

证券代码：834277

证券简称：紫金天风

主办券商：光大证券

紫金天风期货股份有限公司

关于全资子公司收到中国证券监督管理委员会上海监管
局监管关注函的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、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法律责任。

一、基本情况

相关文书的全称：中国证券监督管理委员会上海监管局监管关注函（沪证监期货字〔2024〕10号）

收到日期：2024年2月19日

生效日期：2024年2月5日

作出主体：中国证监会及其派出机构（中国证券监督管理委员会上海监管局）

措施类别：其他（监管关注函）

涉嫌违法违规主体及任职情况：

姓名/名称	类别	具体任职/关联关系
上海天风天成资产管理 有限公司	挂牌公司或其子公司	子公司

涉嫌违法违规事项类别：

中国证券监督管理委员会上海监管局对子公司进行现场检查，发现子公司在资产管理产品的投资运作、内控管理等方面存在不足。

二、主要内容

（一）涉嫌违法违规事实：

中国证券监督管理委员会上海监管局在对子公司现场检查中关注到子公司存在以下问题：一是子公司及母公司以自有资金参与自身管理的单个集合资产管理计划的份额超过 50%。二是子公司投资决策制度不健全、流程不清晰，入库证券的研究报告及入库审核流程未按照公司规定执行。

三、对公司的影响

（一）对公司经营方面产生的影响：

本次监管关注函不会对公司及子公司的正常经营产生重大不利影响。

（二）对公司财务方面产生的影响：

本次监管关注函不会对公司及子公司的财务状况产生重大不利影响。

（三）不存在因本次处罚/处理而被终止挂牌的风险。

四、应对措施或整改情况

子公司对中国证券监督管理委员会上海监管局的监管关注函予以高度重视，将认真核查，切实整改。

（一）资产管理产品投资运作方面

关于子公司及母公司以自有资金参与自身管理的单个集合资产管理计划份额超过 50%的问题，目前已完成整改。截至公告日，母公司紫金天风期货已全部赎回其持有份额，赎回后该产品剩余自有资金份额占比低于 50%。

（二）内控管理方面

1、子公司已对《证券池管理办法》进行修订并形成新的《上海天风天成资产管理有限公司资产管理业务投资池操作规程》发布实施，对资管业务投资标的入池规则和程序做了进一步的统一规范。截至公告日，已按照新制度要求对所有持仓标的进行入池评定，严格执行落实制度规定。

2、子公司已正式发布《上海天风天成资产管理有限公司投资决策管理办法》，统一了投资决策制度，集中明确各项业务决策程序。

五、备查文件目录

《中国证券监督管理委员会上海监管局监管关注函》（沪证监期货字〔2024〕10号）

紫金天风期货股份有限公司

董事会

2024年2月21日