

此为所附《市场规范建议通告》（Market Regulation Advisory Notice）（“MRAN”）英文原文之译本；正式文本为 MRAN 英文版。尽管我们已尽合理努力提供准确翻译，但若对 MRAN 译本所提供信息有任何疑问，请查阅 MRAN 英文版。任何由于翻译造成之差异或分歧不具约束力且无法律效力。

市场监管建议通告

交易所	芝加哥商交易所（CME）、芝加哥商品期货交易所（CBOT）、纽约商业交易所（NYMEX）和纽约商品交易所（COMEX）
主题	账户间非法资金转移
规则参考	规则 432
建议日期	2011 年 4 月 27 日
建议编号	芝商所 RA1101-5

2010 年 11 月 29 日，CME、CBOT、NYMEX 和 COMEX 实施了修订后的规则 432（“一般违规行为”），额外澄清了市场参与者为在账户间转移资金而预先安排交易执行属于违规行为（参见 2010 年 11 月 18 日的 [SER-5481](#)）。此项禁止适用于在芝商所各交易所的竞价交易场所上执行的交易以及经双边协商并提交到 CME 清算所的交易。

在交易所市场上执行并提交清算的所有交易必须是为了执行真实的交易而进行，为了实现将资金从一个账户转移到另一个账户而预先安排的交易被明令禁止。市场监管部将会审核对手方之间有了在账户之间转移权益而预先安排交易之迹象的配对回合交易，违反规则 432.G 将会导致纪律处分。

关于本建议通告若有问题，可以联系市场监管部的下列人员：

Greg Benbrook, 调查总监, 电话: 312.341.7619

Robert Sniegowski, 规则与监管拓展执行总监, 电话: 312.341.5991

Erin Middleton, 规则与监管拓展主管专员, 电话: 312.341.3286

芝商所 RA1006-5
2010年6月11日
第 2/2 页

有关本建议通告的媒体垂询，请联系芝商所公司传讯部，电话： 312. 930. 3434 或 news@cmegroup.com。