

中国证券投资基金业协会

中基协处分〔2023〕38号

纪律处分决定书

当事人：深圳市上元资本管理有限公司（以下简称深圳上元）

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《私募投资基金监督管理暂行办法》（以下简称《私募基金监管办法》）、《中国证券投资基金业协会章程》（以下简称《协会章程》）、《中国证券投资基金业协会会员管理办法》（以下简称《会员管理办法》）以及《中国证券投资基金业协会纪律处分实施办法（试行）》（以下简称《纪律处分实施办法（试行）》）等法律法规和自律规则的有关规定，协会向深圳上元送达了《纪律处分事先告知书》（中基协字〔2022〕568号），深圳上元如对有关拟采取的纪律处分措施存在异议，应当在5个工作日内向协会提交书面申辩意见。深圳上元未在规定期限内提出异议，本案现已审理终结。

一、基本事实

经查，深圳上元存在未履行谨慎勤勉义务的违规事实，具体如下：

深圳上元管理的部分私募基金的基金合同均约定了基金份额净值达到预警线及止损线应进行平仓等相应操作，深圳上元在管理相关基金过程中均存在违反前述合同约定的

情形，包括连续多个交易日未按基金合同约定进行平仓，以及在基金份额净值未回升到约定水平情况下开仓买入。以上行为违反了《私募基金监管办法》第四条，以及《私募投资基金管理人员内部控制指引》第七条关于管理人应当恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉义务的规定。

以上事实有基金合同、仲裁裁决书、公司情况说明、产品净值表、交易记录、协会资产管理业务综合报送平台信息等证据予以确认，事实清楚，证据充分，足以认定。

二、纪律处分决定

鉴于以上基本事实、情节和审理情况，根据《基金法》第一百一十一条第三项，《私募基金监管办法》第二十九条，《协会章程》第六条第三项，《会员管理办法》第二十九条，《纪律处分实施办法（试行）》第五条的规定，协会决定作出以下纪律处分：

对深圳上元进行公开谴责，并暂停受理其私募基金产品备案三个月。

根据《纪律处分实施办法（试行）》第二十四条的规定，如对以上纪律处分决定有异议，当事人可以在收到本决定书之日起 20 个工作日内向协会提出书面复核申请，说明申请复核的事实、理由和要求。复核期间，本纪律处分决定继续执行。

中国证券投资基金业协会

2023 年 3 月 6 日

抄送：证监会市场二部，深圳证监局。