

纽约商业交易所 纪律处分通告

文件编号：[NYMEX 17-0646-BC-1](#)

非会员：**FUJI FUTURES CO., LTD.**

NYMEX 相关规则：**規則 432 一般違規事項（General Offenses）**

下列行为属违规：
W. 任何一方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。

调查结果： 依据 Fuji Futures Co., Ltd.（以下称“Fuji Futures”）于 2018 年 6 月 12 日听证会上提出的一项和解提议，Fuji Futures 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（以下称“BCC 小组”）裁定，在 2016 年 4 月至 2017 年 3 月的多个交易日间，受雇于 Fuji Futures 的一名交易员（下称“该交易员”）为了探测订单簿深度，于开盘前时段在 Globex 电子交易平台上，下达了多笔原油、亨利港天然气（“天然气”）及铂金期货合约的订单。该交易员下达与取消这些订单的行为，导致了公开显示的开盘前指示性价格 (Indicative Opening Price) 发生波动。BCC 小组亦裁定，在此期间，Fuji Futures 未能向其交易员提供关于交易所规则与规范的指示或指导（特别是关于破坏性的交易的规定），亦未能监督其交易员的交易活动以确保其符合交易所规则。

BCC 小组结论为，Fuji Futures 违反了交易所规则 432.W。

处罚： 依据和解提议，BCC 小组命令 Fuji Futures 就本案及相关联案件 COMEX 17-0646-BC 支付总额 45,000 美元的罚款（其中 35,000 美元分配给 NYMEX）。

生效日期： 2018 年 6 月 14 日