

芝加哥商品交易所 纪律处分通告

文件编号: [CME 22-1592-BC](#)

非會員: **Jaeho Lee**

CME 相关规则: **规则 539.A. 禁止预先安排、预先协商及非竞争性的交易（部分内容）**

任何人士均不得预先安排或预先协商任何买卖，亦不得以非竞争性方式执行任何交易。

规则 576. Globex 终端识别（部分内容）

每一位个人必须使用独一无二的「识别码」（Operator ID）登录 Globex。在任何情况下，任何人士均不得使用非本人之识别码输入订单，亦不得允许他人使用非其本人之识别码输入订单。

调查结果: 根据和解提议，**Jaeho Lee** 对于处罚所依据的违规行为或调查结果既不承认也不否认，芝加哥商业交易所业务行为委员会的小组（「小组」）于 2023 年 12 月 14 日裁定，在 2022 年 2 月 8 日至 2022 年 4 月 14 日期间，**Lee** 多次在微型纳斯达克 100 指数选择权期货市场预先安排执行多笔交易。具体而言，**Lee** 协调其本人账户与其配偶账户的订单输入，以确保其订单与其配偶在独立账户中输入的订单成交。小组亦裁定 **Lee** 使用了非本人的唯一识别码进行下单。

小组结论认为，**Lee** 因此违反了 CME 规则 539.A. 条及规则 576 条。

处罚: 依照和解提议，小组命令 **Lee** 针对本案及关联案件 NYMEX 22-1592-BC 与 CBOT 22-1592-BC 支付 15,000 美元的罚款（其中 5,000 美元的罚款分配给 CME）。小组同时对 **Lee** 处以 10 个工作日的暂停交易处分，禁止其进入任何由芝商所集团拥有或控制的交易大厅，并禁止直接和间接使用任何由芝商所集团拥有或控制的指定合约市场、衍生品清算组织或掉期执行设施。停权期间自 2023 年 12 月 18 日交易日起，至 2024 年 1 月 2 日交易日（含）止。

生效日期: 2023 年 12 月 18 日