

芝加哥商品期货交易所 纪律处分通告

文件编号: [CBOT-16-0483-BC](#)

非会员: **Sumitomo Mitsui Trust Bank, Limited**

CBOT 相关规则: **规则 432.W. 一般违规**

任何当事人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，即属违规。

规则 534 禁止洗售交易

任何人如明知或理应知道订单之目的在于避免承担暴露于市场风险的真实市场头寸（此类交易通常被称为洗售交易），则不得在同一商品与同一到期月份（针对期权则为同一履约价格），下达或接受买卖订单。针对具有共同实质所有权之不同账户所输入的买进与卖出订单，若其意图在于抵消市场风险或价格竞争，亦应被视为违反禁止洗售交易之规定。

调查结果:

依据和解提议，Sumitomo Mitsui Trust Bank, Limited（以下称「SMTB」）对作为处罚基础的违规活动既不承认也不否认，CBOT 商业行为委员会的小组于 2018 年 3 月 14 日裁定，在 2016 年 2 月期间的四个交易日中，SMTB 东京分行的一名交易员在 Globex 上的多个 CBOT 美国国债期货市场执行了大量交易，而这些交易买卖双方的账户实质所有权皆属于 SMTB。这些交易的目的是在 SMTB 的多个账户之间移转头寸。该交易员现已了解，此类型的交易应透过后台头寸移转来执行。小组亦裁定，在发生这些交易当时，SMTB 未能尽责地训练与监督其交易员，以确保其行为符合交易所规则。在这些交易发生后，SMTB 已采取了补救与训练措施。

小组结论为，SMTB 因此违反了 CBOT 规则 432.W. 与规则 534。

处罚:

依据和解提议，小组命令 SMTB 支付 105,000 美元的罚款。

生效日期:

2018 年 3 月 16 日