本集合计划面临提前终止的风险。资产总值与资产净值不同，集合计划份额累计净值低于 0.90 元时，管理人于 T+10 日内将权益类资产的投资比例降低至不超过集合计划资产总值的 20%。

15、“港股通”特殊风险

16、关联交易的风险：管理人可能将集合计划的资产投资于本机构、托管机构及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销的证券，或者从事其他重大关联交易。相关投资存在一定风险，提请委托人知悉、充分关注，委托人签订本合同即代表委托人认可同意上述关联交易并自愿承担相关风险。

17、其他风险

（三）风险控制

1、风险控制体系

（1）管理人风险控制和内部监查体系

根据各类法律法规及监管要求，管理人内部控制检查监督部门的组织结构日益完善，建立了以董事会下属的风险管理委员会为决策机构、相关内部控制部门和前台内部控制人员发挥监督作用的组织模式，形成了以风险管理部、稽核审计

部、合规部、法律部为核心的、以业务部门自身监控岗位为辅助的，较为完善的多层次内部控制体系，从决策、执行和监督三个层面上控制风险。

风险管理部与稽核审计部、合规部、法律部等一起形成覆盖管理人业务全过程（事前、事中和事后）的风险控制和内部监察机制。

（2）风险控制内部小组。资产管理业务部门专设风险控制小组，对资产管理账户的运作风险进行防范和控制。

（3）资产管理业务各相关业务岗。资产管理业务各相关业务岗负责人负责制定、完善与该岗位有关的风险控制原则和管理办法，加强业务人员对风险的认知，在执行业务过程中降低业务风险。

（4）外部独立审计。作为上市公司，定期接受外部独立审计机构的常规审计，同时对集合计划出具单独审计意见。

2、风险控制原则

（1）全面性原则。风险管理必须覆盖集合资产管理业务涉及的所有部门、岗位和其业务流程的各个环节。

（2）相互制约原则。集合资产管理业务的内部组织结构必须形成各部门及各岗位相对独立、相互制约、权责明确的制衡体系。

（3）防火墙原则。集合资产管理业务与管理人其他业务（自营、经纪、投资银行、研究咨询）之间，以及其他类型资产管理业务之间必须建立严格的防火墙隔离机制。

3、风险控制程序

（1）建立风险控制结构，完善风险控制制度。

（2）风险识别：综合利用从上至下和从下至上的方法，对各类风险及各个

风险点进行全面有效识别。

(3) 风险度量：综合运用各类定性和定量的分析方法，评估各类风险及各个风险点的风险水平。

(4) 风险处理：依据各类风险及各个风险点的风险水平，参照既定的风险控制目标，实施一定的控制措施，对于某些后果极其严重的风险，则启动相应的应急处理预案。

(5) 监督与检查：对已有的风险管理系统要监视及评价其有效性，在必要时适时加以修正。

(6) 风险报告与反馈：建立自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度自上而下做出决策反馈。

四、风险控制措施

1、遵守审慎投资原则，严格筛选发行主体，选择信誉好、资金安全保障能力强的发行机构。

2、公司财务部及时分析和跟踪金融产品投向、进展情况，一旦发现存在可能影响公司资金安全的风险因素，将及时采取保全措施，控制投资风险。

3、公司独立董事、监事会有权对公司投资金融产品的情况进行定期或不定期检查，必要时可以聘请专业机构进行审计。

4、公司董事会将根据上海证券交易所的有关规定，及时履行信息披露义务。

五、对公司的影响

在符合国家法律法规，确保公司正常经营所需流动资金的情况下，公司使用暂时闲置自有资金进行金融产品投资，不会影响公司日常资金周转需要及公司主

营业务的正常开展。通过适度理财，可以提高资金使用效率，进一步提升公司整体业绩水平，为公司股东谋求更多的投资回报。

六、公司以闲置自有资金投资金融产品情况

2018年11月8日起至本公告日公司以闲置自有资金投资金融产品情况如下：

单位：万元

交易日期	金融公司	产品	申购金额	赎回金额	余额金额
2018/11/6	中融国际信托有限公司	中融-隆晟1号结构化集合资金信托计划	5,000		26,000
2018/11/8	华瑞银行	瑞智精选-专属投资服务		5,000	21,000
2018/11/9	交行奉贤支行	结构性存款S款		1,000	20,000
2018/11/12	浦发银行奉贤支行	月添利	6,000		26,000
2018/12/10	交行奉贤支行	结构性存款S款		6,000	20,000
2018/12/10	交行奉贤支行	结构性存款S款		2,000	18,000
2018/12/10	交行奉贤支行	结构性存款S款		2,000	16,000
2018/12/12	浦发银行奉贤支行	月添利		6,000	10,000
2018/12/12	中信证券股份有限公司	中信证券估值优选7号集合资产管理计划	10,000		20,000
2018/12/13	浦发银行奉贤支行	利多多悦盈利90天计划	6,000		26,000

特此公告。

上海菲林格尔木业股份有限公司董事会

2018年12月17日