

## 약식 시장접근 중지 통보서

# CME-18-0856

발효일: 2018년 5월 21일

대상: 하나금융투자

**CME 규정: 413조 약식 시장접근 중지 조치(부분 발취)**

### 413조 A항 시장접근 중지 조치에 대한 권한

CME그룹의 최고규제책임자 또는 그의 대리인은 거래소를 보호하기 위해 필요한 즉각적인 조치를 취함에 있어 충분한 근거가 있다고 선의의 판단을 할 경우 다음과 같은 명령을 내릴 수 있다. 1) CME그룹의 일부 또는 모든 시장 접근 중지 2) Globex 플랫폼 접근 중지 3) CME그룹이 보유/관리하고 있는 여타 전자거래 또는 청산 플랫폼 접근 중지 4) CME그룹이 보유/관리하고 있는 시장플로어에서 즉시 퇴장.

### 조사 결과:

2018년 5월 21일, CME그룹의 시장규제부(이하 "시장규제부")는 최고규제책임자를 통해 CME Globex 전자거래플랫폼(이하 "Globex"), CME그룹이 보유 또는 관리하는 모든 여타 전자거래 혹은 청산플랫폼, CME그룹이 보유 또는 관리하는 모든 시장플로어 등을 포함하는 모든 CME Group 시장에 대한 하나금융투자(이하 "하나")의 직접 및 간접적인 시장접근을 즉각적으로 중단하였다. 이러한 시장접근 중지 조치로 하나 및 누구든 하나의 계좌를 통해서는 모든 CME Group 거래소 상품에서 모든 개인, 법인 등 독립체, 또는 계좌를 위한 매매거래, 주문 및 매매거래에 대한 관리 및 지시가 금지된다. 앞서 언급된 사항에도 불구하고, 하나측 청산회원사의 미결제보유약정은 하나 또는 하나의 고객의 요청 있을 시 해당 청산회원사에 의해 청산처리가 가능하다.

하나에 대한 시장접근 중지 조치는 다음의 사실에 기반한다. 적어도 2017년 5월부터 현재에 이르기까지 하나의 고객 계좌와 관련된 다수의 조사 과정에서, 하나는 시장규제부에 계좌 소유권, 계좌의 거래권한자, 감사추적을 위한 기록자료 및 계좌활동 기록자료와 관련해 불완전하고, 부정확하며, 잘못된, 허위 정보를 제공하였다. 하나의 행위는 다수의 거래소 상품에서의 스푸핑(주문 집행 전에 취소할 의도를 가지고 매수 또는 매도 주문을 내는 행위), 시장질서교란행위 및 자금 이전 활동과 관련한 시장규제부의 여러 조사 활동을 중대하게 방해하였다.

더 나아가, 시장규제부는 여러 청산회원사에 옴니버스 계좌를 보유 중인 하나가, 다양한 거래소 상품에서 각각 독립적으로 소유 및 관리되고 있는 고객 계좌들 간에 각 계좌의 보유약정(포지션)을 부적절하고 부정확하게 상계처리한 후, 순 보유약정만을 하나의 청산회원사들에 일일 보고했다는 사실을 목격하였다. 이러한 관행으로 인해 하나의 청산회원사들은 옴니버스 계좌의 총 매수 및 매도 포지션을 기록에 반영해야 하는 거래소규정 제 960조에 따른 의무를 준수하지 못했을 것으로 간주된다. 이에 따라 청산회원사들은 부정확한 일일 매수 및 매도 포지션을 거래소에 보

고하게 되었고, 결과적으로 미결제약정 보고에 영향을 미쳤을 것으로 간주된다. 하나가 이미 계좌 소유자 및 계좌의 공식인증 거래자를 정확하게 파악하는 데 실패했던 점을 감안하면, 시장규제부는 하나가 CME Group 시장의 완전무결성을 위해하지 않으면서 사업을 계속 운영 또는 수행할 수 있을지에 대해 확신을 갖지 못하고 있다.

앞서 언급된 사항들은 거래소와 시장을 보호하기 위해 즉각적인 조치가 필요하다는 선의의 결정을 내리는 데 있어 충분한 근거사유로 판단된다.

#### **시장접근 중지 조치:**

CME Group 규정 제413조에 의거하여 하나금융투자에 대한 시장접근 중지 조치는, CME그룹의 최고규제책임자 또는 그 대리인이 기한 연장을 서면으로 통보하지 않는 한, 발효일로부터 60일 동안 유지되며 2018년 7월 20일까지 유효하다.

###

자료 문의:

**코콤포터노벨리** 김기훈 대표 (02-6925-1507, [kihoon@korcom.com](mailto:kihoon@korcom.com))

변용환 대리 (02-6925-1583, [eric@korcom.com](mailto:eric@korcom.com))