

## 紐約商品交易所 紀律處分通告

檔案編號: [COMEX 22-1537-BC-2](#)

非會員: **JINGYOU INTERNATIONAL TECHNOLOGY LTD.**

COMEX 相關規則: **規則 539 禁止預先安排、預先協商及非競爭性的交易(節錄)**

### **539.A. 一般禁止規定**

任何人不得預先安排或預先協商任何買賣，或以非公開競價方式執行任何交易。

### **規則 534 禁止洗售交易**

任何人不得在同一商品和同一到期月份（或者就賣權或買權而言在同一履約價格），下達或接受買單與賣單，如果該人知道或理應知道這些訂單的目的是為了避免承擔暴露於市場風險的真實市場部位（此類交易通常被稱為洗售買賣）。為具有共同實質所有權的不同帳戶下達買單與賣單，且其意圖為抵銷市場風險或價格競爭者，亦將被視為違反禁止洗售交易的規定。此外，任何人不得透過直接或間接方式，故意執行或協助執行此類訂單。

### **規則 432 一般違規行為（節錄）**

下列行為即屬違規：

W. 任何一方未能善盡監督其員工及代理人從事與交易所相關業務之責。

調查結果:

根據和解提議，JINGYOU INTERNATIONAL TECHNOLOGY LTD. 既未承認也未否認處罰所依據的違規行為，2023 年 11 月 15 日，COMEX 商業行為委員會小組裁定，在 2021 年 7 月 27 日至 2021 年 9 月 7 日期間，一名 JINGYOU INTERNATIONAL TECHNOLOGY LTD. 的交易員代表該公司擁有的一個帳戶，在鋁期貨市場的同一商品與到期月份下達了買單與賣單，目的是為了測試公司的交易系統以確保交易能被正確分配。該交易員知道或理應知道這些訂單的目的是為了避免承擔暴露於市場風險的真實市場部位。

該小組進一步裁定，在 2021 年 9 月 27 日和 2021 年 9 月 28 日，JINGYOU INTERNATIONAL TECHNOLOGY LTD. 的員工在鋁期貨日曆價差市場中，預先安排了該公司擁有之帳戶與一名公司員工擁有之帳戶之間的交易。這些交易的目的同樣是為了測試公司的交易與分配系統。來自這些預先安排交易的成交量，促使該公司達到了交易所鋁市場莊家（造市商）計畫所要求的門檻，並因此獲得了 4,000 美元的津貼。

小組亦裁定，在 2021 年 7 月至 2021 年 9 月期間，JINGYOU INTERNATIONAL TECHNOLOGY LTD. 未能善盡監督其員工之責，未提供關於 COMEX 規則的充分合規培訓或教育材料，且未能善盡監督其員工之交易，以確保遵守 COMEX 關於洗售交易與非競爭性的交易的規定。



**處罰:** 依照和解提議，小組命令 JINGYOU INTERNATIONAL TECHNOLOGY LTD. 支付 25,000 美元的罰款，並繳回 4,000 美元的非法所得。

**生效日期:** 2023 年 11 月 17 日