

中国证券投资基金业协会

中基协字〔2022〕499号

纪律处分事先告知书

当事人：广州基岩资产管理有限公司（以下简称广州基岩）
赫旭，男，1985年9月出生，登记为广州基岩法定代表人、总经理。

根据中国证券监督管理委员会广东监管局（以下简称广东证监局）行政处罚决定书及协会检查情况，广州基岩存在以下违规行为：

一是违规向投资者承诺收益。广州基岩管理的12只私募基金产品在基金合同补充协议中向投资者承诺收益。以上行为违反了《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》）第十五条，《私募投资基金募集行为管理办法》（以下简称《私募基金募集办法》）第二十四条第三项的规定。

二是挪用基金财产。2017年3月至2019年12月，广州基岩未按基金合同约定的投资范围，将其管理的“价值回归投资基金”“价值回归投资基金二号”“文化教育并购私募投资基金”“东方价值系列私募投资基金”等4只基金产品的财产份额，通过委托他人代持并将投资收益款划转至公司员工及其他公司账户、向关联方提供借款、转款至约定投资标的以外的机构等方式，挪用基金财产共计人民币

564,188,900.00 元和港币 27,006,733.02 元。以上行为违反了《私募基金监管办法》第二十三条第四项的规定。

三是信息披露存在虚假记载。2018 年 5 月至 2020 年 1 月，广州基岩作为其管理的“基岩东方价值五号”等 35 只基金产品的资产委托人，与证券公司、公募基金管理公司签订 QDII 资产管理计划、收益互换协议，将基金财产投向在美国上市的中概股股票。在基金净值披露环节，广州基岩通过篡改相关标的估值数据，经基金托管人复核后在净值公告、定期报告上披露，或者未经托管人复核直接在“私募排排网”上披露的方式，向投资者披露了虚假的产品净值信息。以逐只产品最后一次虚假净值与真实净值比较测算，广州基岩共虚增基金财产 1,827,410,202.68 元，净值虚增比例均值为 111.09%，净值虚增比例最高值为 324.65%。以上行为违反了《私募基金监管办法》第二十四条及《私募投资基金信息披露管理办法》（以下简称《私募基金信披办法》）第十一条第二项的规定。

四是未按照规定向投资者履行定期信息披露义务。根据广州基岩向协会提交的书面回复，广州基岩所管理的 30 只私募基金产品长期未向投资者披露基金净值。以上行为违反了《私募基金监管办法》第二十四条及《私募基金信披办法》第十六条、第十七条的规定。

以上事实有行政主管部门的行政处罚决定书及检查报告、广州基岩提供的对协会核查的书面回复、相关产品补充协议等证据予以确认，事实清楚、证据充分，足以认定。根据广州基岩填报的登记信息，赫旭于 2015 年 8 月至今任广

州基岩的法定代表人及总经理，是行政机关认定的对公司违法违规行为直接负责的主管人员，应当承担相应责任。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》第一百一十一条第三项，《私募基金监管办法》第二十九条，《中国证券投资基金业协会章程》第六条第三项，《中国证券投资基金业协会会员管理办法》第四条，《中国证券投资基金业协会纪律处分实施办法（试行）》第五条、第六条的规定，协会拟作出以下纪律处分：

- 一、取消广州基岩会员资格、撤销广州基岩管理人登记。
- 二、取消赫旭基金从业资格。

根据《纪律处分实施办法（试行）》第十七条的规定，就协会拟作出的“取消会员资格、撤销管理人登记”及“取消基金从业资格”的纪律处分措施，广州基岩、赫旭有要求举行听证的权利。如要求举行听证或提出申辩意见，应在收到本告知书之日起5个工作日内提出，逾期未提出的视为放弃。

如果当事人放弃上述权利，协会将根据以上事实、理由和依据作出正式的纪律处分决定。

中国证券投资基金业协会
2022年10月31日



抄送：证监会市场二部，广东证监局。
