

中国证券投资基金业协会

中基协处分（2023）76 号

纪律处分决定书

当事人：上海天戈投资管理有限公司（以下简称上海天戈）

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自律管理和纪律处分措施实施办法》（以下简称《实施办法》）等法律法规和自律规则的有关规定，协会向上海天戈送达了《纪律处分事先告知书》（中基协字（2023）82 号），上海天戈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。上海天戈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，上海天戈存在内控制度不完善的违规行为，具体如下：

上海天戈管理的天戈恒锐 7 号私募证券投资基金、天戈恒锐 10 号私募证券投资基金、天戈恒锐 13 号私募证券投资基金、天戈恒锐 15 号私募证券投资基金、天戈恒锐 17 号私

募证券投资基金等5个基金产品账户，在2021年9月至11月期间存在自成交影响合约价格的违规行为。大连商品交易所根据《大连商品交易所违规处理办法》（大商所发〔2021〕73号）相关规定，给予上海天戈警告的纪律处分，对天戈恒锐7号私募证券投资基金、天戈恒锐10号私募证券投资基金、天戈恒锐13号私募证券投资基金、天戈恒锐15号私募证券投资基金、天戈恒锐17号私募证券投资基金采取暂停开仓交易1个月的纪律处分，并将上述处分记入证券期货市场诚信档案。上海天戈存在违反大连商品交易所相关规定的情形，反映出公司存在内部控制制度不完善的问题，应当按照《私募投资基金管理人内部控制指引》第三十一条，对其违反相关法律法规及自律规则的行为采取措施。

以上事实有大连商品交易所纪律处分决定书、上海天戈提供的有关材料等证据予以确认，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，《实施办法》第八条的规定，协会决定作出以下纪律处分：

对上海天戈进行警告。

根据《实施办法》第三十九条的规定，如对以上纪律处分决定有异议，当事人可以在本决定书送达之日起15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。

(本页无正文)



抄送：证监会市场二部，上海证监局。
