

제재조치 공지

COMEX 21-1494-BC
발효일: 2024년 8월 5일

문서번호: [COMEX 21-1494-BC](#)

회원여부/비회원: 이 XX

COMEX 규정위반: 규정 575. Disruptive Practices Prohibited (in part)

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

B. 어떠한 사람도 다른 시장 참가자들을 오도할 의도로 실행 가능 또는 실행 불가 메시지(들)를 입력하거나 입력되도록 하여서는 안 된다.

규정 432. 일반 위반 (일부)

L. 2. 그러한 청문회나 일체의 조사와 관련한 모든 질문에 충분히 응답하지 않거나, 모든 장부와 기록을 제출하지 않거나, 허위 진술을 하는 행위

조사결과: 2023년 12월 11일, 최고규제책임자는 2021년 6월 18일에서 2021년 9월 28일 사이에 수 차례에 걸쳐 다른 시장 참가자를 오도하여 유리한 가격을 얻으려는 의도로 다양한 구리, 은 및 금 선물 시장에서 실행가능 메시지를 입력하였다는 주장에 근거하여 이 XX 이 COMEX 규정 575.B. 및 432.L.을 위반하였다는 혐의를 제기하였다. “이”는 시장의 양 방향에 다양한 가격에 다양한 수량의 주문을 쌓았다 (layer). 그녀는 시장의 한 방향에 주문장의 상위 레벨에 계약 수량의 불균형을 형성하기 위하여 그 주문들을 수정하였다. “이”는 시장 참가자들이 반대 방향에 대기중인 자신의 작은 수량의 주문을 대상으로 거래하도록 유도하기 위하여 매수 압력과 매도 압력을 번갈아 가며 형성하는 주문을 입력하고 수정하는 패턴을 보였다. 이러한 불균형은 시장 참가자들이 그녀의 반대 방향 또는 같은 방향 모두에 주문을 입력하거나 수정한 주문을 대상으로 거래하도록 유도하였다. 나아가, 위원단은 “이”가 시장규제부의 이러한 행위에 대한 조사와 관련한 질문에 완전히 답하는 데에 실패하였다고 판단하였다.

2024년 7월 16일, COMEX 영업행위위원회 (“BCC”) 심리 위원장은 우선 “이”가 자신에 대해 제기된 혐의에 대해 서면 답변을 제출하는 데에 실패하여 제소 사항을 인정한 것으로 간주된다고 판단하였다. 따라서 “이”는 본 안에 대한 심리에 대한 권리를 포기하였다.



COMEX 규정 408.F.에 의거하여 BCC 위원단은 “이”가 인정된 혐의에 대한 책임이 있는 것으로 판단하고 이후 제재 심리를 진행하였다.

제재내용:

기록 및 위원단의 판단에 근거하여, 위원단은 “이”에게 \$100,000의 벌금 (이중 \$50,000이 COMEX에 배정)을 명령하였다. 위원단은 또한 “이”에게 CME Group이 소유 또는 통제하는 모든 트레이딩플로어에의 직접적 접근 및 CME Group이 소유 또는 통제하는 지정계약시장, 파생상품청산기관 또는 스왑체결시설에의 직간접적 접근을 영구적으로 금지하였는데, 이는 아래 발효일로부터 시작된다.

발효일:

2024년 8월 5일