

## 紐約商業交易所 紀律處分通告

---

**檔案編號:** [NYMEX 17-0646-BC-2](#)

**非會員:** **SHINGO YAMAMOTO**

**NYMEX 相關規則:** **規則 575.A. 禁止破壞性的交易行為**

任何人在下單時，若意圖在成交前取消該委託，或修改該委託以避免成交，皆不得下達或促使他人下達該委託單。

**調查結果:** 根據 Shingo Yamamoto（下稱「Yamamoto」）於 2018 年 6 月 12 日聽證會上提出的和解提議，Yamamoto 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 8 月至 2017 年 3 月的多個交易日間，Yamamoto 為了探測委託簿深度，於開盤前時段在 Globex 電子交易平台上，下達了多筆原油、亨利港天然氣（「天然氣」）及鉑金期貨合約的委託單。這些委託單的下達與取消，導致了公開顯示的開盤前指示性價格 (Indicative Opening Price) 產生波動。

據此，BCC 小組裁定 Yamamoto 違反了 NYMEX 規則 575.A.（禁止破壞性的交易行為）。

**處罰:** 依照和解提議，BCC 小組命令 Yamamoto 針對本案及關聯案件 COMEX 17-0646-BC 支付共計 25,000 美元的總罰款（其中 20,000 美元的罰款分配給 NYMEX），並處以 20 個工作日的交易暫停處分，禁止其：(1) 申請任何芝商所集團旗下交易所的會員資格；(2) 進入任何芝商所集團的交易大廳；及 (3) 直接和間接使用所有由芝商所集團擁有或控制的電子交易與結算平台，包含 CME Globex。停權期間自 2018 年 6 月 14 日起，至 2018 年 7 月 12 日（含）止。

**生效日期:** 2018 年 6 月 14 日