



약식 시장접근 중지 공지

CME-18-0856
발효일: 2018년 5월 21일

문서번호: [CME-18-0856](#)

회원여부/비회원: 하나금융투자

CME 규정: **413. 약식 접근 중지 조치 (일부)**

413. A. 접근 중지 권한

최고규제책임자 또는 그의 대리인은 거래소의 최선의 이익을 보호하기 위해 즉각적인 조치가 필요하다고 믿을 만한 상당한 근거가 있다고 선의로 판단할 경우 다음과 같은 명령을 내릴 수 있다. 1) 어떤 당사자의 CME 그룹의 일부 또는 모든 시장에 대한 접근 중지, 2) 어떤 당사자의 Globex 플랫폼에 대한 접근 중지, 3) CME 그룹이 소유하거나 관리하는 여타 전자거래 또는 청산 플랫폼에 대한 어떤 당사자의 접근 중지, 또는 4) CME 그룹이 소유하거나 관리하는 트레이딩플로어에서 회원의 즉시 퇴장.

조사결과: 2018년 5월 21일, CME 그룹 시장규제부(이하 “시장규제부”)는 최고규제책임자를 통해 CME Globex 전자거래플랫폼(이하 “Globex”), CME 그룹이 소유 또는 관리하는 모든 여타 전자거래 혹은 청산플랫폼, CME 그룹이 소유 또는 관리하는 모든 트레이딩플로어 등을 포함하여 모든 CME Group 시장에 대한 하나금융투자(이하 “하나”)의 직간접적인 접근을 즉각적으로 중지하였다. 이러한 시장접근 중지 조치로 하나 및 하나의 계좌를 통한 그 누구도 모든 CME Group 거래소 상품에 대해 모든 개인, 법인, 또는 계좌를 위한 매매, 주문 입력 및 거래 관리 및 지시가 금지된다. 전술한 내용에도 불구하고, 하나측 청산회사에 보유된 미결제약정은 하나 또는 하나의 고객의 요청이 있을 시, 해당 청산회사에 의해 청산처리가 가능하다.

하나에 대한 시장접근 중지 조치는 다음의 사실에 근거한다. 적어도 2017년 5월부터 현재에 이르기까지 하나의 고객 계좌와 관련된 다수의 조사 과정에서, 하나는 시장규제부에 계좌 소유권, 계좌의 거래권한자, 감사추적 데이터, 거래명세서와 관련하여 불완전하고, 부정확하고, 잘못된, 허위 정보를 제공하였다. 하나의 행위는 다수의 거래소 상품에서의 스포핑(주문 집행 전에 취소할 의도를 가지고 매수 또는 매도 주문을 내는 행위), 시장질서 교란행위 및 계좌간 불법 이전 활동과 관련한 시장규제부의 여러 조사 활동을 중대하게 방해하였다.

더 나아가, 시장규제부는 여러 청산회사에 옴니버스 계좌를 보유 중인 하나가 다양한 거래소 상품에서 각각 독립적으로 소유 및 관리되고 있는 별개의 고객 계좌들 간 보유약정(포지션)을 부적절하고 부정확하게 상계처리한 후, 순보유약정만을 하나의 청산회사들에 일일 보고했다는 사실을 확인하였다. 이러한 관행으로 인해 하나의 청산회사들은 옴니버스 계좌의 총 매수 및 매도



포지션을 기록에 반영하도록 하는 거래소 규정 960에 따른 의무를 준수하지 못했을 것으로 간주된다. 이에 따라 청산회원사들은 부정확한 일일 매수 및 매도 포지션을 거래소에 보고하게 되었고, 결과적으로 미결제약정 보고에 영향을 미쳤을 것으로 간주된다. 하나가 이미 계좌 소유자 및 계좌의 거래 권한자를 정확하게 파악하는 데 실패했던 점을 감안할 때, 시장규제부는 하나가 CME Group 시장의 무결성을 위해하지 않으면서 운영 및 영업을 지속할 수 있을지에 대해 확신할 수 없다.

전술된 사항들은 거래소와 시장을 보호하기 위해 즉각적인 조치가 필요하다는 선의의 결정을 내리는 데 있어 충분한 근거 사유로 판단된다.

시장접근 중지 조치: CME Group 규정 제 413에 의거하여 하나금융투자에 대한 시장접근 중지 조치는 CME 그룹의 최고규제책임자 또는 그 대리인이 기한 연장을 서면으로 통보하지 않는 한 60 일 동안 유지되며, 아래 발효일로부터 2018년 7월 20일까지 (당일 포함) 유효하다.

발효일: 2018년 5월 21일