

中国证券投资基金业协会

中基协处分〔2023〕126号

纪律处分决定书

当事人：葛灵验，女，1977年6月出生，登记为上海淘谷资产管理有限公司（以下简称上海淘谷）合规风控负责人。

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，协会向葛灵验送达了《纪律处分事先告知书》（中基协字〔2023〕104号），葛灵验如对有关拟采取的纪律处分措施存在异议，应当于五个工作日内向协会提交书面申辩意见。葛灵验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，上海淘谷存在以下违规事实：

一是出借证券账户。根据公司自认，上海淘谷将其发行的11只“淘谷进取系列”私募基金产品的证券账户及密码交由上海映雪投资管理中心（有限合伙）（私募基金管理人，

以下简称上海映雪）进行具体的投资交易操作。以上行为违反了《私募基金监管办法》第四条关于管理人应当履行谨慎勤勉义务的规定，《私募基金管理人内部控制指引》第十五条、第二十条关于投资业务控制的有关规定。

二是未向投资者披露影响其权益的重大事项。上海淘谷管理的“淘谷进取2号证券投资私募基金”（以下简称“淘谷进取2号”）于2019年8月购入某债券9869万元，该债券于2019年10月发生实质性违约。上海淘谷未就持有违约债券这一影响投资者权益的重大事项向投资者进行风险提示或特别披露，严重损害投资者知情权。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》第十八条关于管理人应向投资者披露影响投资者利益的其他重大事项。

三是未尽到谨慎勤勉义务。“淘谷进取2号”持有的债券于2019年10月发生实质性违约，但上海淘谷于2020年至2022年期间向投资者披露的净值仍为1左右。上海淘谷向投资者披露的产品净值明显偏离其实际净值情况，不能真实客观反应底层债券价值，上海淘谷未能充分履行其对投资者负有的谨慎勤勉义务。以上行为违反了《私募基金监管办法》第四条关于管理人应当履行谨慎勤勉义务的规定，

以上事实有公司情况说明、信息披露文件、投诉材料、协会资产管理业务综合报送平台信息、员工花名册等证据予以确认，事实清楚，证据充分，足以认定。上海淘谷合规风控负责人葛灵验应当对其任职期间内公司的违规行为承担相应责任。

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》第九条的规定，协会决定作出以下纪律处分：

对葛灵验进行公开谴责。

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，当事人可以于收到本决定书之日起十五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。



抄送：证监会市场二部，上海证监局。
