

芝加哥期货交易所处罚通告

文件编号: **CBOT 16 - 0483 - BC**

非会员: Sumitomo Mitsui Trust Bank, Limited

CBOT 规则

违反: **CBOT 规则 432.W: 一般违规行为**

任何一方未能勤勉地监督其雇员和代理人开展与交易所相关的业务即属违规。

CBOT 规则 534: 禁止洗售交易

如果知道或者合理应知道买卖订单的目的是为了避免建立面临市场风险的真实市场头寸（这通常被称为洗售交易），任何人均不得下达或接受产品和到期月份相同以及（如果是看跌或看涨期权）行权价格相同的买卖订单。实益所有权相同的多个账户的买卖订单如果是意图抵消市场风险或价格竞争，也应被视为违反了禁止洗售规定。

调查结果: 依照 Sumitomo Mitsui Trust Bank, Limited (“SMTB”) 既未承认亦未否认的遭处罚规则违反行为和解提议，2018 年 3 月 14 日，CBOT 商业行为委员会的审查小组（“审查小组”）认定在 2016 年 2 月期间的四个交易日，SMTB 东京分行的交易员在 Globex 执行了多项不同 CBOT 国债期货市场的交易，而交易的买卖方均由 SMTB 实益拥有。这些交易的目的是在 SMTB 账户之间转移头寸。交易员现在认识到这种类型的交易应通过后台转移完成。审查小组还发现，在进行这些交易时，SMTB 未能勤勉地充分培训和监督其交易员以确保他的行为符合交易所规则。在完成这些交易之后，SMTB 采取了补救和培训措施。

审查小组认为 SMTB 因此违反了 CBOT 规则 432.W 和 534。

处罚: 按照和解提议，审查小组责令 SMTB 支付 105,000 美元罚金。

生效

日期: 2018 年 3 月 16 日