

NEW YORK MERCANTILE EXCHANGE 제재조치 공지

사건 번호: NYMEX 16-0532-BC

비회원: 한국투자증권 (KOREA INVESTMENT & SECURITIES CO., LTD.)

관련 규정: 432. 일반 위반

다음에 해당하는 것은 규정 위반이다:

w. 어느 당사자든지 거래소와 관련된 업무를 행함에 있어 고용인 및 대리인을 상당한 주의를 가지고 감독하지 못한 것.

539.C. Globex 거래 관련 집행 전 의사교환

당사자 일방(첫 번째 당사자)이 자신의 주문에 대해 상대방(두 번째 당사자)이 다음 조건 하에서 해당 주문의 상대 포지션을 취할 거라는 확인을 받고자 할 경우 당사자들은 Globex 플랫폼에서 집행되는 거래에 관하여 거래 집행 전에 의사를 교환할 수 있다:

C.3. 허용되는 주문 입력 방법

a. Globex Cross (“G-Cross”)

첫 번째 당사자의 주문이 Globex 플랫폼에 먼저 입력된다. 두 번째 당사자의 주문은 첫 번째 주문의 입력 시점에서 5초의 시간이 경과할 때까지 Globex 플랫폼에 입력하지 못한다.

576. 단말기 이용자의 신원 확인

각각의 Globex 단말기 이용자는 거래소가 미리 정한 방법에 따라 신원 확인을 받아야 하고, 거래소 규정에 따라야 한다. 거래소에 사용자 ID의 등록이 필요한 경우 해당 등록이 여전히 유효하며 항상 정확하다는 것을 보장하는 것은 관련 청산회원의 의무이다. 각 개인이 Globex에 접근하려면 고유한 사용자 ID를 이용해야 한다. 어떠한 경우에도 누구든지 자신의 고유한 사용자 ID가 아닌 ID를 이용하는 개인의 주문을 입력하거나 그 입력을 허용해서는 안 된다.

**검토 결과:**

제재의 근거가 된 규정 위반에 대해 시인도 부인도 하지 않은 한국투자증권("KIS")이 2017년 12월 4일 청문회에서 밝힌 합의 제안에 따라 NYMEX 영업행위규제위원회 소위원회("BCC Panel")는 2016년 2월 1일에서 2016년 5월 31일 기간 동안 여러 차례 KIS 트레이더들이 집행 전 의사교환 후 자신들의 주문 제출 사이에 필요한 5초를 기다리지 않고 Globex에 복수의 원유 선물 주문을 자전거래한 것을 확인하였다. KIS는 거래소 규정에 익숙하지 않아 자신의 트레이더를 적절하게 감독하지 못했고, 이들에게 거래소 규정 준수에 관한 훈련이나 교육자료를 제공하지 못했다. 또한 KIS는 Globex 시스템에 접근하는 자신의 트레이더들이 다른 사용자로 등록된 TAG 50 ID를 이용하여 해당 주문을 입력했다는 점에서 Globex 시스템에 접근하는 트레이더들의 Tag 50 등록이 Globex 이용자 각 개인에 대해 여전히 유효하고, 정확하며, 고유해야 한다는 점을 준수하지 못했다.

이에 따라 Panel은 KIS가 Rule 432.W., 539.C. 및 576을 위반했다고 확인하였다.

제재 내용:

합의 제안에 따라 BCC Panel은 KIS에게 벌금 \$65,000를 부과했다.

효력발생일:

2017년 12월 6일