

纽约商业交易所
惩处措施通告

文件编号: NYMEX 17-0646-BC

非会员: FUJI FUTURES CO., LTD.

交易所规则: 432.W. 一般违规行为 (部分)

(W)如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，即属违规行为。

调查结果: 依照在 2018 年 6 月 12 日举行的听证会上 Fuji Futures Co., Ltd. (“Fuji Futures”) 在既不承认亦不否认惩罚所基于的违规行为的前提下提出的和解提议，纽约商业交易所 (“NYMEX”) 商业行为委员会小组 (“BCC 小组”) 发现，在 2016 年 4 月至 2017 年 3 月期间的多个交易日，一名 Fuji Futures 交易员 (“交易员”) 为了试探订单簿的深度，于开盘前在 Globex 电子交易平台上多个原油、亨利港天然气 (“天然气”) 以及铂金期货合约中输入订单。该交易员的这些订单的输入及取消行为造成公开发布指示性开盘价发生波动。BCC 小组进一步发现，在此期间，Fuji Futures 未能就交易所规则及规例 (尤其针对扰乱市场交易) 向其雇员提供指示或指导，亦未能监督其雇员的交易活动以确保遵守交易规则。

BCC 小组认定 Fuji Futures 违反了交易所规则 432.W。

处罚: 按照和解协议，BCC 小组责令 Fuji Futures 就本案件以及相伴案件 COMEX 17-0646-BC 支付 45,000 美元总罚金 (其中 35,000 美元罚金划拨给 NYMEX) 。

生效日期: 2018 年 6 月 14 日