

纽约商业交易所 即刻禁市通知

文件编号: **NYMEX 19-1122**

非会员: **3 CROWNS CAPITAL**

NYMEX 规则: **第 413 条规则 即刻禁市措施（部分）**
413.A. 禁市权限

在善意确定有充分理由相信有必要立即采取此类措施来保护交易所的最佳利益后，首席监管官或其代表可作出以下命令：1) 禁止任何一方进入任何或所有 CME Group 市场；2) 禁止任何一方进入 Globex 平台；3) 禁止任何一方进入 CME Group 拥有或控制的任何其他电子交易或结算平台；或者 (4) 立即将任何会员从 CME Group 拥有或控制的任何交易场所中驱逐。

裁定: 2019 年 11 月 14 日，CME Group 市场监管部通过其首席监管官即刻禁止了 Jinlin Tian (“Tian”)、3 Crowns Capital (“3 Crowns”) 和 3 Crowns 的员工或股东 Damien Yeo (也被称为 Zi Yuan Yeo) (“Yeo”)、Aaron Dao Chang Pang (“Pang”)、Thomas Lim (也被称为 Seng Wah Lim) (“T. Lim”) 和 Michael Lim (也被称为 Sze Wee Lim) (“M. Lim”)：(1) 进入 CME Group 拥有或控制的任何交易场所；和 (2) 直接和间接进入 CME Group 拥有或控制的任何指定合约市场、衍生品清算组织或掉期执行设施。本即刻禁市措施禁止 Tian、3 Crowns、Yeo、Pang、T. Lim 和 M. Lim 直接或间接在 CME Group 拥有或控制的任何指定合约市场、衍生品清算组织或掉期执行设施下单、交易或指示或控制任何产品的交易。还禁止这些实体和个人拥有、管理、控制或拥有此类平台上的任何产品或仓位。尽管有上述规定，未平仓交易可由清算公司自行清算或应 3 Crowns 的要求清算。

对 Tian、3 Crowns、Yeo、Pang、T. Lim 和 M. Lim 的即刻禁市措施基于以下原因。2019 年 5 月，市场监管部发现 3 Crowns 交易员和 Tian (非 3 Crowns 员工) 拥有并交易的非关联账户之间存在异常交易模式，并启动了正式调查。交易的频率和数量、主动性和被动性、时间进入差异和盈利都表明，交易可能是出于非善意的目的而执行的。在回应询问时，3 Crowns 和 Tian 都否认知道对方或有任何联系。尽管如此，但市场监管部在 3 Crowns 的记录中发现至少有一笔资金是从 3 Crowns 转移给了 Tian。

在后续调查过程中，市场监管部发现 3 Crowns 存在其他异常情况，包括由交易员部分出资的账户被暂停进入 CME Group 市场，以及与其他公司和个人存在关联，而这些公司和个人是或曾经是交易方式调查的对象。

在整个审查和调查过程中，3 Crowns 多次未能或拒绝提供完整准确信息，以响应市场监管部关于提交文件的要求，包括获取通信、与关联实体及其自身结构相关的信息以及与关联方相关的信息的要求。包括 Yeo 和 T. Lim 在

内的某些 3 Crowns 员工在调查访谈中提供了误导性信息。M. Lim（3 Crowns 的大股东）就他在非 3 Crowns 交易员或交易实体中的所有权益或向他们提供资金作出了虚假证词。其他 3 Crowns 员工拒绝接受访谈，其中包括 Pang，其曾是 3 Crowns 股东，是 3 Crowns 开户文件的签字人，目前仍受雇于 Lim。值得注意的是，NYMEX 商业行为委员会在 2019 年 7 月 16 日的一项纪律处分 (NYMEX 16-0524-BC) 中曾永久禁止 Pang 在 CME Group 的所有交易所中交易。

这些不配合行为严重削弱了市场监管部调查持续可疑行为的能力。因此，市场监管部不相信 Tian、3 Crowns、Yeo、Pang、T. Lim 和 M. Lim 可以继续经营或开展业务，而不损害 CME Group 市场的完整性。

基于以上事实，可以作出善意的决定，即有充分的理由相信这种即刻采取的措施对于保护交易所和市场的最佳利益是必要的。

禁市： 根据第 413 条规则，禁市有效期为 60 天，从以下生效日期开始，持续到 2020 年 1 月 16 日（含），除非首席监管官或其代表发出书面通知，将禁市期限延长。

生效日期： 2019 年 11 月 18 日