

私募大佬被捕 泽熙关门谢客

泽熙系重仓股今早开盘多数重挫,北京分公司也遭警方调查



见习记者 范鹏 高歌
本报记者 许超声

近日,泽熙投资管理有限公司(简称“泽熙投资”)法定代表人、总经理,坊间号称“宁波敢死队队长”的股坛大佬徐翔及其他相关人员因非法获取股市内幕信息,从事内幕交易、操纵股价等行为,已被公安机关采取刑事强制措施。

上午公司空无一人

今晨,记者来到位于陆家嘴东亚银行金融大厦九层的泽熙投资。公司大门紧闭,门口地上放着一沓今天的证券报,透过玻璃门看到,公司内空无一人。记者在一楼碰到一位泽熙的员工,该女士得知记者身份后表示不知情并迅速离开。大楼物业赵先生称,更早时候还有数位泽熙员工来上班,发现公司关闭后

离去。在泽熙公司门口,记者不时碰到楼内其他公司的员工前来探视,有人甚至拿手机在门口自拍。

记者今晨获悉,泽熙北京分公司也遭警方调查。

昨晚确认徐翔被抓

据杭州日报消息,徐翔于昨天上午在杭州湾跨海大桥庵东出口附近被警方带走。高速交警宁波支队官方微博曾在昨日10时33分发布微博称,因临时交通管制,G15沈海南接线、杭州湾跨海大桥所有进口都已关闭。交通管制于11时12分左右解除。昨天晚间网络流传的徐翔照片显示,徐翔被戴手铐,疑似在杭州湾跨海大桥高速治超点的一个岗亭内。多位熟悉徐翔的炒股大户确认照片上为徐翔本人,表示如果图片未做处理,确系徐翔本人无疑。新华社昨天深夜发布消息确认徐翔被公安机关采取刑事强制措施。

泽熙投资的官网目前已无法打开,记者找到一位微博认证泽熙投资研究员的男士,

他表示人在外地,于昨晚接到同事电话后知情,目前尚未接到公司通知,并称“希望大家就事论事,不应过多诋毁他为人。”

持股多数大幅下跌

徐翔被公安机关依法采取刑事强制措施,不免影响到今天早盘的股市,市场也因此聚焦于泽熙概念股。从上午开盘情况看,沪深股市大幅低开,其中,上证指数以3360.44点跳空44点低开。而二季度末泽熙投资旗下现身前十大流通股股东名单之列的10只个股——粤电力A、新兴铸管、德豪润达、先锋新材、康强电子、东方金钰、东方航空、江苏有线、中国一重、华丽家族等开盘时大多大幅下跌,而三季度泽熙投资仍出现在前十大流通股股东名单之列的康强电子、华丽家族等则是“一”字跌停,即便是传闻徐翔一个月前调研过、未必重仓的一些股票,如近来涨势强悍的兔宝宝同样也是“一”字跌停。

据悉,目前,泽熙投资与徐翔的相关案侦工作正在依法进行中。

上海泽熙投资管理有限公司注册资本3000万元。公司目前管理的资产超过20亿元人民币,是国内比较知名的阳光私募基金公司之一。公开资料显示,公司法定代表人、总经理徐翔1978年出生,17岁那年,怀揣父母给的3万元,徐翔投身股市,恰逢中国A股市场刚起步。

19岁,他开始帮人在银河证券宁波解放南路营业部操盘,没过几年就成了浙江龙头老大。2003年2月15日《中国证券报》在头版刊登的《涨停板敢死队》一文,将银河证券宁波解放南路营业部集中资金迅速拉高股价到涨停,然后大举出货的凶悍操盘风格称为“涨停板敢死队”。其中的1号人物徐翔有了个新绰号:“宁波敢死队队长”。

2009年12月7日,上海泽熙投资管理有限公司的私募基金悄然成立,徐翔渐渐从幕后走向台前。有统计显示,泽熙一期成立后4个月,净值增长近30%,远远跑赢同期大盘及公募、私募一众机构。到今年9月底,泽熙私募年化收益平稳在200%多到300%多之间。

徐翔参与过多个股票的逆市抄底活动,很多突然连续涨停的股票都与他有关,重庆啤酒是其中的经典一役。2012年初,重庆啤酒乙肝疫苗揭盲数据失败,股价从82元跌至28元那天,奇迹发生了。巨量买盘一开盘就横扫千军,股价扶摇直上,盘中一度涨停。此后,重庆啤酒一路涨到40元,徐翔一个月内获利数亿元。

经过多年发展,其个人身价一度达40多亿元,被称为“私募一哥”。

名气渐大后,市场的质疑也随之而来:泽熙投资的业绩到底来源于徐翔投资手段高明还是有内幕交易?有关泽熙的被查传闻从未在资本圈消失。直至11月1日深夜,新华社证实徐翔被查,20年纵横股市的一代私募大佬就此走下神坛。

廿载纵横股海 一朝走下神坛



▲ 网传徐翔戴手铐被捕照片 图 TP
▲ 今天上午,泽熙投资大门紧闭 陶磊 摄

记者从公安部获悉,公安机关打击证券期货市场领域违法犯罪又有新突破:经过三个多月的缜密侦查,公安部指挥上海公安机关成功侦破一起以贸易公司为掩护,境外遥控指挥,境内实施交易,作案手段隐蔽,非法获利巨大的涉嫌操纵期货市场犯罪案件。伊世顿国际贸易有限公司总经理高燕、业务拓展经理梁泽中以及华鑫期货公司技术总监金文献等犯罪嫌疑人已被依法批准逮捕,涉案资金已被公安机关依法冻结。

今年6、7月间,我国证券期货市场出现异常巨幅波动,广大投资者蒙受巨大损失。针对相关部门移交和公安机关侦查掌握的一些违法犯罪线索,公安部会同有关部门迅速开展一系列工作。上海市公安局抽调专门从事打击证券期货市场犯罪的精干警力组成专案组,夜以继日地工作,从数量庞大且专业性极强的市场交易数据中一步步抽丝剥茧、循线追踪,最终锁定犯罪主体并查清其作案手法、过程。

专案组查明,伊世顿公司系外籍人员Georgy Zarya(音译扎亚)、Anton Murashov(音译安东)在香港各自注册成立一家公司后,于2012年9月用两家香港公司名义在江苏省张家港保税区以美元出资注册成立的贸易公司。

据犯罪嫌疑人高燕(女,34岁,江苏南通人)等人交代:受扎亚、安东指使,为规避中国金融期货交易所相关规定的限制,其先后向亲友借来个人或特殊法人期货账户31个,供

伊世顿公司组成账户组交易。伊世顿公司以贸易公司为名,隐瞒实际控制的期货账户数量,以50万美元注册资本金以及他人出借的360万元人民币作为初始资金,在中国参与股指期货交易。此外,安东及其境外技术团队设计研发出一套高频程序化交易软件,远程植入伊世顿公司托管在中国金融期货交易所的服务器,以此操控、管理伊世顿账户组的交易行为。伊世顿账户组通过高频程序化交易软件自动批量下单、快速下单,申报价格明显偏离市场最新价格,实现包括自买自卖(成交量达8110手、113亿元人民币)在内的大量交易,利用保证金杠杆比例等交易规则,以较小的资金投入反复开仓、平仓,使盈利在短期内快速放大,非法获利高达20多亿元人民币。

办案民警介绍,今年6月初至7月初,证券期货市场大幅波动,伊世顿公司在交易沪深300、中证500、上证50等股指期货合约过程中,卖出开仓、买入开仓量在全市场中位居前列,该公司账户组平均下单速度达每0.03秒一笔,一秒内最多下单31笔,且成交价格与市场

行情的偏离度显著高于其他程序化交易者。以6月26日的中证500主力合约为例,该公司账户组的卖开量占市场总卖出量30%以上的次数达400余次;以秒为单位计算,伊世顿账户组的卖开成交量在全市场中位列第一的次数为1200余次;其卖开成交价格与市场行情的偏离度为当日程序化交易者前5名平均值的2倍多。据统计,仅6月初至7月初,该公司账户组净盈利就达5亿余元人民币。

监管机构认为,伊世顿公司的期货交易行为扩大了日内交易价格波幅,与市场价格走势存在关联性,影响了当时市场交易价格和正常交易秩序。公安机关认为,伊世顿公司异常交易行为符合操纵股指期货市场的特征,涉嫌操纵期货市场犯罪。

侦查还表明,高燕将巨额非法获利中的近2亿元人民币通过犯罪嫌疑人邱某(另案处理)经营的“地下钱庄”转移出境,交给安东等境外人员。2015年1月,高燕受扎亚指使,给予华鑫期货公司技术总监金文献(男,47岁,浙江义乌人)100多万元人民币作为好处费。金

文献在全面负责伊世顿公司与交易所、期货商的对接工作中,隐瞒伊世顿公司实际控制的期货账户数量,并协助伊世顿公司对高频程序化交易软件进行技术伪装,进而违规进场交易。金文献还使用其银行账户帮助伊世顿公司转移资金。

目前,案件正在进一步侦办中。公安机关将进一步加大国际合作力度,尽力将仍在境外的犯罪嫌疑人缉拿归案。

据了解,针对证券期货市场犯罪出现的一些新特点、新动向,上海市公安局已在经侦总队增设证券犯罪侦查支队。公安机关将依法打击证券期货市场经济犯罪活动,维护社会主义市场经济秩序,保护广大投资者合法权益。

据新华社

上海破获特大期指操纵案

用600多万本金非法获利20多亿元

上海市经济管理学校
社校联建 和谐发展
www.sems.cn