

商品交易所处罚通告

文件编号: **COMEX-15-0193-BC**

非会员: **Yongzhi Financial Investment Co.**

交易所规则 **规则 432。一般违规行为**

W. 因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。

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。另外，任何人均不得明知性地直接或间接执行或容忍直接或间接执行这些订单。

调查结果: 依照在 2017 年 9 月 28 日举行的听证会上 Yongzhi Financial Investment Co. (“Yongzhi”) 提出的其既未承认亦未否认遭处罚事实指控或调查结果的和解提议，COMEX 商业行为委员会的审查小组（“审查小组”）认定在 2015 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 5 日期间，两名 Yongzhi 交易员在 Yongzhi 完全拥有和控制的账户之间执行了一系列的 COMEX 铜期货合约交易。审查小组进一步发现 Yongzhi 未能勤勉地充分监督其交易员以确保他们的行为符合交易所规则。

审查小组发现 Yongzhi 因为前述行为而违反了交易所规则 432.W 和 534。

处罚: 按照和解提议，审查小组责令 Yongzhi 向交易所支付 55,000 美元罚金。

生效日期: 2017 年 10 月 2 日