

香港交易及結算所有限公司及香港聯合交易所有限公司對本公告的內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示，概不對因本公告全部或任何部份內容而產生或因倚賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。



GF SECURITIES CO., LTD.

廣發證券股份有限公司

(於中華人民共和國註冊成立的股份有限公司)

(股份代號：1776)

關於全資子公司廣發控股(香港)有限公司重要事項的公告

本公告乃根據香港法例第571章證券及期貨條例第XIVA部項下內幕消息條文(定義見香港聯合交易所有限公司證券上市規則)(「上市規則」)及上市規則第13.09條而作出。

廣發控股(香港)有限公司(「廣發控股香港」)為廣發證券股份有限公司(「本公司」)全資子公司。廣發控股香港的下屬全資子公司廣發投資(香港)有限公司(「廣發投資香港」)在開曼註冊成立了一隻以衍生品對沖策略為主的多元策略基金GTEC Pandion Multi-Strategy Fund SP(「Pandion基金」、「基金」)。2018年度，由於外匯劇烈波動和相關市場流動性缺乏等原因，該基金遭受了重大投資損失。主要情況如下：

一、基金的基本情況

Pandion基金設立於2016年，基金的目標投資資產包括但不限於權益、信用、固定收益、波動率、外匯、商品、現金、櫃檯產品、衍生品和基金等；基金通過套用多元策略投資於多元資產來達到投資回報目標。

Pandion基金是由廣發投資香港通過在開曼設立的全資子公司GF GTEC投資管理有限公司(「GF GTEC管理公司」)旗下設立的GF GTEC Funds SPC發起並擔任基金管

理人，GF GTEC管理公司為GF GTEC Funds SPC提供投資管理服務，並通過與廣發投資香港簽署投資顧問協議讓廣發投資香港為GF GTEC Funds SPC提供投資顧問服務。Pandion基金架構為國際市場慣用的開曼傘型結構。

Pandion基金在成立之初主要投資場內股票衍生品，逐步擴展到投資利率產品、外匯衍生品、以及外匯波動率方差互換。從成立至2018年8月前，Pandion基金的業績表現較為平穩。自2018年8月起，受外匯劇烈波動和相關市場流動性缺乏等因素影響，基金遭受了重大損失。

二、基金投資虧損情況及對公司的影響

Pandion基金成立以來，廣發投資香港對其共有三次自有資金投資行為，從初始的5,000萬美元陸續增資，截至2018年12月31日，廣發投資香港以自有資金累計投入9,006.77萬美元，佔該基金權益99.90%。

由於Pandion基金納入公司合併財務報表範圍，該基金於2018年12月31日的淨值-0.44億美元及2018年度虧損1.39億美元在公司經審計的合併財務報表中反映，減少公司2018年合併淨利潤為人民幣9.19億元，已超過公司2017年度經審計淨利潤的10%。

同時，Pandion基金收到主經紀商追加保證金的通知，2018年12月31日該金額為1.29億美元(含初始保證金0.30億美元)。根據開曼律師事務所Campbells的法律意見，該基金的投資人以其在該基金的投資金額為限承擔有限責任；廣發控股香港有關子公司後續存在潛在訴訟或潛在被訴訟的可能性，相關訴訟結果具有不確定性。

目前，公司正全面核查評估相關情況及其影響，並積極督促廣發控股香港及其有關子公司採取各項措施，穩妥化解風險，切實維護公司利益。

承董事會命
廣發證券股份有限公司
孫樹明
董事長

中國，廣州

2019年3月27日

於本公告日期，本公司董事會成員包括執行董事孫樹明先生、林治海先生、秦力先生及孫曉燕女士；非執行董事尚書志先生、李秀林先生及劉雪濤女士；獨立非執行董事楊雄先生、湯欣先生、陳家樂先生及范立夫先生。