

南方、泰达两基金自曝上电转债门损失 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/488/2021_2022__E5_8D_97_E6_96_B9_E3_80_81_E6_c33_488525.htm 上电转债门两基金自曝损失 南方、泰达共动用千余万风险准备金补偿 曾经陷入上电转债门事件的两只基金近期在年报中披露了上电转债门的损失额度。泰达荷银基金管理公司旗下的泰达荷银效率优选混合基金在近期年报中披露，在上电转债门事件后，该基金动用了7196227.12元的风险准备金进行了补偿，而其旗下另一只基金泰达荷银效率披露其动用风险准备金对上电转债进行补偿的数额为314798.35元；另一家上电转债门损失的基金为南方基金管理公司旗下的南方高增长，其在年报中披露，公司动用了5710543.02元风险准备金对损失进行弥补。2007年8月14日，上电转债停止交易和转股，未转股的转债将全部被冻结，当天，上电转债最终以226.58元收盘，而其赎回价格为103.2元。如果没有将上电转债及时卖出或转股，造成该转债被强制按照103.2元的价格赎回，则单张上电转债造成的损失约为123.38元。而上电转债即使不转股，与2006年12月100元/张的申购价相比，申购者也能获得120%以上的无风险收益，但监管部门披露有3家基金公司旗下的5只基金没有在最后交易日卖出，致使基金资产受损合计为2200万元，这5只基金先后浮出水面，分别是华安基金管理有限公司旗下的华安宝利配置；南方基金管理有限公司旗下的南方高增长和南方避险增值两只基金，泰达荷银基金管理有限公司旗下的泰达荷银效率优选和泰达荷银风险预算。此前，华安宝利配置基金经理袁蓓在去年三季度报中承认，2007年8月15日，华安宝利基

金持有的上电转债共25370张，因8月14日收市之前没有及时转股而被发债人赎回。以8月14日基金持有该债券的市值（包括应收利息）5748315.14元和税后赎回总值2607021.20元计算，其中价差为3141293.94元。公司于8月15日当日动用风险准备金弥补了此交易的价差。而南方基金管理公司则在去年三季报中只披露了两只基金持有的上电转债份数，均为46210张，但并未说明造成的损失金额是多少。从此次南方高增长披露的金额来看，南方避险增值也应该动用了5710543.02元风险准备金对损失进行弥补，整个合计南方基金管理公司在本次转债门事件中共动用了超过1100万元的风险准备金。泰达荷银效率在年报中披露，在事件发生当天，基金管理人立即进行了相关处理，以风险准备金弥补了由于操作不当给持有人造成的全部损失，除对相关责任人进行处罚外，还加强前后台的双向复核功能，加强人员的培训，改进IT系统控制方法。根据年报披露，泰达荷银效率还持有的可转换债券包括澄星转债、锡业转债、巨轮转债，泰达荷银预算除了这3个可转债外，还持有金鹰转债；而南方高增长基金在报告期内再没有持有任何可转债。100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问 www.100test.com