

## 芝加哥商品交易所即决禁市通告

文件编号: **CME 18-0856**

非会员: **HANA FINANCIAL INVESTMENT**

CME 规则: **413.即决禁市行为 (部分)**

### **413.A.禁市权力**

首席监管官或其委派人经诚信认定有充分的理由相信必需采取该项立即行动来保护交易所的最佳利益, 可责令: 1) 任何一方禁止进入任何或所有芝商所集团市场; 2) 任何一方禁止进入 Globex 平台; 3) 任何一方禁止进入芝商所集团拥有或控制的任何其它电子交易或清算平台; 或 4) 立即将任何会员从芝商所集团拥有或控制的任何交易大厅移除。

**调查结果:** 2018 年 5 月 21 日, 芝商所市场监管部 (“市场监管部”) 通过其首席监管官决定即时禁止 Hana Financial Investment (“Hana”) 直接或间接进入所有芝商所集团市场, 包括 CME Globex 电子交易平台 (“Globex”)、芝商所集团拥有或控制的任何其它电子交易或清算平台以及芝商所集团拥有或控制的所有交易大厅。该项即决禁市令禁止 Hana 以及通过 Hana 账户的任何人, 就芝商所集团的任何交易所产品为任何个人、实体或账户交易、下单以及控制或指示交易。尽管有以上规定, 但经 Hana 或 Hana 的客户申请, Hana 的清算机构可以清算其在该清算机构的未平仓头寸。

针对 Hana 作出该项即决禁市的依据如下。在至少从 2017 年 5 月到目前涉及 Hana 的客户账户所进行的多次调查过程中, Hana 就有关账户所有权、账户的授权交易员、审计跟踪数据以及账户报表等情况, 向市场监管部提供了不完整、不准确、虚假和误导性的信息。Hana 的行为严重阻碍了市场监管部针对其在多个交易所产品中涉嫌欺骗、扰乱性交易和资金转移活动而开展的数项调查。

市场监管部进一步观察到, 在多个交易所产品中, 于数家清算会员机构持有综合账户的 Hana 不当且不准确地在独立拥有和控制的不同客户账户之间取净头寸, 并在之后每天向其清算会员机构报告这些净头寸。这种做法很可能造成其清算会员机构未能依照规则 960 履行其在记录中反映综合账户持有多头和空头头寸总量的义务。清算会员机构相应地向交易所报告了不准确的每日多头和空头头寸, 很可能影响了未平仓权益报告。鉴于 Hana 之前未能准确地识别账户所有人和账户的授权交易员, 市场监管部不确信 Hana 能够在不危及芝商所集团市场完整性的情况下继续经营或开展业务。

前述情况支持经诚信认定有充分的理由相信必需采取该项立即行动来保护交易所和整个市场的最佳利益。

**禁市:** 依据规则 413, 此项禁市将为期 60 天, 自下述生效日期开始, 一直持续到 2018 年 7 月 20 日 (含), 除非首席监管官或其委派人提供书面通知, 要求延长此项禁市的期限。

**生效日期:** 2018 年 5 月 21 日