

纽约商品交易所处罚通告

文件编号: **NYMEX 16-0532-BC**

非会员: **KOREA INVESTMENT & SECURITIES CO., LTD.**

交易所规则 **432.一般违规行为**

以下行为属违规:

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。

539.C.关于 Globex 交易的执行前沟通

在下列情形下, 如果一方(甲方)希望确保对方手(乙方)会成为交易的另一方, 交易双方可以针对在 Globex 平台上执行的交易进行执行前沟通:

C.3.允许的订单输入方法

a. Globex Cross (“G-Cross”)

甲方的订单先输入到Globex平台。乙方的订单在甲方输入订单5秒后才能输入到Globex平台。

576.识别Globex终端操作人

每个Globex终端操作人都要以交易所规定方式进行识别, 并应遵守交易所规则。如果需要在交易所注册用户ID, 清算会员有责任确保注册始终是最新和准确的。每个人都必须使用唯一用户ID访问Globex。在任何情况下, 任何人都不得用其唯一用户ID以外的用户ID输入委托或允许输入委托。

调查结果: 依照在 2017 年 12 月 4 日举行的听证会上 Korea Investment & Securities Co., Ltd. (“KIS”)提出的其既未承认亦未否认遭处罚违规行为的和解提议, NYMEX 商业行为委员会的审查小组 (“BCC 审查小组”)认定在 2016 年 2 月 1 日至 5 月 31 日期间 KIS 的交易员多次在执行前沟通后下达指令, 且在没有等待要求的五秒钟时间的情况下于 Globex 平台上交叉交易多个原油期货订单。KIS 因为不熟悉交易所规则而未能适当地监督其交易员并且也未能向其交易员提供有关交易所规则的任何合规培训或教育材料。另外, KIS 还未能确保其交易员进入 Globex 系统使用的 TAG 50 登记信息针对使用 Globex 的每一个人都是最新、准确和唯一的, 因为其交易员输入订单时使用的 TAG 50 ID 登记在不同的用户名下。

审查小组发现 KIS 因为前述行为而违反了规则 432.W.、539.C.和 576。

处罚: 按照和解提议, BCC 审查小组责令 KIS 支付 65,000 美元罚金。

生效日期: 2017 年 12 月 6 日