

证券代码：A 股 600611

股票简称：大众交通

编号：临 2019-001

B 股 900903

大众 B 股

债券代码：155070

债券简称：18 大众 01

## 大众交通（集团）股份有限公司 关于购买私募基金产品的公告

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。

释义：

除非另有说明，以下简称在本公告中含义如下：

本公司、公司：大众交通（集团）股份有限公司

秋晟资产言蹊1号私募基金：秋晟资产言蹊1号宏观对冲私募基金

秋晟资产：上海秋晟资产管理有限公司

中信证券：中信证券股份有限公司

重要内容提示：

- 投资标的名称：秋晟资产言蹊1号宏观对冲私募基金
- 投资金额：人民币3,000万元
- 特别风险提示：本次投资存在市场风险以及政策风险。

### 一、投资概述

1、2019年1月，大众交通（集团）股份有限公司与上海秋晟资产管理有限公司、中信证券股份有限公司签署了《秋晟资产言蹊1号宏观对冲私募基金合同》，公司同意投资人民币3,000万元认购由秋晟资产作为基金管理人、中信证券作为基金托管人的秋晟资产言蹊1号私募基金。本次购买资金为公司自有资金。本次认购有助于进一步拓宽公司投资渠道，借助机构投资的专业优势提升公司的投资能力。

- 2、根据《公司章程》，本次对外投资事项无需提交公司董事会进行审议。
- 3、本次对外投资及相关协议的签署不构成关联交易和重大资产重组事项。

## 二、基金合同主体的基本情况

### 1、基金管理人基本情况

企业名称：上海秋晟资产管理有限公司

登记注册类型：有限责任公司(自然人投资或控股)

注册资本：2000.00万人民币

注册地址：上海市静安区南京西路1717号37楼单元2

办公地址：上海市静安区南京西路1717号37楼单元2

成立日期：2017年2月21日

法定代表人：庄卓嘉

私募基金管理人登记编号：P1066338

私募基金管理人登记时间：2017年12月19日

经营范围：资产管理，投资管理。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

基金管理人2018年度财务情况（未经审计）：

单位：人民币 元

|      |               |
|------|---------------|
| 资产总额 | 32,281,130.39 |
| 净资产  | 22,310,453.35 |
| 营业收入 | 22,181,957.09 |
| 净利润  | 4,895,199.70  |

### 2、基金托管人基本情况

企业名称：中信证券股份有限公司

登记注册类型：股份有限公司(上市)

注册资本：1211690.84万人民币

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

成立日期：1995年10月25日

法定代表人：张佑君

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。

基金托管人2018年第三季度（1-9月）财务情况（未经审计）：

单位：人民币 元

|      |                    |
|------|--------------------|
| 资产总额 | 614,146,021,596.44 |
| 净资产  | 156,362,927,629.35 |
| 营业收入 | 27,209,287,878.05  |
| 净利润  | 7,682,651,761.22   |

### 三、关联关系或其他利益关系说明

秋晟资产、中信证券与公司主要股东、董事、监事、高级管理人员均不存在关联关系或利益安排，亦不存在一致行动关系。不存在直接或间接持有公司股份的情况，亦无增持本公司股份计划。与本公司不存在产权、业务、资产、债券债务、人员等方面的关系。与本公司不存在相关利益安排，且与第三方不存在其他影响本公司利益的安排。

### 四、投资标的基本情况

(一) 私募基金的名称

秋晟资产言蹊1号私募基金

(二) 基金架构

平层基金

(三) 基金类型

私募证券投资基金

(四) 私募基金的类别

契约型非公开募集投资基金。

(五) 基金计划募集总额

基金计划募集总额为50,000万元，管理人有权根据实际募集情况予以调整。

(六) 运作方式

开放式。

(七) 基金的封闭期

无。

(八) 存续期限

自基金成立之日起10年。

(九) 基金份额的初始募集面值

人民币1.00元。

(十) 份额分类

基金根据委托人认购/申购金额总额的不同分为A类、B类、C类基金份额。具体分类标准如下：

C类份额：单次认/申购金额 $<1,000$ 万元；

B类份额： $1,000$ 万元 $\leq$ 单次认/申购金额 $<25,000$ 万元；

A类份额： $25,000$ 万元 $\leq$ 单次认/申购金额。

(十一) 最低认缴金额

首次认购基金的金额不低于100万元（不含认购费用，且“特殊合格投资者”可不受此限制）。

(十二) 私募基金管理人名称

上海秋晟资产管理有限公司

(十三) 基金的托管

中信证券股份有限公司。

(十四) 基金的外包事项

本基金的行政服务机构为中信中证投资服务有限责任公司（外包业务登记编码：A00045）。

## 五、基金合同的主要内容

(一) 合同主体：本公司、秋晟资产、中信证券

(二) 投资目标

在深入研究的基础上构建投资组合，力争实现基金资产的持续稳健增值。

### (三) 投资策略

在期货上，通过时间、空间、波动率三个维度，分别对应于策略期限、策略盈利空间、期间波动率三方面的问题。

在股票上，通过分析公司所处行业政策导向、行业集中度、行业竞争门槛、公司技术水平在行业中所处的位置、公司财务情况、公司产品市占率、公司研发支出等多方面的因素，寻找具有产品价格话语权、成本竞争优势或者具有较大发展潜力的股票标的。

### (四) 投资范围

投资范围：国内依法发行上市的股票及其他经中国证监会核准上市的股票、新股申购（包括网上和网下申购）、沪港通、深港通、中国存托凭证（CDR）、股票型公募基金、混合型公募基金、QDII、QDLP、QDIE参与融资融券、将持有的证券作为融券标的证券出借给证券金融公司、债券、债券回购（包括债券正回购和债券逆回购）、债券型公募基金、现金、银行存款（包括定期存款、协议存款、其他银行存款）、同业存单、大额可转让定期存单、货币市场基金、上海黄金交易所上市交易的现货延期交收合约品种，交易所上市交易的权证、金融期货、商品期货、股票期权、商品期权，以具有相应业务资格的机构做交易对手的收益互换、跨境收益互换、场外期权，利率互换，基金公司及其子公司资管计划、期货公司及其子公司资管计划、证券公司及其子公司资管计划、保险公司及其子公司资产管理计划、信托计划、私募投资基金、银行理财、证券公司发行的收益凭证，法律法规或中国证监会允许基金投资的其他投资品种。

### (五) 私募基金认购费用及认购份额

本基金无认购费。

本基金认购份额的计算方法如下：

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=净认购金额/基金认购价格

### (六) 预警/止损

基金预警线为0.8000元，平仓线为0.75000元。

## (七) 风险收益特征

不承诺保本及最低收益,属于R4风险等级的投资品种,适合风险识别、评估、承受能力为C5, C4的合格投资者。

## (八) 私募基金的费用

### 1. 基金管理人的管理费:

年管理费率为2%。

计算公式为:

$H=E*R/N$  (H: 每日应计提的管理费; E: 前一日的基金资产净值; R: 年管理费率; N: 当年的实际天数。)

### 2. 基金托管人的托管费

年托管费率为0.01%。

计算公式为:

$H=MAX\{(E*R), 5万\}/N$  (H: 每日应计提的托管费; E: 前一日的基金资产净值; R: 年托管费率; N: 当年的实际天数。)

### 3. 行政服务费

年行政服务费率为0.01%。

计算公式为:

$H=MAX\{(E*R), 5万\}/N$  (H: 每日应计提的行政服务费; E: 前一日的基金资产净值; R: 年行政服务费率; N: 当年的实际天数。)

### 4. 基金管理人收取的业绩报酬

在基金分红确认日(若有)、赎回确认日和基金终止确认日,管理人将根据不同类别委托人的期间实际收益率(R),对A类基金份额期间实际收益率超过0%以上部分按18%的比例收取业绩报酬;对B类基金份额期间实际收益率超过0%以上部分按照20%的比例收取业绩报酬;对C类基金份额期间实际收益率超过0%以上且在20%以下(含)的部分按照20%的比例收取业绩报酬,对期间实际收益率在20%以上的部分按照25%的比例收取业绩报酬。

## (九) 收益分配

### 1. 基金利润的构成

基金利润指利息收入、投资收益、公允价值变动损益和其他收入扣除相关费用后的余额;基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动损益后的余额。

## 2. 基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）资产负债表中基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

## 3. 收益分配原则

- （1）存在可供分配利润的前提下，基金管理人有权决定是否对基金进行收益分配，收益分配的比例亦由基金管理人决定；
- （2）收益分配分为采取现金分红或红利再投资等两种方式。红利再投资是将现金红利按照基金分红除息日的基金份额净值自动转为基金份额；本基金默认采用现金分红。

### （十） 合同的生效条件

本合同自当事人各方法定代表人/执行事务合伙人委派代表或授权代表签字（或盖章）并加盖公章或合同专用章之日起生效。

### （十一） 违约责任

合同各方当事人在实现各自权利、履行各自义务的过程中，违反法律法规规定或者本合同约定的，应当各自承担相应的责任；给基金财产或者基金合同其他当事人造成损失的，应当分别对各自的行为所造成的损失已发承担赔偿责任。

### （十二） 争议的处理

任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会进行仲裁，仲裁的地点在上海市。

## 六、对外投资对上市公司的影响

- 1、本次投资有利于借助机构投资的专业优势，进一步拓宽公司投资渠道；
- 2、本次投资有利于提高资金使用效率，提升投资收益；
- 3、公司在保证日常经营发展所需资金的前提下，以自筹资金参与购买私募基金产品，本次投资不会对公司运营和财务状况产生重大影响。

## 七、基金的风险分析

基金可能面临的风险包括但不限于如下：基金合同与中国基金业协会合同指引不一致、基金委托募集、基金业务外包、未在中国基金业协会登记备案、基金托管人监督范围未能覆盖基金全部投资管理行为、电子签名方式签署合同以及其

他等特殊风险；资金损失风险；基金运营风险；流动性风险；基金募集或备案失败的风险；市场风险；投资标的风险；信用风险；税收风险；其他风险。

鉴于客观存在的风险，公司将及时了解基金的运作情况，督促防范各方面的投资风险，尽力维护公司投资资金的安全。

本公司将严格按照上海证券交易所《上市公司与私募基金合作投资事项信息披露业务指引》及相关法规要求，按分阶段披露原则及时披露相关事项的重大进展，敬请广大投资者理性投资，注意风险。

## 八、其他事项

1、公司主要股东、董事、监事、高级管理人员未参与基金产品认购，也未参与基金的日常管理。

特此公告。

大众交通（集团）股份有限公司

2019年1月23日