

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	芝加哥商品交易所（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	在CME Globex 开市前的输入委托
规则参考	规则573
建议日期	2017年10月18日
建议编号	芝商所RA1715-5
生效日期	2017年11月2日

最近，市场参与者请求指导当其想要按开盘价交易时如何妥当地在CME Globex开市前期间处理和/或输入委托。

提醒市场参与者，CME Globex（“Globex”）不支持输入开盘市价（“MOO”）委托。因此，市场参与者不得向有资格处理客户委托的经纪人或其他方下达此种委托以作输入，且任何一方不得接受此种委托。

关于有资格输入Globex之委托类型的信息可通过以下链接找到：

<https://www.cmegroup.com/confluence/display/EPICSANDBOX/Order+Types+for+Futures+and+Options>

希望向有资格在Globex开市之前处理客户委托的经纪人或其他方必须为该委托指示具体价格或下达DRT（免负责订单）委托。DRT委托由委托处理方全权负责委托执行的价格和时间，包括有权执行全部、部分委托或全部不执行。

在开市前期间以显著高于和/低于所显示指示性开盘价格（“IOP”）的价格输入委托的任何一方必须认识到此种委托有可能会在IOP期间造成异常价格变动，并提醒，如果出现这样的异常价格变动，则此活动可能会被视为违反规则575（“禁止扰乱市场行为”）。此外，市场参与者应准备好并能够处理按其或其经纪人输入CME Globex的价格充分执行其委托后所带来的财务义务。

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：

芝商所RA1714-5

2017年9月18日

第2页，共2页

Natasha Selkov, 主管调查员, 312.341.7623

Colin Garvey, 经理, 调查部, 312.435.3656

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

Shawn Tan, 规则与监管拓展高级专员, 电话: +65 6593 5580

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。