

文件编号: COMEX 16-0485-BC

非会员: KE XU

规则违反: **NYMEX 规则 575.A.禁止扰乱市场行为**
任何人均不得在输入订单时意图在执行前将其撤销, 或, 将其修改以避免执行而输入或促成输入订单。

NYMEX 规则 432.一般违规行为 (部分)

以下行为属违规:

L. 1.未能在经适当召集的听证会、安排的工作人员约谈或与任何调查有关出现在交易所、交易所工作人员或任何调查或听证委员会面前;

NYMEX 规则 576. 识别 Globex 终端操作人

每个 Globex 终端操作人都要以交易所规定方式进行识别, 并应遵守交易所规则。如果需要在交易所注册用户 ID, 清算会员有责任确保注册始终是最新和准确的。每个人都必须使用唯一用户 ID 访问 Globex。在任何情况下, 任何人均不得用其唯一用户 ID 以外的用户 ID 输入委托或允许输入委托。

调查结果: 2018 年 3 月 1 日, 商品交易所 (“COMEX”) 调查委员会的审查小组指控 Ke Xu (“Xu”) 违反了 NYMEX 规则 575.A.、432.L.1 和 576, 指控依据为于 2016 年 6 月 28 日至 2016 年 7 月 13 日期间, Xu 在黄金和白银期货市场通过输入无意进行交易的订单从事了扰乱市场交易活动。具体而言, Xu 的典型做法是在市场一方输入大单或分层订单, 然后在订单簿另一方挂单的小单执行后撤销订单。此外, 其也未能出现在交易所工作人员面前参加预定的约谈。

2018 年 6 月 21 日, COMEX 商业行为委员会 (“BCC”) 听证小组作出了认为 Xu 未能回答对他提出之指控的裁定。听证小组进一步裁定 Xu 被视为已承认作出的指控并且已放弃要求对指控理据进行听证的权利。

2018 年 7 月 11 日, COMEX BCC 审查小组 (“BCC 审查小组”) 举行了处罚听证会并认定 Xu 实施了所指控的违反行为。

处罚: 按照 NYMEX 规则 402.B (制裁), BCC 审查小组责令 Xu (1) 就本案以及另一起伴随案件 NYMEX 16-0485-BC 支付 60,000 美元罚金 (其中 50,000 美元罚金分配给 COMEX); 及 (2) 永久禁止 (a) 申请任何芝商所交易所的会籍; (b) 直接或间接访问芝商所拥有或控制的任何交易或清算平台; 及 (c) 进入任何芝商所交易所拥有或经营的任何交易大厅。

生效日期: 2018 年 7 月 30 日