

## 紐約商業交易所 紀律處分通告

檔案編號: [NYMEX 16-0532-BC](#)

非會員: **KOREA INVESTMENT & SECURITIES CO., LTD.**

NYMEX 相關規則: **規則 432 一般違規事項 (General Offenses)**

下列行為屬違規:

W. 任何當事人未能盡責監督其員工與代理人從事與交易所相關之業務行為。

### **規則 539.C 關於 Globex 交易之執行前通訊 (Pre-Execution Communications Regarding Globex Trades)**

當事人可就 Globex 平台上執行之交易進行執行前通訊，當一方（第一方）希望確保對手方（第二方）將採取委託單之相反部位時，應在下列情況下進行：

#### **C.3. 允許的委託單輸入方式**

##### **a. Globex 交叉交易（「G-Cross」）**

第一方的委託單須先輸入至 Globex 平台。在第一筆委託單輸入後經過 5 秒鐘之前，不得將第二方的委託單輸入至 Globex 平台。

### **規則 576 Globex 終端機操作員之身分識別 (Identification of Globex Terminal Operators)**

每位 Globex 終端機操作員皆應以交易所規定之方式向交易所表明身分，並受交易所規則之規範。若規定操作員 ID 須向交易所註冊，結算會員有義務確保註冊資訊隨時保持最新且準確。每位個人必須使用專屬的唯一操作員 ID 才能連線至 Globex。在任何情況下，任何人都不得使用非其本人專屬的操作員 ID，或允許他人使用非其本人專屬的操作員 ID 來輸入委託單。

調查結果: 依據 Korea Investment & Securities Co., Ltd.（以下稱「KIS」）於 2017 年 12 月 4 日聽證會上提出的一項和解提議，KIS 在該提議中對作為處罰基礎的違規活動既不承認也不否認，NYMEX 商業行為委員會小組裁定，在 2016 年 2 月 1 日至 2016 年 5 月 31 日期間的多個場合中，KIS 交易員在進行執行前通訊後，於 Globex 上交叉撮合了多筆原油期貨委託單，卻未在委託單下單之間等待規定的五秒鐘。KIS 未能妥善監督其交易員，因 KIS 對交易所規則並不熟悉，且未能向其交易員提供任何有關交易所規則的合規培訓或教育訓練教材。此外，KIS 未能確保其連線至 Globex 系統之交易員的 TAG 50 註冊資訊保持最新、準確，且未確保使用 Globex 的每位個人皆有專屬的唯一 ID，因為其交易員使用了註冊於不同使用者名下的 TAG 50 ID 來輸入這些委託單。

小組裁定，由於前述行為，KIS 違反了規則 432.W.、規則 539.C. 與規則 576。



**處罰：** 依據和解提議，BCC 小組命令 KIS 支付 65,000 美元的罰款。

**生效日期：** 2017 年 12 月 6 日