

제재조치 공지

NYMEX 17-0646-BC-2
발효일: 2018 년 6 월 14 일

문서번호: [NYMEX 17-0646-BC-2](#)

회원여부/비회원: **SHINGO YAMAMOTO**

거래소 규정: **NYMEX 규정 575.A. 시장 교란 행위 금지**

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: 2018 년 6 월 12 일 심리에 Shingo Yamamoto ("Yamamoto")가 아래 제재의 근거가 되는 규정 위반에 대해 인정도 부인도 하지 않고 제시한 합의안에 따라, NYMEX 영업행위위원회 위원단 ("BCC 위원단")은 2016 년 8 월에서 2017 년 3 월 사이 여러 거래일에 Yamamoto 가 개장 준비 시간 (pre-opening period)에 Globex 전산 거래 플랫폼에서 주문집계장의 규모 (the depth of the order book)를 식별하기 위한 목적으로 다양한 원유 및 Henry Hub 천연가스 ("천연가스") 및 백금 선물 계약 주문을 입력한 것으로 판단하였다. 이러한 주문의 입력과 취소로 인하여 공시되는 참고 개장 가격 ("IOP")에 변동이 초래되었다. 따라서 본 BCC 위원단은 Yamamoto 가 NYMEX 규정 575.A. (시장 교란 행위 금지)를 위반한 것으로 판단하였다.

제재내용: 합의안에 의거하여, BCC 위원단은 Yamamoto 에게 본 건 및 연계 건 COMEX 17-0646-BC 에 대하여 총 \$25,000 의 벌금을 (이 중 \$20,000 는 NYMEX 에 배정) 지불하도록 명하였으며, 영업일 기준으로 20 일간 (1) 모든 CME Group Inc. 거래소 회원 자격 신청, (2) CME Group Inc. 트레이딩플로어 출입, 및 (3) CME Globex 를 포함하여 CME Group Inc.가 소유하거나 통제하는 모든 전산 거래 및 청산 플랫폼에 대한 직간접적 접근 중지를 명하였다. 접근 중지 기간은 2018 년 6 월 14 일부터 2018 년 7 월 12 일까지 (당일 포함) 유효하다.