

제재조치 공지

COMEX 23-1702-BC
발효일: 2024년 10월 14일

문서번호: [COMEX 23-1702-BC](#)

회원여부/비회원: 이 XX

COMEX 규정위반: **575.B. 시장 교란 행위 금지**

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

432.L.1. 일반 위반

이사회, 거래소 직원 또는 일체의 조사위원회 또는 적절한 절차에 따라 소집된 청문위원회, 예정된 직원 인터뷰, 혹은 일체의 조사에 출두하지 않는 행위는 위반 행위이다.

조사결과: 2024년 5월 22일, 시장규제부의 최고규제책임자는 이 XX 이 2023년 8월 14일부터 2023년 9월 6일까지의 기간 동안 다른 시장 참가자를 호도하기 위하여 구리, 은, 및 금 선물 시장의 양 방향에 다양한 수량의 주문을 쌓았다(layer)는 주장에 근거하여 규정 575.B. 및 432.L.1 을 위반하였다는 혐의를 제기하였다. 이 XX 이 시장의 한 방향에 주문을 입력하거나 주문을 수정했을 때, 다른 시장 참가자들이 반대 방향에서 “이”의 대기중인 주문에 거래를 하거나 “이”의 주문에 앞서 시장을 개선하는 주문을 입력하였는데, 이는 “이”가 레이어링한 주문 이전에 가능했던 가격보다 보다 나은 가격에 “이”가 공격적 주문을 할 수 있도록 하였다. 그의 대량의, 레이어링한 수량의 주문에 대한 시장의 초기 반응 이후 “이”는 이러한 주문 입력 및 시장 반대 방향의 주문 수정 패턴을 반복하였다. 구리, 은, 및 금 선물 시장에서의 “이”의 높은 주문 수정률, 주문의 큰 규모는 그가 이러한 주문들을 입력한 속도 및 빈도와 함께 다른 시장참가자를 오도하는 시장 변동성을 초래하였다. 이러한 규정 위반의 결과로, “이”는 \$21,920 의 이익을 얻었다. “이”는 본 조사와 관련하여 거래소 직원과의 예정되었던 인터뷰에 참석하지 않았다.

2024년 9월 25일, COMEX 영업행위위원회 (“BCC”)의 심리 위원장은 우선 “이”가 그에 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. 규정 408.F.에 의거하여, BCC 위원단은 “이”에게 인정된 혐의에 대한 책임이 있는 것으로 판단하고 이후 제재 심리를



진행하였다.

제재내용:

기록 및 위원단의 판단에 근거하여, 위원단은 본 건과 연계 건인 CME, CBOT 및 NYMEX 23-1702-BC 와 관련하여 “이”에게 총 \$120,000 의 벌금을 부과하였으며 (이중 \$25,000 이 COMEX 에 배정), 총 \$260.708.50 의 이익 환수 (이중 \$21,920 이 COMEX 에 배정)를 명하였다. 또한 위원단은 “이”에게 CME Group 이 소유 또는 통제하는 모든 트레이딩플로어에의 직접적 접근 및 CME Group 이 소유 또는 통제하는 지정계약시장, 파생상품청산기관 또는 스왑채결시설에의 직간접적 접근을 영구적으로 금지하였다.

발효일:

2024 년 10 월 14 일