

证券代码：000776

证券简称：广发证券

## 广发证券股份有限公司

### 2020年7月28日投资者关系活动记录表

编号：2020072802

投资者关系活动类别	<input checked="" type="checkbox"/> 特定对象调研 <input type="checkbox"/> 分析师会议 <input type="checkbox"/> 媒体采访 <input type="checkbox"/> 业绩说明会 <input type="checkbox"/> 新闻发布会 <input type="checkbox"/> 路演活动 <input type="checkbox"/> 现场参观 <input type="checkbox"/> 其他
参与单位名称及人员姓名	东方证券证券行业研究员 孙嘉庚
时间	2020年7月28日下午13:30-14:50
地点	公司40楼4003会议室
上市公司接待人员姓名	董事会办公室执行董事 张明星先生 董事会办公室 王强女士
投资者关系活动主要内容介绍	<p><b>1、请问近期行政监管措施对公司，尤其是投资银行业务将产生什么影响？</b></p> <p>答：公司于2020年7月20日收到中国证券监督管理委员会广东监管局《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正、限制业务活动、责令限制高级管理人员权利监管措施的决定》，详情请查阅公司于2020年7月20日晚间披露的《关于公司及相关人员收到中国证券监督管理委员会广东监管局〈行政监管措施决定书〉的公告》（公告编号：2020-053）。本次行政监管措施对公司业务的直接影响为：在2020年7月20日至2021年1月19日期间，暂停公司保荐机构资格；在2020年7月20日至2021年7月19日期间，公司债券承销业务有关文件暂不被受理。</p> <p>2019年母公司证券承销业务收入11.40亿元，约占公</p>

司 2019 年总收入的 5.00%；证券保荐业务收入 0.97 亿元，约占公司 2019 年总收入的 0.43%。该行政监管措施预计将在一段时期内影响公司投资银行业务收入。

公司将深刻汲取教训、认真反思、严格落实整改要求，并按照内部问责制度对责任人员进行内部问责。公司将建立健全和严格执行投行业务内控制度、工作流程和操作规范，切实提升投资银行业务质量。公司将全面强化责任、能力和职业操守建设，全面提升合规管理和风险管控水平。公司将严格遵循稳健经营理念，进一步强化“合规、诚信、专业、稳健”的文化建设，严守诚实守信、勤勉尽责的底线要求。

## **2、公司权益、衍生品以及固定收益投资自营业务的开展情况如何？**

答：公司权益投资业务坚持价值投资思路。2020 年，公司将重点关注价值龙头、核心资产板块，坚持选择穿越周期的个股。

公司衍生品投资业务是基于量化研究与金融科技技术，寻找并把握住市场各类资产定价偏差的机会，利用高效系统和策略实现低风险的超额收益；以及通过对冲风险及提供做市服务取得资本中介类收入。做市服务方面，公司已获得期权做市资格并稳步发展。

公司固定收益投资业务主要从事固定收益金融产品及利率衍生品的做市及交易。2020 年一季度，公司较好的控制了债券投资组合的久期、杠杆和投资规模，抓住了阶段性的市场机会。另外，为了防范信用风险，公司建立了严格的内部评级体系，同时通过杠杆比率、久期控制等管理市场风险。

### 3、关于广发香港 Pandion 基金情况如何？

答：广发控股香港旗下的投资基金 GTEC Pandion Multi-Strategy Fund SP（以下简称“该基金”），于开曼群岛注册设立，并由广发控股香港旗下两家全资子公司（简称“集团有关子公司”）分别担任该基金管理人及投资顾问；该基金是一只以衍生品对冲策略为主的多元策略基金。截至 2018 年 12 月 31 日，广发投资（香港）有限公司持有该基金 99.90% 权益。

2019 年上半年，该基金的主经纪商根据 ISDA 协议终止了与该基金的协议，并据此提出了终止结算金额。2019 年 6 月，开曼法院委任了该基金的接管人，自此，本集团已失去对该基金的控制权并不再将其纳入集团的合并范围。上述事宜的现金对价为零，该基金在终止合并前实现的投资损益及相关的终止合并收益，在财务报表的“投资收益”反映，金额为收益 44.33 百万美元（约人民币 305.59 百万元）。

由于上述事宜，集团有关子公司后续存在潜在法律纠纷的可能性。截至 2019 年 12 月 31 日，集团计提了 58.27 百万美元（约人民币 401.76 百万元）的预计负债。

### 4、公司目前财富管理业务的转型情况如何？

答：公司坚持以客户为中心，以客户资产保值增值为目的，以产品配置为手段，推动财富管理业务稳步发展。

公司主要从投顾队伍、产品、服务、平台以及体制机制等多方面推进财富管理业务建设。投顾队伍方面，截至 2020 年一季度末，公司的投资顾问人数在全行业排名第一（母公司口径）。目前，公司从讲师、课程、到培训组织已经形成完整体系，为财富管理业务提供了丰富的人才储备；产品方面，公司不断推进以客户为中心的财富管理业务模式，不断为客户丰富各类产品品种，提高产品质量，将合适的产品配

	<p>置给合适的客户；服务方面，公司进行了细致的客户分层分类，针对不同的客户有着不同的服务方式与产品配置体系；平台方面，公司已构建了面向客户、面向员工以及后台管理的前、中、后全流程平台体系，满足了一站式财富管理业务需求；体制机制方面，公司已成立了私人银行部与金融产品中心，致力于产品的全流程管理与高净值客户服务，打造一流的财富管理机构。</p> <p style="text-align: center;"><b>5、基金投资顾问业务将对券商产生怎样的影响？</b></p> <p>答：2019年，证监会下发《关于做好公开募集证券投资基金投资顾问业务试点工作的通知》，行业期待已久的公募基金投资顾问业务试点正式落地。</p> <p>基金投资顾问业务可以通过资产配置技术手段，从客户利益和需求出发，为客户量身定制财富管理解决方案，并提供长期投资陪伴服务，帮助客户实现财富保值和增值，从而让广大投资者真正分享到资本市场发展红利。</p> <p>基金投顾试点推出后，获得试点资格的投资咨询机构将不再局限于提供建议，而可以进行基金账户的全权委托，收费模式也更加多元化；券商将直接着眼投资者需求，提升专业服务，不断推进完善财富管理的转型。</p> <p>接待过程中，公司接待人员与投资者进行了充分的交流与沟通，严格按照《信息披露管理制度》等规定，保证信息披露的真实、准确、完整、及时、公平。没有出现未公开重大信息泄露等情况，同时已按深交所要求签署调研《承诺书》。</p>
附件清单（如有）	无
日期	2020年7月28日