

纽约商业交易所 纪律处分通告

文件编号：[NYMEX 17-0646-BC-2](#)

非会员：**SHINGO YAMAMOTO**

NYMEX 相关规则：**规则 575.A. 禁止破坏性的交易行为**

任何人在下单时，若意图在成交前取消该订单，或修改该订单以避免成交，皆不得下达或促使他人下达该订单。

调查结果： 根据 Shingo Yamamoto（下称 Yamamoto）于 2018 年 6 月 12 日听证会上提出的和解提议，Yamamoto 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 8 月至 2017 年 3 月的多个交易日间，Yamamoto 为了探测委托簿深度，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。这些订单的下达与取消，导致了公开显示的开盘前指示性价格（Indicative Opening Price）产生波动。

据此，BCC 小组裁定 Yamamoto 违反了 NYMEX 规则 575.A.（禁止破坏性的交易行为）。

处罚： 依照和解提议，BCC 小组命令 Yamamoto 针对本案及关联案件 COMEX 17-0646-BC 支付共计 25,000 美元的总罚款（其中 20,000 美元的罚款分配给 NYMEX），并处以 20 个工作日的交易暂停处分，禁止其：（1）申请任何芝商所集团旗下交易所的会员资格；（2）进入任何芝商所集团的交易大厅；及（3）直接和间接使用所有由芝商所集团拥有或控制的电子交易与结算平台，包含 CME Globex。暂停交易期间自 2018 年 6 月 14 日起，至 2018 年 7 月 12 日（含）止。

生效日期： 2018 年 6 月 14 日