



제재조치 공지

NYMEX 23-1657-BC
발효일: 2024년 9월 16일

문서번호: [NYMEX 23-1657-BC](#)

회원여부/비회원: 강 XX

NYMEX 규정위반: 규정 534. 가장매매 금지

그 어떤 사람도 해당 주문의 목적이 시장 리스크에 노출되는 진실한(*bona fide*) 시장 포지션을 확보하는 것을 피하기 위한 것 (가장매매나 가장매도로 일반적으로 알려지거나 불리는 거래)이라는 사실을 알았거나 합리적으로 알 수 있는 상황에 동일한 상품의 동일한 만기월의 매수 · 매도 주문을 제출하거나 수락해서는 안 되며, 동일한 행사가의 풋이나 콜 옵션의 매수 · 매도 주문을 제출하거나 수락해서는 아니 된다. 시장 리스크나 가격 경쟁을 무효화하려는 의도로 입력한 여러 공동 실소유주 계좌들을 위한 매수, 매도 주문 또한 가장매매 금지 조항을 위반하는 것으로 간주된다. 또한 그 어떤 사람도 그러한 사실을 알면서 그러한 주문을 직접적 또는 간접적 방식으로 실행하거나 협조하여서는 아니 된다.

규정 432. 일반 위반 (일부)

다음은 위반 행위이다.

L.1. 이사회, 거래소 직원 또는 일체의 조사위원회 또는 적절한 절차에 따라 소집된 청문위원회, 예정된 직원 인터뷰, 혹은 일체의 조사에 출석하지 않는 행위

조사결과: 2024년 4월 22일, 최고규제책임자는 2022년 8월 3일에서 2023년 6월 20일 사이에 동일한 실소유주의 다른 계좌를 위한 매수 및 매도 주문들을 상대로 주문을 입력함으로써 2023년 10월 E-Mini Natural Gas 선물 시장에서 다수의 가장매매를 체결하였다는 주장에 근거하여, 강 XX 이 NYMEX 규정 534 및 432.L.1을 위반하였다는 혐의를 제기하였다. 영업행위위원회 ("BCC")는 "강"이 본인이 소유한 다섯 개의 계좌들 사이에서 상대 주문을 입력하기 위해 다섯 개의 사용자 ID를 사용하였고, 그가 이 주문들의 목적이 시장 리스크에 노출되는 실질적 포지션을 회피하기 위한 것임을 알았거나 합리적으로 알 수 있었음을 확인하였다. 또한, BCC는 "강"이 거래소 직원과의 예정된 인터뷰에 참석하는 데에 실패했다는 것을 확인하였다.

2024년 8월 28일, NYMEX BCC 심리 위원장은 우선 "강"이 자신에 대해 제기된 혐의에 대해 서면 답변을 제출하는 데에 실패하여 제소 사항을 인정한 것으로



간주된다고 판단하였다. 따라서 “강”은 본 안에 대한 심리에 대한 권리를 포기하였다.

NYMEX 규정 408.F.에 의거하여 BCC 위원단은 “강”이 인정된 혐의에 대한 책임이 있는 것으로 판단하고 이후 제재 심리를 진행하였다.

제재내용: 기록 및 위원단의 판단에 근거하여, 위원단은 본 건과 연계 건인 COMEX 23-1657-BC 에 대하여 “강”에게 \$85,000 의 벌금 (이 중 \$20,000 이 NYMEX에 배정)을 명령하였고, CME Group 이 소유 또는 통제하는 모든 트레이딩플로어에의 직접적 접근 및 CME Group 이 소유 또는 통제하는 지정계약시장, 파생상품청산기관 또는 스왑체결시설에의 직간접적 접근을 영구적으로 금지하였다.

발효일: 2024년 9월 16일