

제재조치 공지

CBOT 22-1595-BC-2
발효일: 2024년 12월 23일

문서번호: [CBOT 22-1595-BC-2](#)

회원여부/회원: **Kamal Kasera**

CBOT 규정위반: **규정 575. 시장 교란 행위 금지 (일부)**

모든 주문은 반드시 진실된 거래를 실행할 목적으로 입력해야 한다. 또한, 모든 실행 불가 메시지는 정당한 목적으로 선의에 의해 입력해야 한다.

A. 어떠한 사람도 주문 입력 시점에 해당 주문이 실행되기 전에 취소하거나, 실행을 피하기 위해 해당 주문을 수정할 의도를 갖고 주문을 입력하거나 입력되도록 하여서는 안 된다.

조사결과: Kamal Kasera가 아래 제재의 근거가 되는 규정 위반에 대해 인정도 부정도 하지 않고 제시한 합의안에 따라, 2024년 12월 19일, CBOT 영업행위위원회 (“위원회”)은 2022년 2월 3일부터 2022년 7월 5일 사이의 기간 동안 프랍트레이딩회사에 고용되어 있던 Kasera가 1회 이상의 경우에 2년물 국채 (2-Year Treasury Note), 5년물 미 국채 (5-Year Treasury Note), 10년물 미 국채 (10-Year Treasury Note), 울트라 10년물 미 국채 (Ultra 10-Year U.S. Treasury Note), 미 국채 (U.S. Treasury Bond), 초장기 미 국채 (Ultra U.S. Treasury Bond) 선물 시장에서 동일한 또는 상관 관계가 높은 국채 선물 시장에서의 주문이 체결되면, 주문 입력 시점에 주문이 체결되기 이전에 취소하거나 주문 체결을 피할 목적으로 주문을 수정할 의도를 가지고 주문을 입력한 것을 확인하였다. 구체적으로, Kasera는 하나 또는 이상의 소량의 주문이 같은 시장 또는 상관 관계가 높은 선물 시장에 대기 중인 상황에, 하나의 국채 선물 시장에서 그 반대 방향에 큰 수량의 주문을 입력하였다. 하나의 소량 주문 또는 다수의 소량 주문이 체결된 이후, 이 직원은 대량 수량 주문을 전량 취소하였다.

전술한 내용의 결과로 위원단은 Kasera가 CBOT 규정 575.A.를 위반한 것으로 판단하였다.

제재내용: 합의안에 의거하여, 위원단은 Kasera에게 \$75,000의 벌금 지불을 명하였으며, CME Group이 소유 또는 통제하는 모든 트레이딩플로어 및 CME Group이 소유 또는 통제하는 지정계약시장, 파생상품청산기관 또는 스왑체결시설에의 직간접적 접근을 15영업일 간 중지하였다. 접근 중지는 2024년 12월 23일 거래일부터 시작되며 2025년 1월 14일 거래일까지 (당일 포함) 지속된다.



발효일:

2024 년 12 월 23 일