

# 广发证券股份有限公司

## 关于全资子公司广发控股（香港）有限公司重要事项的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

广发控股（香港）有限公司（以下简称“广发控股香港”）为公司全资子公司。广发控股香港的下属全资子公司广发投资（香港）有限公司（以下简称“广发投资香港”）在开曼注册成立了一只以衍生品对冲策略为主的多元策略基金 GTEC Pandion Multi-Strategy Fund SP（以下简称“Pandion 基金”、“基金”）。2018 年度，由于外汇剧烈波动和相关市场流动性缺乏等原因，该基金遭受了重大投资损失。主要情况如下：

### 一、基金的基本情况

Pandion 基金设立于 2016 年，基金的目标投资资产包括但不限于权益、信用、固定收益、波动率、外汇、商品、现金、柜台产品、衍生品和基金等；基金通过套用多元策略投资于多元资产来达到投资回报目标。

Pandion 基金是由广发投资香港通过在开曼设立的全资子公司 GF GTEC 投资管理有限公司（以下简称“GF GTEC 管理公司”）旗下设立的 GF GTEC Funds SPC 发起并担任基金管理人，GF GTEC 管理公司为 GF GTEC Funds SPC 提供投资管理服务，并通过与广发资管香港签署投资顾问协议让广发资管香港为 GF GTEC Funds SPC 提供投资顾问服务。Pandion 基金架构为国际市场惯用的开曼伞型结构。

Pandion 基金在成立之初主要投资场内股票衍生品，逐步扩展到投资利率产品、外汇衍生品、以及外汇波动率方差互换。从成立至 2018 年 8 月前，Pandion 基金的业绩表现较为平稳。自 2018 年 8 月起，受外汇剧烈波动和相关市场流动

性缺乏等因素影响，基金遭受了重大损失。

## 二、基金投资亏损情况及对公司的影响

Pandion 基金成立以来，广发投资香港对其共有三次自有资金投资行为，从初始的 5,000 万美元陆续增资，截至 2018 年 12 月 31 日，广发投资香港以自有资金累计投入 9,006.77 万美元，占该基金权益 99.90%。

由于 Pandion 基金纳入公司合并财务报表范围，该基金于 2018 年 12 月 31 日的净值-0.44 亿美元及 2018 年度亏损 1.39 亿美元在公司经审计的合并财务报表中反映，减少公司 2018 年合并净利润为人民币 9.19 亿元，已超过公司 2017 年度经审计净利润的 10%。

同时，Pandion 基金收到主经纪商追加保证金的通知，2018 年 12 月 31 日该金额为 1.29 亿美元（含初始保证金 0.30 亿美元）。根据开曼律师事务所 Campbells 的法律意见，该基金的投资人以其在该基金的投资金额为限承担有限责任；广发控股香港有关子公司后续存在潜在诉讼或潜在被诉讼的可能性，相关诉讼结果具有不确定性。

目前，公司正全面核查评估相关情况及其影响，并积极督促广发控股香港及其有关子公司采取各项措施，稳妥化解风险，切实维护公司利益。

特此公告。

广发证券股份有限公司董事会  
二〇一九年三月二十七日