

芝加哥商品交易所

立即撤銷連線存取權限公告 (NOTICE OF SUMMARY ACCESS DENIAL)

檔案編號: [CME-18-0856](#)

非會員: **HANA FINANCIAL INVESTMENT**

CME 相關規則: **規則 413. 立即撤銷連線存取權限處分 (部分節錄)**

413.A. 撤銷連線存取權限之職權

首席監管官 (Chief Regulatory Officer) 或其授權代表, 在基於善意判定有充分理由相信為了保護交易所的最佳利益而必須立即採取行動時, 得下令: 1) 撤銷任何當事人存取任何或所有 CME 集團市場之權限; 2) 撤銷任何當事人存取 Globex 平台之權限; 3) 撤銷任何當事人存取任何由 CME 集團擁有或控制的其他電子交易或結算平台之權限; 或 4) 立即將任何會員驅離任何由 CME 集團擁有或控制的交易大廳。

調查結果:

2018 年 5 月 21 日, CME 集團市場監管部透過其首席監管官, 立即撤銷 Hana Financial Investment (以下簡稱「Hana」) 直接與間接存取所有 CME 集團市場的權限, 這包含 CME Globex 電子交易平台 (Globex)、任何由 CME 集團擁有或控制的其他電子交易或結算平台, 以及所有由 CME 集團擁有或控制的交易大廳。此立即撤銷連線權限的處分, 禁止 Hana 以及任何透過 Hana 帳戶的人員, 在任何 CME 集團交易所商品中進行交易、委託下單, 以及控制或指示任何個人、實體或帳戶進行交易。儘管有上述規定, 針對 Hana 在其結算會員公司的未平倉部位, 結算會員公司得應 Hana 或 Hana 客戶的請求進行平倉。

對 Hana 實施立即撤銷連線存取權限處分之依據如下: 自 2017 年 5 月起至目前為止, 在涉及 Hana 客戶帳戶的多起調查過程中, Hana 提供了市場監管部關於帳戶所有權、授權交易員、審計追蹤紀錄 (audit trail data) 以及對帳單等不完整、不準確、虛假且具誤導性的資訊。Hana 的行為嚴重阻礙了市場監管部針對各項交易所商品中涉及幌騙 (spoofing)、破壞性的交易 (disruptive trading) 與資金移轉活動 (money pass activity) 的數項調查。

市場監管部進一步觀察到, 在多家結算會員公司開立綜合帳戶 (omnibus accounts) 的 Hana, 在各項交易所商品中, 不當且不準確地將獨立擁有與控制的不同客戶帳戶之間部位進行淨額結算 (netted positions), 隨後每日向其結算會員公司申報這些淨額部位。這種做法可能導致其結算會員公司未能履行規則 960 的義務, 亦即未能於其紀錄中如實反映綜合帳戶所持有的總多頭與空頭部位。而結算會員公司隨之向交易所申報了不準確的每日多空部位, 這可能影響了未平倉合約 (open interest) 的申報數據。鑑於 Hana 先前未能準確識別帳戶所有人與授權交易員, 市場監管部無法確信 Hana 能在不危及 CME 集團市場誠信的情況下繼續營運或開展業務。

上述情況支持了基於善意所做出的判定, 亦即有充分理由相信必須立即採取此行



動，以保護各交易所及市場的最佳利益。

撤銷連線存取權限期間： 依據規則 413，此連線權限撤銷處分將於下方生效日期起生效，為期 60 天，持續至 2018 年 7 月 20 日止（含）。除非首席監管官或其授權代表發出書面通知，延長此撤銷連線存取權限之時間，否則將依此期限執行。

生效日期： 2018 年 5 月 21 日