

## 아시아 시장에 대한 면책조항

선물 및 스왑 거래는 모든 투자자에게 적합한 것은 아니며 원금손실의 위험이 따릅니다. 선물 및 스왑은 레버리지를 이용하는 투자이며 계약금액의 일정 비율만으로도 거래가 가능하기 때문에 선물 및 스왑 포지션에 예치된 증거금 이상의 손실을 입을 수도 있습니다. 따라서 거래 시 손해를 보더라도 타격을 입지 않을 정도의 자금만을 이용하는 것이 바람직합니다. 또한 모든 거래에서 수익을 기대할 수는 없으므로 한 번의 거래에는 이러한 자금 중 일부만을 투자하는 것이 좋습니다.

본 자료상의 모든 정보 및 기타 자료들을 금융상품에 대한 매수/매도의 제안이나 권유, 금융 관련 자문의 제공, 거래 플랫폼의 구축, 예치금의 활용 또는 수취, 관할권과 유형을 막론한 다른 어떠한 것이든지 금융상품 또는 금융서비스의 제공을 위한 것으로 받아 들여져서는 안 됩니다. 본 자료상의 정보는 정보전달의 목적으로만 제공되며 자문을 제공하고자 하는 목적이 아닐뿐더러 자문으로 받아들여져서도 안 됩니다. 본 정보는 개인의 목표, 재정적 여건 또는 필요를 고려하지 않았습니다. 본 자료에 따라 행동을 취하거나 이에 의존하기에 앞서 적절한 전문가의 조언을 구하시기 바랍니다.

본 자료상의 정보는 있는 그대로 받아들여져야 하며 명시적이든 묵시적이든 그 내용에 대하여 어떠한 종류의 보증도 하지 않습니다. CME 그룹은 어떠한 오류나 누락에 대하여도 아무런 책임을 지지 않습니다.

본 자료는 CME 그룹이나 또는 그 임직원, 또는 대리인에 의하여 고안되거나 확인 또는 검증되지 않은 정보를 포함하거나 해당 정보에 대한 링크를 제공할 수 있습니다. CME 그룹은 해당 정보에 대해 어떠한 책임도 지지 않으며, 정보의 정확성이나 완전성을 보장하지 않습니다. CME 그룹은 해당 정보 또는 제공되는 하이퍼링크가 제 3 자의 권리를 침해하지 않음을 보장하지 않습니다. 본 자료가 외부 웹사이트로의 링크를 포함하고 있을 경우라도, CME 그룹은 어떠한 제 3 자 또는 그들이 제공하는 서비스 및 상품에 대하여도 지지 또는 권고, 승인, 보증이나 소개를 하는 것이 아닙니다.

CME 그룹 및 “芝商所” 는 CME Group Inc.의 상표입니다. Globex 로고, E-mini, E-micro, Globex, CME 및 Chicago Mercantile Exchange 는 Chicago Mercantile Exchange Inc. (‘CME’)의 상표입니다. CBOT 및 Chicago Board of Trade 는 Board of Trade of the City of Chicago, Inc. (‘CBOT’)의 상표입니다. ClearPort 및 NYMEX 는 New York Mercantile Exchange, Inc. (‘NYMEX’)의 상표입니다. 이들 상표는 그 소유권자의 서면 승인 없이 수정, 복제, 검색시스템에 저장, 전송, 복사, 배포 또는 사용될 수 없습니다.

Dow Jones 는 Dow Jones Company, Inc.의 상표입니다. 그 외의 모든 상표는 각 해당 소유자의 자산입니다.

본문에서 규정 및 상품명세에 대해 언급한 모든 내용은 CME, CBOT, NYMEX 의 공식 규정에 따른 것이며 이 공식 규정은 본문 내용에 우선합니다. 계약 명세와 관련한 모든 경우에 있어서 현행 규정을 참고해야 합니다.

CME 와 CBOT 및 NYMEX 는 각각 싱가포르에서 Recognized Market Operator (공인시장운영자)로 등록되어 있으며 홍콩특별행정구(Hong Kong S.A.R.)의 Automated Trading Service (자동매매서비스) 제공자로 승인을 받았습니다. 뿐만 아니라 본 자료 상의 정보는 일본 법률 제 25 호 금융상품거래법(1948 년, 개정)에 의한 어떠한 해외금융상품시장에 대한 직접적인 접근이나 또는 해외금융상품시장 거래에 대한 청산서비스를 제공하는 것으로 간주할 수 없습니다. 일본 등 아시아의 어떤 관할권에서도 어떠한 유형의 금융서비스도 제공자로서, 또는 제공할 수 있을 것으로 간주될 만한, 등록이나 허가를 받지 않았습니다. CME 그룹 산하의 어떤 기관도 중화인민공화국 또는 대만의 어떠한 금융서비스에 대하여도 이를 제공하거나 제공할 수 있을 것으로 간주될 만한 등록이나 허가를 받지 않았습니다. 본 자료는 한국 및 호주에서 각각 자본시장법 제 9 조 5 항 및 2001 년 기업법(C)과 그 관련 규정상의 정의에 의한 “전문투자자”에의 배포를 위한 것으로서 그에 따라 배포가 제한됩니다.

Copyright © 2018 CME Group and 芝商所. All rights reserved.

## 시장 규정 권고 안내

거래소	CME, CBOT, NYMEX, COMEX
주제	수기/자동 거래 표시 항목(FIX Tag 1028)
참조 규정	규정 536.B.
권고일	2012년 9월 20일
권고 번호	CME 그룹 RA1210-5
발효일	2012년 10월 8일

2011년 6월 5일 이후, CME 그룹 거래소들은 CME Globex에 입력되는 모든 주문에 대해 해당 주문이 수동 입력 주문인지, 아니면 자동 입력 주문인지 주문 입력 메시지의 FIX Tag 1028("Tag 1028")에 의무적으로 표시하도록 규정했습니다. 모든 관련 규제 검토 기간이 완료될 때까지, 2012년 10월 8일부로 Tag 1028의 요건이 각 거래소의 규칙 536.B.( "피트(Pit), Globex 및 전산 거래 기록 보존 의무 - Globex 주문 입력")에 성문화됩니다. 규정 536.B는 CME Globex에서의 주문 입력과 관련한 다양한 요건과 청산회원사 및 일반 기업 회원사에 의한 전산 감사 추적 관리 절차를 명시합니다.

해당 개정 규칙은 아래에 설명되어 있으며, 이어 Tag 1028 요건에 관한 추가 정보와 지침을 제공하는 자주 묻는 질문("FAQ") 섹션이 나옵니다. 정확한 Tag 1028 표시 항목 또는 다른 감사 추적 필수입력 항목 내용을 잘못 제출할 경우, 규정 512("신고 위반")에 의거한 약식 조치를 포함한 징계 조치로 이어질 수 있습니다.

### 536.B. Globex 주문 입력

#### 1. 통칙

Globex에 주문을 입력하는 각 Globex 단말기 운영자는 다음의 정보를 입력하여야 합니다. a) 본 거래소, 청산소 회원사 또는 기타 인증된 기관이 본인에게 지정한 사용자 ID(Tag 50 ID), b) 가격, 수량, 상품, 만기월, CTI 코드, 자동 입력 또는 수기 입력 여부 표시(Tag 1028) 및 계좌 번호(섹션 C에 설명한 경우는 제외), 그리고 옵션의 경우, 풋 또는 콜 및 행사가. 각 주문서에 Globex 단말기 운영자의 사용자 ID를 반드시 표시하여야 합니다. 규칙 574에 의거하여 액세스를 얻은 Globex 단말기 운영자는 그러한 액세스를 승인한 청산회원사가 Globex 단말기 운영자의 규칙 준수에 대한 책임이 있습니다.

Globex 단말기 운영자가 Globex에 즉각 입력할 수 있는 주문을 받는 경우에는 위에 명시한 기록 이외의 기록을 입력할 필요가 없습니다. 그러나 Globex 단말기 운영자가 Globex에 즉각 입력할 수 없는 주문을 받으면 해당 Globex 단말기 운영자는 반드시 수기 주문서를 작성하고 상기 A.1.항에 따라 주문서에 계좌명, 수신 일시 및 기타 필수 입력 정보를 포함하여야 합니다. 해당 주문서는 반드시 실행 가능한 시점에 Globex에 입력하여야 합니다.

## 2. 전산 주문 라우팅 및프런트엔드 시스템의 전산 감사 추적 기록 필수 입력 사항

Globex와의 연결을 보장하는 청산소 회원사는 모든 전산 주문의 주문 라우팅/프런트 엔드 감사 추적 기록을 유지하거나 유지하게 할 책임을 지닙니다. 이러한 기록에는 CME iLink® 게이트웨이를 통해 Globex 플랫폼에 입력된 주문 입력, 수정, 취소 및 그러한 메시지들("전산 감사 추적 기능")에 대한 응답 기록이 포함됩니다. 전산 감사 추적 기록은 반드시 최소 5년간 유지되어야 하며, 청산회원사들은 시장규제부서의 요청 시 이러한 데이터를 표준 형식으로 작성할 역량을 반드시 갖춰야 합니다.

전산 감사 추적 기능에는 모든 주문 수령증, 주문 입력, 주문 수정 및 응답 수령 시간을 운영 시스템이 처리할 수 있는 최대한의 정밀도 수준까지 기록하되, 최소 100분의 1초 단위까지 기록하여야 합니다. 이렇게 기록된 시간은 주문 입력자가 절대 수정할 수 없어야 합니다. 아울러 해당 데이터에는 반드시 모든 Fix Tag 정보와 입력 항목을 포함해야 합니다. 이러한 정보와 항목에는 다음의 사항이 포함됩니다(이에 국한되지는 않음).

주문 입력에 관련된 모든 입력 항목의 기록. 여기에는 거래일, 상품, 거래소 코드, 만기월, 수량, 주문 유형, 적격 주문 요건(order qualifier), 가격, 매수/매도 표시 목록, 역지정가(Stop)/트리거 가격, 주문번호, 고유거래번호, 계좌번호, 세션 ID, Tag 50 ID, 자동·수기 표시 항목(Tag 1028), 호스트 주문번호, 트레이더 주문번호, 청산 회원사, 활동 유형, 활동 상태 코드, 고객 유형 항목, 출처(origin), 타임스탬프. 체결된 주문의 감사 추적 기록에는 해당 거래의 체결 시간과 모든 기재 정보를 반드시 기록해야 합니다.

보증을 하는 청산회원사(Guaranteeing Clearing Firm)가 다른 청산회원이거나 일반기업 회원사인 고객과 직접 연결되어 있는 경우, 보증하는 청산회원사는 고객인 다른 청산회원사, 일반 기업 회원사에 그들이 감사 추적 기능을 유지할 책임이 있다는 사실을 알릴 수 있습니다. 이를 알리는 서면 통지서를 보내는 순간부터 고객 청산회원사나 일반 기업 회원사는 이 규정에 따라 전산 감사 추적 기능을 유지할 책임을 지닙니다. 본 문서의 어떤 내용도 위에 언급한 회사가 규정 1.31 또는 1.35를 포함한 CFTC 기록 보관에 대한 규정을 준수하는데있어 달리 해석될 수 없습니다.

**FIX Tag 1028 관련 FAQ(자동·수기 표시 항목)**

**1. Tag 1028 이란?**

Tag 1028 은 CME Globex 에 제출되는 모든 주문에 특정 주문이 수기 주문인지, 자동 주문인지 표시하도록 마련된 필수 입력 데이터 항목입니다. 이 항목은 CME iLink 에서 2011년 6월부터 주문 제출 시, 필수 입력 항목이 되었으며, 이제 규제 요건으로 추가되는 것입니다.

**2. Tag 1028 에 제출하는 입력 값은 무엇인가요?**

수기 주문은 반드시 값을 "Y"로 지정하고 자동 주문은 반드시 값을 "N"으로 지정해 제출해야 합니다. Tag 1028 에 이외의 다른 값을 제출할 수는 없습니다.

**3. '자동 주문 입력'의 정의는 무엇인가요?**

자동 주문 입력이라 함은 사람의 개입 없이 생성 및/또는 전송되는 주문을 말합니다. 여기에는 컴퓨터 시스템 의해 생성되는 모든 주문은 물론 자동 수단(즉 거래 실행 알고리즘)을 통해 주문 제출을 관리하는 기능을 사용하여 전송하는 주문이 포함됩니다.

**4. '수기' 주문 입력'의 정의는 무엇인가요?**

수기 주문 입력이라 함은 한 개인이 직접 해당 주문을 프론트엔드 시스템에 입력하여 CME Globex 에 제출하는 주문을 말합니다. 이러한 주문은 일반적으로 키보드, 마우스 또는 터치스크린을 이용해 입력된 후, 제출하는 즉시 그 전체 내용이 매치 엔진에 전송됩니다.

**5. 자동 거래 시스템("ATS") 팀이 Tag 50 으로 수기 주문과 자동 주문을 모두 전송할 수 있나요?**

아니요. ATS 팀은 자동 주문만 보낼 수 있습니다. 모든 수기 입력 주문은 반드시 주문을 입력한 당사자의 Tag 50 을 표시하여야 합니다.

**6. 수기로 거래하는 직원이 일부 주문을 자동 스프레딩 기능도 활용하여 처리하는 경우, 그러한 주문은 수기 주문과 자동 주문 중 어떤 주문으로 분류해야 하나요?**

수기로 입력한 주문은 Tag 1028 에 반드시 "Y" 값을 지정해야 합니다. 자동 스프레딩 기능을 사용해 자동으로 생성된 주문은 Tag 1028 에 반드시 "N" 값을 지정해야 합니다.

**7. 특정인이 주문 제출 관리 기능을 사용하는 자신의 프론트엔드 시스템에 주문을 수기로 입력하여 CME Globex 매치 엔진에 제출하는 경우에는 해당 주문(들)을 수기 주문과 자동 주문 중 어떤 주문으로 분류해야 하나요?**

이 경우, 실행 알고리즘이 CME Globex 매치 엔진에 보낼 입력 내용을 생성하므로 Tag 1028 에 "N" 값을 표시하여 자동 주문으로 지정해야 합니다.

**8. CME Globex 에 주문을 입력할 때 사용되는 프론트엔드 감사 추적 기록에 각 주문의 Tag 1028 값을 일일이 기록해야 하나요?**

예. Tag 1028 정보는 반드시 캡처하여 프론트엔드 감사 추적 기능에 정확하게 기록해야 합니다.

**9. Tag 1028 과 관련한 청산회원의 책임은 무엇입니까?**

청산회원은 이 요건을 승인된 고객 사용자들에게 알려야 하며, 고객이 해당 태그를 올바르게 표시하고 있는지 검증하여야 합니다.

본 안내와 관련한 질문은 다음 시장규제부서 담당자에게 문의하십시오.

Lou Abarcar, Director, Data Quality Assurance, 312.341.3236

Terrence Quinn, Manager, Data Quality Assurance, 312.435.3753

Betsy Schneider, Supervisor, Data Quality Assurance, 312.341.3343

본 권고 안내와 관련한 질문이 있는 미디어 관계자는 CME 그룹의 기업홍보팀 312.930.3434 또는 [news@cmegroup.com](mailto:news@cmegroup.com) 에 문의하십시오.