

紐約商業交易所 紀律處分通告

檔案編號: [NYMEX 17-0646-BC-1](#)

非會員: **FUJI FUTURES 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。

調查結果: 依據 Fuji Futures Co., Ltd. (以下稱「Fuji Futures」) 於 2018 年 6 月 12 日聽證會上提出的一項和解提議, Fuji Futures 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 (以下稱「BCC 小組」) 裁定, 在 2016 年 4 月至 2017 年 3 月期間的多個交易日中, Fuji Futures 僱用的一名交易員在開盤前時段於 Globex 電子交易平台上, 在多個原油、亨利港天然氣 (Henry Hub Natural Gas, 簡稱「天然氣」) 與白金期貨合約中輸入委託單, 其目的為探測委託簿的市場深度。該交易員輸入與取消這些委託單的行為, 導致了公開顯示的開盤前指示性價格 (Indicative Opening Price) 發生波動。BCC 小組亦裁定, 在此期間, Fuji Futures 未能向其交易員提供關於交易所規則與規範的指示或指導 (特別是關於破壞性交易行為的規範), 亦未能監督其交易員的交易活動以確保其符合交易所規則。

BCC 小組結論為, Fuji Futures 違反了交易所規則 432.W。

處罰: 依據和解提議, BCC 小組命令 Fuji Futures 就本案及相關聯案件 COMEX 17-0646-BC 支付總額 45,000 美元的罰款 (其中 35,000 美元分配給 NYMEX)。

生效日期: 2018 年 6 月 14 日