

## 芝加哥商品交易所处罚通告

文件编号: **CME 16-0364-BC**

会员: **BELVEDERE TRADING LLC**

交易所规则 **432.W.一般违规行为（部分）**

(W) 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。

**调查结果:** 依照在 2018 年 3 月 14 日举行的听证会上 Belvedere Trading LLC (“Belvedere”) 提出的其既未承认亦未否认遭处罚事实指控或规则违反行为的和解提议, CME 商业行为委员会的审查小组 (“BCC 审查小组”) 认定在 2015 年 10 月 1 日至 11 月 18 日期间, Belvedere 当时雇用的交易员 (“交易员”) 使用 Belvedere 的其他雇员登记的 Tag 50 用户 ID 在 E-mini S&P 500 合约市场输入了订单, 这些订单并不意图进行交易, 而是为了鼓励市场参与者对交易员输入的在订单簿另一方挂单的小单进行交易。在小单交易完成后, 交易员撤销大单。BCC 审查小组还发现, 在此期间, Belvedere 未能充分监督 (1) 其雇员的潜在欺骗交易 (尽管交易所之前针对不相关但可能类似的活动发出了通告) 及 (2) 雇员使用 Tag 50 的情况以确保雇员使用唯一的用户 ID 来访问 Globex。

BCC 审查小组认为 Belvedere 违反了交易所规则 432.W。

**处罚:** 按照和解提议, BCC 审查小组对 Belvedere 处以 100,000 美元罚金。

**生效日期:** 2018 年 3 月 16 日