

纽约商业交易所
惩处措施通告

文件编号: **NYMEX 17-0646-BC**

非会员: **SHINGO YAMAMOTO**

交易所规则: **NYMEX 规则 575.A.禁止扰乱市场行为**

任何人均不得在输入订单时意图在执行前将其撤销或修改以避免执行，而输入或促成输入订单。

调查结果: 依照在 2018 年 6 月 12 日举行的听证会上 Shingo Yamamoto (“Yamamoto”) 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，NYMEX 商业行为委员会小组 (“BCC 小组”) 发现，在 2016 年 8 月至 2017 年 3 月期间的多个交易日，Yamamoto 为了试探订单簿的深度于开盘前在 Globex 电子交易平台上的多个原油、亨利港天然气 (“天然气”) 以及铂金期货合约中输入订单。这些订单的输入及取消行为造成公开发布指示性开盘价 (“IOP”) 发生波动。

因此，BCC 小组认定 Yamamoto 违反了 NYMEX 规则 575.A (禁止扰乱市场行为)。

处罚: 按照和解协议，BCC 小组责令 Yamamoto 就本案件以及相伴案件 COMEX 17-0646-BC 支付 25,000 美元总罚金 (其中 20,000 美元罚金划拨给 NYMEX)，并在 20 个营业日内暂令停止(1)申请任何芝商所交易所的会籍；(2)进入任何芝商所的交易大厅；及(3)直接或间接访问芝商所拥有或控制的所有电子交易与清算平台。暂停期从 2018 年 6 月 14 日起至 2018 年 7 月 12 日 (含)。

生效日期: 2018 年 6 月 14 日