

## 纽约商业交易所 纪律处分通告

文件编号：[NYMEX 16-0532-BC](#)

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

NYMEX 相关规则：**规则 432 一般违规事项（General Offenses）**

下列行为属违规：

W. 任何当事人未能尽责监督其员工与代理人从事与交易所相关之业务行为。

### **规则 539.C 关于 Globex 交易的执行前沟通（Pre-Execution Communications Regarding Globex Trades）**

当一方（第一方）希望确保对手方（第二方）将作为该订单的反向对手方时，双方可针对在 Globex 平台上执行的交易进行执行前沟通，但须符合以下情形：

#### **C.3. 允许的订单输入方式**

##### **a. Globex 交叉交易（「G-Cross」）**

第一方的订单须首先提交至 Globex 平台。自提交第一笔订单之时起，必须经过 5 秒钟的间隔，第二方才可提交其订单至 Globex 平台。

### **规则 576 Globex 终端操作员的身份识别（Identification of Globex Terminal Operators）**

每位 Globex 终端操作员皆应以交易所规定的方式向交易所表明身份，并受交易所规则之规范。若规定操作员 ID 须向交易所注册，结算会员有义务确保注册资讯随时保持最新且准确。每位个人必须使用专属的唯一操作员 ID 才能连线至 Globex。在任何情况下，任何人都不得使用非其本人专属的操作员 ID，或允许他人使用非其本人专属的操作员 ID 来输入订单。

**调查结果：** 依据 Korea Investment & Securities Co., Ltd.（以下称「KIS」）于 2017 年 12 月 4 日听证会上提出的和解提议，KIS 在该提议中对作为处罚基础的违规活动既不承认也不否认，NYMEX 商业行为委员会小组裁定，在 2016 年 2 月 1 日至 2016 年 5 月 31 日期间的多个场合中，KIS 交易员在进行执行前通讯后，于 Globex 上交叉撮合了多笔原油期货订单，却未在订单下单之间等待规定的五秒钟。KIS 未能妥善监督其交易员，因 KIS 对交易所规则并不熟悉，且未能向其交易员提供任何有关交易所规则的合规培训或教育训练教材。此外，KIS 未能确保其连接至 Globex 系统之交易员的 TAG 50 注册信息保持最新、准确，且未确保使用 Globex 的每位个人皆有专属的唯一 ID，因为其交易员使用了注册于不同用户名下的 TAG 50 ID 来输入这些订单。



小组裁定，由于前述行为，KIS 违反了规则 432.W.、规则 539.C.与规则 576。

处罚：依据和解提议，BCC 小组命令 KIS 支付 65,000 美元的罚款。

生效日期：2017 年 12 月 6 日