



제재조치 공지

COMEX 16-0495-BC

발효일: 2018년 6월 14일

문서번호: [COMEX 16-0495-BC](#)

회원여부/비회원: **WEIHAO HUANG**

거래소 규정: **규정 575.A. 시장 교란 행위 금지**

모든 주문은 반드시 진실된 거래를 실행하는 목적으로 입력해야 한다. 또한, 모든 실행 불가능한 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: 2018년 6월 12일 심리에 Weihao Huang ("Huang")이 아래 제재의 근거가 되는 규정 위반에 대해 인정도 부정도 하지 않고 제안한 합의안에 따라, COMEX 영업행위위원회 위원단 ("BCC 위원단")은 2016년 7월의 여러 날에 Huang이 거래할 의사 없이 구리, 은 및 금 선물 시장에서 주문을 입력하고 취소하는 행위로 이루어진 거래 전략을 사용한 것으로 판단하였다. 구체적으로, Huang은 시장 한 편에 본인의 작은 수량의 주문을 체결되도록 하기 위해 시장 반대편에 대량의 주문을 제출하였다. 작은 수량의 주문이 체결된 후, Huang은 단 몇 초 만에 반대편에 대량의 주문을 취소하였다. 이러한 행위로 인하여 Huang은 \$6,447.10의 이익을 실현하였다.

본 위원단은 위의 결과로 Huang이 거래소 규정 575.A.를 위반한 것으로 판단하였다.

제재내용: 해당 합의안에 의거하여, 위원단은 Huang에게 1) \$25,000의 벌금, 2) 영업일 기준으로 20일간 모든 CME Group Inc. 트레이딩플로어 접근 및 CME Globex를 포함하여 CME Group이 소유하고 통제하는 모든 전산 거래 및 청산 플랫폼에 대한 직간접적 접근 중지, 및 3) \$6,447.10의 이익 환수를 명하였다. 접근 중지 기간은 2018년 6월 14일에서 7월 12일까지 (당일 포함)이다.