

纽约商品交易所 纪律处分通告

文件编号：[COMEX 22-1537-BC-2](#)

非会员：**JINGYOU INTERNATIONAL TECHNOLOGY LTD.**

COMEX 相关规则：**规则 539 禁止预先安排、预先协商及非竞争性的交易（节录）**

539.A. 一般禁止规定

任何人不得预先安排或预先协商任何买卖，或以非公开竞价方式执行任何交易。

规则 534 禁止洗售交易

任何人不得在同一商品和同一到期月份（或者就卖权或买权而言在同一履约价格），下达或接受买单与卖单，如果该人知道或理应知道这些订单的目的是为了避免承担暴露于市场风险的真实市场头寸（此类交易通常被称为洗售买卖）。为具有共同实质所有权的不同账户下达买单与卖单，且其意图为抵销市场风险或价格竞争者，亦将被视为违反禁止洗售交易的规定。此外，任何人不得通过直接或间接方式，故意执行或协助执行此类订单。

规则 432 一般违规行为（节录）

下列行为即属违规：

W. 任何一方未能善尽监督其员工及代理人从事与交易所相关业务之责。

调查结果：

根据和解提议，JINGYOU INTERNATIONAL TECHNOLOGY LTD. 既未承认也未否认处罚所依据的违规行为，2023 年 11 月 15 日，COMEX 商业行为委员会小组裁定，在 2021 年 7 月 27 日至 2021 年 9 月 7 日期间，一名 JINGYOU INTERNATIONAL TECHNOLOGY LTD. 的交易员代表该公司拥有的一个账户，在铝期货市场的同一商品与到期月份下达了买单与卖单，目的是为了测试公司的交易系统以确保交易能被正确分配。该交易员知道或理应知道这些订单的目的是为了避免承担暴露于市场风险的真实市场头寸。

该小组进一步裁定，在 2021 年 9 月 27 日和 2021 年 9 月 28 日，JINGYOU INTERNATIONAL TECHNOLOGY LTD. 的员工在铝期货日历价差市场中，预先安排了该公司拥有之账户与一名公司员工拥有之账户之间的交易。这些交易的目的同样是为了测试公司的交易与分配系统。来自这些预先安排交易的成交量，促使该公司达到了交易所铝市场庄家（造市商）计划所要求的门槛，并因此获得了 4,000 美元的津贴。

小组亦裁定，在 2021 年 7 月至 2021 年 9 月期间，JINGYOU INTERNATIONAL TECHNOLOGY LTD. 未能善尽监督其员工之责，未提供关于 COMEX 规则的充分合规培训或教育材料，且未能善尽监督其员工之交易，以确保遵守 COMEX 关于洗售交易与非竞争性的交易的规定。

请注意，如果原始英文版本与本翻译版本之间存在任何差异或不一致，应以英文版本为准。此通告的正式英文版纪律处分通告可通过以上文件编号（File No.）附有的链接找到，也可在芝商所（CME Group）网站 www.cmegroup.com 上查阅。



处罚: 依照和解提议，小组命令 JINGYOU INTERNATIONAL TECHNOLOGY LTD. 支付 25,000 美元的罚款，并缴回 4,000 美元的非法所得。

生效日期: 2023 年 11 月 17 日

请注意，如果原始英文版本与本翻译版本之间存在任何差异或不一致，应以英文版本为准。此通告的正式英文版纪律处分通告可通过以上文件编号（File No.）附有的链接找到，也可在芝商所（CME Group）网站 www.cmegroup.com 上查阅。