



제재조치 공지

NYMEX 17-0646-BC-2

발효일: 2018년 6월 14일

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: 2018년 6월 12일 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 2016년 8월에서 2017년 3월 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 2018년 6월 14일부터 2018년 7월 12일까지 (당일 포함) 유효하다.