

商品交易所
纪律处分公告

文件编号: COMEX 16-0495-BC

非会员: WEIHAO HUANG

交易所规则: 规则 575. A. (禁止扰乱市场行为)

所有委托必须出于执行真实交易之目的而输入。此外, 所有非操作类消息必须出于合理目的而善意地输入。

任何人均不得在输入委托时意图在执行前撤销或修改委托以避免执行而输入或促成输入委托。

调查结果: 依据 Weihao Huang (“Huang”)于 2018 年 6 月 12 日在聆讯期间呈交的一份和解提议书 (Huang 在其中既未承认亦未否认处罚所基于的违规), COMEX 商业行为委员会 (“BCC”) 审查小组认定, 在 2016 年 7 月的多个日期, Huang 进行了一种由无交易意图地在铜、银及黄金期货市场输入和撤销订单所构成的交易策略。具体而言, Huang 在市场的一边输入大额订单, 以便执行其在市场另一边的小额订单。小额订单成交后, Huang 即在几秒内撤销大额订单。通过此行为, Huang 获得了\$6,447.10 的利润。

审查小组认定, 因上述情况, Huang 违反了交易所规则 575. A。

处罚: 根据和解提议书, 审查小组命令 Huang: 1) 支付\$25,000 罚款; 2) 二十(20)个营业日禁止进入任何芝商所交易大厅且禁止直接和间接使用芝商所拥有或控制的所有电子交易和清算平台, 包括 CME Globex; 3) 交出利润\$6,447.10。禁止期为 2018 年 6 月 14 日至 2018 年 7 月 12 日(含)。

生效日期: 2018 年 6 月 14 日