

证券代码：A股 600695
B股 900919

证券简称：A股 绿庭投资
B股 绿庭B股

编号：临2015-023

上海绿庭投资控股集团股份有限公司

关于全资子公司投资设立投资基金（契约型）的公告

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

重要内容提示：

- 投资标的名称：绿庭私募工场证券投资基金（契约型）
- 投资金额：人民币 2,250 万元人民币

一、对外投资基本情况

公司全资子公司上海大江资产经营有限公司作为 A 级投资人以现金出资人民币 2,250 万元认购绿庭私募工场证券投资基金（以下简称“基金”），自然人李行军先生作为 B 级投资人以现金出资人民币 250 万元认购基金。

上海大江资产经营有限公司成立于 2006 年 12 月，注册资本为人民币 1,000 万元，主营投资与资产管理等。李行军原为我公司财务总监，2015 年 6 月 19 日公司换届后不再担任公司高管人员。为积极推进新投资业务的开展，李行军先生以自有资金认购基金，并参与基金的管理工作。李行军先生作为公司前高管，根据上市公司相关规则的规定，属于公司关联人，存在关联关系。

二、对外投资的审批情况

2015 年 6 月 19 日，公司第八届董事会第一次全体会议审议通过了对基金的出资认购事宜。

三、投资标的基本情况

（一）基金的名称：绿庭私募工场证券投资基金

（二）基金的运作方式：契约型封闭式，本基金存续期间，不开放申购和赎回，但可以接受次级份额持有人的追加资金，及退还追加资金。

（三）基金的投资目标：本基金通过在证券市场的组合投资，为投资者获取丰厚的投资收益。

（四）基金的存续期限：自基金成立之日起至 2015 年 12 月 22 日结束。

（五）基金成立的最低规模要求：人民币 2500 万元。

（六）基金份额的面值：人民币 1.00 元。

（七）基金的分级安排：

本基金通过对基金财产利益分配的约定，将基金份额分成风险与收益特征不同的两个级别，即优先级（A 级）和次级（B 级），A 级和 B 级基金份额的基金资产合并运作。

（八）基金的预警、止损：

1、为保护基金份额持有人的利益，本基金将基金份额净值为 0.9000 元设置为提示线，将基金份额净值为 0.8500 元设置为警戒线，将基金份额净值为 0.8000 元设置为平仓线。

2、当基金份额净值低于或等于提示线 0.9000 元时，基金管理人应向投资经理发出风险提示；

3、当基金份额净值低于或等于警戒线 0.8500 元时，基金管理人应及时通知 B 级份额持有人及 A 级份额持有人，B 级份额持有人应追加资金（但 B 级份额持有人持有的份额不变）使基金份额净值高于 0.8500 元，否则，A 级份额持有人代表有权要求基金管理人更换投资经理，并有权决定是否提前清算；

若 A 级份额持有人代表要求提前清算时，基金管理人将进行强制平仓，在收到 A 级份额持有人代表要求提前清算五个工作日内将持仓标的平仓变现，如遇持仓股票停牌等特殊情况则变现时间顺延，然后根据合同清算程序对基金进行清算。

4、当基金份额净值低于或等于平仓线 0.8000 元时，基金管理人将进行强制平仓，在五个工作日内将持仓标的平仓变现，如遇持仓股票停牌等特殊情况则变现时间顺延。此种情形下，除非 B 级份额持有人追加资金（但 B 级份额持有人持有的份额不变）使基金份额净值高于 0.8500 元，且经全体基金份额持有人达成一致，决定基金继续运营或清算，基金应提前清算，并依合同清算程序对基金进行清算。

基金的强制平仓由基金管理人负责执行，如基金管理人未按照基金合同的约定进行强制平仓，由此对基金财产或基金份额持有人造成的损失，由基金管理人承担全部责任，基金托管人不承担任何责任。

（九）投资范围：本基金仅投资于上证 50、上证 180、上证 380、沪深 300、中证 500、深成 500 基金成份股票，以及上证 50ETF、沪深 300ETF 基金，闲余资金可投资于国债回购、货币市场基金，以获取稳定回报。

（十）基金管理人：上海亘通投资管理有限公司（公司全资子公司）

（十一）基金托管人：招商证券股份有限公司

四、该项投资对上市公司的影响

绿庭私募工场证券投资基金是公司设立的首只投资基金，公司以自有资金并作为 A 级投资人投资该基金，既有效地降低投资风险，又可提高闲置资金利用效率，有效提高公司整体收益，有利于公司的转型发展。

五、备查文件

公司第八届董事会第一次全体会议决议。

特此公告。

上海绿庭投资控股集团股份有限公司

2015 年 6 月 24 日