

上海华鑫股份有限公司 关于华鑫期货有限公司收到 中国证券监督管理委员会上海监管局 《行政处罚事先告知书》的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

2017年10月31日，上海华鑫股份有限公司（以下简称“公司”）全资子公司华鑫证券有限责任公司的全资子公司华鑫期货有限公司（以下简称“华鑫期货”）收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》（沪调查通字 2017-2-076号）。因华鑫期货涉嫌违反证券期货法律法规，根据《期货交易管理条例》的有关规定，中国证券监督管理委员会决定对华鑫期货立案调查（详见公司于 2017年11月2日披露的相关公告）。

2019年12月6日，华鑫期货收到中国证券监督管理委员会上海监管局《行政处罚事先告知书》（沪证监处罚字[2019]9号，以下简称“《事先告知书》”），《事先告知书》主要内容如下：

“日前，华鑫期货有限公司（以下简称“华鑫期货”）涉嫌违反期货法律法规案已由我局调查完毕，我局依法拟对你们作出行政处罚。现将我局拟对你们作出行政处罚所根据的违法事实、理由、依据及你们享有的相关权利予以告知。

经查明，华鑫期货涉嫌违法违规的事实如下：

一、华鑫期货实际使用了非本公司购买或开发的交易系统传递客户交易指令，未对该系统上进行交易的客户账户资金和持仓进行验证，不符合期货公司审慎经营和风险管理的要求

2014年7月至2015年7月，华鑫期货原技术总监金文献组织、安排信息技术部员工下载、测试、安装、运行、维护由张家港保税区伊世顿国际贸易有限公司（以下简称“伊世顿公司”）开发的交易系统（以下简称 RM 系统）。华鑫期货员工将由伊世顿公司实际控制的 27 个期货账户（以下简称涉案账户组），从华鑫期货交易系统切换至 RM 系统后，涉案账户组即通过 RM 系统传递交易指令，华鑫期货未对该系统上的交易进行客户账户资金和持仓验证。华鑫期货的违法所得为公司从涉案账户组通过 RM 系统进行的交易中收取的手续费，扣除“投资者保障金”、“风险准备金”、“营业税及附加”、“华鑫期货将协议收取的手续费和交易所

返还给手续费按照一定比例返还给伊世顿的金额”后所得金额。经计算违法所得为 10,089,097 元。（违法所得的计算期间始于 2014 年 10 月 29 日，《期货公司监督管理办法》（证监会第 110 号令）公布实施之日）

二、华鑫期货未建立、健全并严格执行业务管理规则、风险管理制度，风险管理和内部控制存在较大缺陷

2014 年 7 月至 2015 年 7 月，金文献安排信息技术部员工将多套 RM 系统下载、安装至华鑫期货机房服务器内，使用华鑫期货 IP、席位号连接中国金融期货交易所、上海期货交易所和大连商品交易所交易系统，后又将伊世顿公司客户端策略机安装在华鑫期货机房内，以便伊世顿公司通过客户端策略机和 RM 系统进行程序化交易。2015 年 3 月，华鑫期货员工还配合伊世顿公司，抓取中国金融期货交易所允许使用的飞马系统标识信息，对 RM 系统进行技术伪装。涉案期间华鑫期货未严格执行对接入信息系统的审批，对交易系统的使用，缺少有效的管理和监督。

涉案期间，华鑫期货交易席位的申请、登记、使用均由信息技术部负责，关于席位号的管理没有相应的规章制度，以致信息技术部员工可以随意使用华鑫期货席位号连接 RM 系统，且长期未被公司发现。华鑫期货对交易席位的管理缺少相应的制度规定和有效监督。

涉案期间，金文献安排信息技术部员工未经申请审批将涉案账户组从公司交易系统切换到 RM 系统，并由该部员工直接将涉案账户组结算和风控数据导入 RM 系统。华鑫期货对客户使用交易系统的切换以及结算、风控数据导入缺乏有效的管理和监督。

三、与本案有关的其他事实

根据上海市第一中级人民法院《刑事判决书》（2016 沪 01 刑初 78 号），金文献因配合伊世顿公司因擅自使用 RM 交易系统，绕过华鑫期货公司资金和持仓验证构成伊世顿公司操纵市场共犯，判处有期徒刑二年，并处罚金人民币六十万元。

上述事实，有相关法院刑事判决书、裁定书、相关人员询问笔录、电脑提取记录以及提供的文件资料，交易所提供的华鑫期货席位登陆信息，华鑫期货提供的内部 OA 流程记录、席位申请材料、IT 治理委员会的会议纪要等证据证明。

我局认为，华鑫期货上述行为涉嫌违反《期货公司监督管理办法》（证监会第 110 号令）第四十三条第一项“期货公司应当合理设置业务部门及其职能，建立岗位责任制度，不相容岗位应当分离。交易、结算、财务业务应当由不同部门和人员分开办理”、第四十九条“期货公司应当具有符合行业标准和自身业务发展需要的信息系统，制定信息技术管理制度，按照规定设置信息技术部门或岗位，

保障信息系统安全运行”、第五十六条第一款“期货公司应当在传递交易指令前对客户账户资金和持仓进行验证”和《期货交易管理条例》（2013年7月18日修订）第二十二条“期货公司应当建立、健全并严格执行业务管理规则、风险管理制度”、第六十条第一款“期货公司的交易软件、结算软件，应当满足期货公司审慎经营和风险管理”的规定，构成《期货公司监督管理办法》第九十三条中第八项“在传递交易指令前未对客户账户资金和持仓进行验证”以及《期货交易管理条例》第六十七条第一款第九项“交易软件、结算软件不符合期货公司审慎经营和风险管理以及国务院期货监督管理机构有关保证金安全存管监控规定的要求”、第十六项“违反国务院期货监督管理机构规定的其他行为”规定的违法违规行为。

对华鑫期货有限公司的违法违规行为，公司时任总经理、法定代表人、IT治理委员会主席、分管信息技术部的高级管理人员李俊和时任公司技术总监、信息技术部负责人金文献是直接负责的主管人员。

根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据《期货交易管理条例》（2013年修订）第六十七条第一款、第二款的规定，我局拟决定：

1、对华鑫期货有限公司给予警告，没收违法所得 10,089,097 元，并处 10,089,097 元罚款。

2、对李俊给予警告，并处 3 万元罚款。

3、对金文献给予警告。（因金文献相关违法行为已构成犯罪并由司法机关处以罚金，我局拟对其进行的罚款予以折抵，仅给予其警告，不再另处罚款）

根据《中华人民共和国行政处罚法》第三十二条、第四十二条及《中国证券监督管理委员会行政处罚听证规则》（证监会第 119 号令）（以下简称《听证规则》）第五条之规定，就我局拟对你们实施的处罚决定，你们享有陈述、申辩的权利，华鑫期货有限公司还享有申请听证的权利。根据《听证规则》第八条之规定，若华鑫期货有限公司申请听证，李俊、金文献可以提出一并参加听证申请，是否准许，由我局决定。你们提出的事实、理由和证据，经我局复核成立的，我局将予以采纳。如果你们放弃陈述、申辩和听证的权利，我局将按照上述事实、理由和依据作出正式的行政处罚。”

目前华鑫期货只收到《行政处罚事先告知书》，后续公司将及时披露有关进展情况。公司指定信息披露媒体为《中国证券报》及上海证券交易所网站（www.sse.com.cn），有关公司的信息均以在上述指定信息披露媒体刊登的为准，敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告

上海华鑫股份有限公司

董 事 会

2019年12月10日