

## 芝加哥商品交易所

### 立即撤销连接访问权限公告 (NOTICE OF SUMMARY ACCESS DENIAL)

文件编号：[CME-18-0856](#)

非会员：**HANA FINANCIAL INVESTMENT**

**CME 相关规则：** 规则 413. 立即撤销连接访问权限处分（部分节录）

#### 413.A. 撤销连线存取权限之职权

首席监管官（Chief Regulatory Officer）或其授权代表，在基于善意判定有充分理由相信为了保护交易所的最佳利益而必须立即采取行动时，得下令：1）撤销任何当事人存取任何或所有 CME 集团市场之权限；2）撤销任何当事人访问 Globex 平台之权限；3）撤销任何当事人存取任何由 CME 集团拥有或控制的其他电子交易或结算平台之权限；或 4）立即将任何会员驱离任何由 CME 集团拥有或控制的交易大厅。

#### 调查结果：

2018 年 5 月 21 日，CME 集团市场监管部透过其首席监管官，立即撤销 Hana Financial Investment（以下简称「Hana」）直接与间接存取所有 CME 集团市场的权限，这包含 CME Globex 电子交易平台（Globex）、任何由 CME 集团拥有或控制的其他电子交易或结算平台，以及所有由 CME 集团拥有或控制的交易大厅。此立即撤销连接权限的处分，禁止 Hana 以及任何透过 Hana 账户的人员，在任何 CME 集团交易所商品中进行交易、委托下单，以及控制或指示任何个人、实体或账户进行交易。尽管有上述规定，针对 Hana 在其结算会员公司的未平仓头寸，结算会员公司得应 Hana 或 Hana 客户的请求进行平仓。

对 Hana 实施立即撤销连线存取权限处分之依据如下：自 2017 年 5 月起至目前为止，在涉及 Hana 客户账户的多起调查过程中，Hana 提供了市场监管部关于账户所有权、授权交易员、审计追踪纪录（audit trail data）以及对账单等不完整、不准确、虚假且具误导性的信息。Hana 的行为严重阻碍了市场监管部针对各项交易所商品中涉及幌骗（spoofing）、破坏性的交易（disruptive trading）与资金移转活动（money pass activity）的数项调查。

市场监管部进一步观察到，在多家结算会员公司开立综合账户（omnibus accounts）的 Hana，在各项交易所商品中，不当且不准确地将独立拥有与控制的不同客户账户之间的头寸进行净额结算（netted positions），随后每日向其结算会员公司申报这些净额头寸。这种做法可能导致其结算会员公司未能履行规则 960 的义务，亦即未能于其纪录中如实反映综合账户所持有的总多头与空头头寸。而结算会员公司随之向交易所申报了不准确的每日多空头寸，这可能影响了未平仓合约（open interest）的申报数据。鉴于 Hana 先前未能准确识别帐户所有人及授权交易员，市场监管部无法确信 Hana 能在不危及 CME 集团市场诚信的情况下继续运营或开展业务。

上述情况支持了基于善意所做出的判定，亦即有充分理由相信必须立即采取此行



动，以保护各交易所及市场的最佳利益。

**撤销连接访问权限期间：** 依据规则 413，此连线权限撤销处分将于下方生效日期起生效，为期 60 天，持续至 2018 年 7 月 20 日止（含）。除非首席监管官或其授权代表发出书面通知，延长此撤销连线存取权限之时间，否则将依此期限执行。

**生效日期：** 2018 年 5 月 21 日