

隐蔽的“战争”

2021年下半年,中国证监会大厅的数字大屏上,重复播放着央视新闻节目《斩断股市黑手》,一起操纵证券市场的犯罪案件作出宣判,主犯吴某因操纵证券市场罪被判处有期徒刑8年,数罪并罚被判处有期徒刑19年。这是我国操纵市场相关犯罪中获刑最高的一起。

节目中有个不起眼的中年男子,人物介绍:金华市公安局经侦支队支队长蒋益群。斩断这一股市黑手的,正是他带领的金华市公安局经侦支队。

5月25日,在五年一度的全国公安系统英雄模范立功集体表彰大会上,蒋益群被授予“全国优秀人民警察”称号。好不容易约上他采访时,他连连摆手,“我这个人没什么故事,都是大家的功劳,还是和你讲讲我们抓获A股‘股神’背后的‘秘密’吧,提醒大家避免成为‘接盘侠’。”



口述:金华市公安局经侦支队支队长蒋益群
整理:本报首席记者陈佳妮

“股神”

2019年1月29日,当公安部经侦局将吴某涉嫌操纵证券市场案,交由我们侦办时,我知道,这又是一次对我们能力的考验。

为什么说“又”?因为我们当时刚刚侦破一起证券领域的案子——“4·19”罗山东团伙操纵证券市场案件,罗山东团伙操纵股票8只,非法获利4亿余元。

此后,证监会又找到公安部开启第二次合作。当时的线索,指向一个神秘的方向——A股出现了一个“股神”。

A股每个交易日开市有2个时间段,早上9点半到11点半,下午1点到3点。那段时间,每天11点半,各大咨询和股市相关机构,都会流出一个消息:“xxxxxx”(股票代码)下午1点会涨。

开市一看,果然涨了;到了下午3点收市,又会出现新推荐的股票代码,说第二天早上开市一定会涨。

这类收盘后在市场上广为传播的股票,被称之为“盘后票”。这些准确率惊人的“盘后票”,让证监会专业的监管干部也纳闷,哪里来这样可以预测股票必涨的“股神”?背后是不是有资本在操作?是不是涉及证券领域的新犯罪?

不瞒你说,线索移送到我们这里时,民警们像“疯”了一样,研究起哪里有猫腻。其他民警来我们这里,经常打趣我们,“最近哪只股票又要涨了?”

“π”网站

拽着线索的这一头,一拉一扯,我好像绕进了一个数据“线团”。

几个类似的网站引起了我们的“好奇”,我们称之为“π”——因为这些网站均漆黑一片,只有一个 $\pi=3.1415926\dots$ 的长数据,十分神秘。

我们比对了海量网络信息和市场数据,发现“π”的最初发布网站有7个,应该为同一团伙所有,服务器都架设在海外。

这些团伙每天随机挑选其中2个网站推广“盘后票”,且个股代码在发布后两到三分钟,就会消失。这意味着,数据不能追溯,如果涉及犯罪,证据链极难形成闭环。

我们很快感受到对手的狡猾,更下定破案的决心。我们倒要看看,他们到底玩什么“套路”?

一天,我们打开了上述7个网址,毫无例外,一片

漆黑。

下午3点,其中2个网站如期出现一串股票代码。3分钟后,数字消失,页面重回黑暗。

上面显示的股票真的能涨吗?当时正是股市大熊市,我们看了5天,发现网站上显示的4只股票,竟然涨停了。

为什么大盘大跌的时候,它们还是涨?由于暂时找不到原因,我们决定先找到幕后的“股神”是谁。

我得承认,他们的技术很厉害,交易账户、地点经常更换,团伙中交易端、发布端和推广端人员相互独立,各不认识,用的也都是化名,给我们的调查和取证设置了不少障碍。

一连几星期的连轴转,我们和证监会一起锁定了多个异常账户,这些账户的实际控制者吴某和他的团伙,进入了我们的视线。

骗局

一个疑问,逐渐有了答案。而这些答案,叫我们心惊。案件的背后,是一条操纵证券市场的灰黑链条。

我们调查发现,嫌疑人发布“盘后票”信息,是为“抢帽子”交易服务。通俗讲,就是为了顺利地出货。出货需要吸引股民接盘,就得让其确信该股能盈利。

“盘后票”这类股票诱惑性极强,部分股民深信不疑。中国股市交易规则是T+1,也就是说,股民在第二天才能卖出股票,看着涨也只是望洋兴叹。而早已建仓的吴某团伙,见价格拉升,就一笔笔卖出,顺利出货,等到散户第二天想卖,行情已转。

“下游”的投资顾问公司、荐股团队甚至是诈骗团伙,都在利用“π”,如果股民想要在收盘前获得个股代码,必须支付“会员费”。

一家知名证券咨询公司,第一年业绩才600万元,用上“π”之后会员大增,第三年的业绩翻到了6个亿。但可气的是,在缴纳“会员费”后,投资者获取的股票质量会明显下降,导致亏损。

必须将犯罪团伙连根拔起。抱着这样的想法,我们紧紧盯着吴某的行踪。2019年3月,我们发现他悄悄回了国,布局一周后,有惊无险地收了网。

“π”很快停止了更新,只剩下漆黑一片。迎接黑暗的,当然还包括荐股网站、股评机构、场外配资平台等非法团伙。

审讯吴某并不算太难,毕竟,数据不会说谎。只

有一个问题我始终没想明白,为什么他能猜到哪只股票涨?

没想到他也挺坦白,说自己并不是“预测”,而是“决定”,玩的是个“心理战”——

最初的“π”只有50%准确率,可中国股民多、传播广,也会被不法人员拿去包装成自己的荐股平台。经过一吆喝,越来越多股民被吸引,一开市就会买入,拉高股价,“π”的准确率也越来越高。

所以,是“韭菜”们造就了“股神”。

实战

最后一个“为什么”终于解决了,可我还是没能睡安稳。

作为一个入行20多年的老经侦人,这个案子让我感受到了“本领恐慌”。吴某案的刑事判决书始终放在我的办公桌上,足足251页。

每次看到判决书,我都会自问:如果一名犯罪嫌疑人身上有100个案子,可如果我们手上只有1个案子的线索,有多少能力和信心,去研究透?

我答不上来,经济犯罪的变化太快了,像是个无底洞,新型犯罪不断涌现。我们需要一支更专业的尖刀团队,与之抗衡。于是,2019年8月,金华市公安局经济犯罪研判中心成立。

中心的年轻小伙子们,私下里喊我“蒋校长”。因为在这里,我们不仅承担着重大案件的研判任务,还要培养更多的专业研判人才。庆幸的是,成效非常明显——

“蒋校长,研判结果马上出来,让我再干一会儿……”这是2020年某天凌晨1点,我到中心“赶”人时,年轻民警对我说的话。

那时,省公安厅部署打击治理跨境赌博专项行动,中心迅速组织7个战队,开展专题研判。尽管对跨境赌博没有打击经验,但是办案时要“挖掘数据”的逻辑不变。

中心都是些从各区县选拔出来的优秀民警,谁也不肯服输,不到一个月,我们抓获为跨境赌博提供支付结算服务的嫌疑人103名,取得了打击跨境赌博的首场胜利。此后,我们又连续作战,开展6波收网行动,抓获600多名嫌疑人。

看着他们“内卷”的身影,我感慨万分,同时也感受到经济学家罗纳德·科斯预言式的金句——“如果你拷问数据到一定程度,它就会坦白一切”,正在我们研判中心成为现实。