

## 芝加哥商品交易所 紀律處分通告

檔案編號: [CME 22-1592-BC](#)

非會員: **Jaeho Lee**

CME 相關規則: 規則 539.A. 禁止預先安排、事前協商與非競爭性的交易（部分節錄）

任何人不得預先安排或事前協商任何買賣，或以非競爭性的方式執行任何交易。

規則 576. Globex 終端機操作員之身分識別（部分節錄）

每個人都必須使用專屬的操作員識別碼（Operator ID）來登入 Globex 系統。在任何情況下，任何人皆不得使用非其本人專屬的操作員識別碼來輸入委託單，或允許他人使用非其專屬的識別碼來輸入委託單。

調查結果: 根據 Jaeho Lee 提出的和解提議，Lee 對作為處分依據的違規活動或調查結果既不承認也不否認，CME 商業行為委員會小組（以下簡稱「小組」）於 2023 年 12 月 14 日裁定：在 2022 年 2 月 8 日至 2022 年 4 月 14 日期間，Lee 在 E-mini 那斯達克 100 期貨選擇權（E-mini Nasdaq-100 options on futures）市場中，曾多次預先安排執行大量交易。

具體而言，Lee 藉由協調自己帳戶與其妻子帳戶中的委託單輸入，以確保自己的委託單與妻子在其他帳戶中輸入的委託單進行反向對沖交易。該小組同時發現，Lee 使用了非其本人的專屬操作員識別碼來輸入委託單。

因此，小組認定 Lee 的行為違反了 CME 規則 539.A. 與 576。

處罰: 依照和解提議內容，小組命令 Lee 就本案及關聯案件（NYMEX 22-1592-BC 及 CBOT 22-1592-BC）支付總計 15,000 美元的罰款（其中 5,000 美元分配給 CME）。

此外，小組亦對 Lee 處以 10 個營業日的交易暫停之處分，禁止其進入任何由 CME 集團擁有或控制的交易大廳，並禁止其直接或間接進入任何由 CME 集團擁有或控制的指定契約市場、衍生性商品結算機構或交換交易設施。交易暫停期間自交易日 2023 年 12 月 18 日起，至 2024 年 1 月 2 日止（含）。

生效日期: 2023 年 12 月 18 日