

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)와 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	주문 라우팅/프런트엔드 감사 추적 기록 요건
참조 규정	규정 536.B.
권고일	2015 년 12 월 14 일
권고 번호	CME 그룹 RA1520-5
발효일	2015 년 12 월 29 일(규칙 536.B.2.에 국한된 개정)
준수 시한	2016 년 4 월 1 일(재인증 요건에 한하여 적용 - 아래 설명 참조)

본 권고 안내는 2015 년 6 월 29 일 자 CME 그룹 시장 규정 권고 안내 RA1509-5 를 대체하며, CME, CBOT, NYMEX, COMEX 규칙 536.B.2. 개정본을 토대로 발행하는 것입니다. 이 규정은 거래소 청산 회원사가 감사 추적 기록의 보관 및 보존 의무를 다른 거래소 청산회원사(CMF)나 주식 회원사(그러한 다른 회사가 직접 연결된 고객일 경우)에 위임하는 것을 허용함에도 불구하고, CMF 는 CFTC 의 기록 관리 조항에 준하여 전산 주문 라우팅/프런트엔드 감사 추적 기록 정보를 반드시 CFTC 에 제공해야 함을 성문화합니다.

이를 제외한 본 권고 안내에 담긴 그 어떤 다른 정보도 변경되지 않았습니다.

기존의 인증된 모든 기관은 **2016 년 4 월 1 일**까지 자사의 거래 시스템을 재인증받음으로써 [CME Group Client Systems Wiki](#) 에 명시된 새 요건을 충족할 수 있습니다. 2015 년 4 월 2 일부터 2016 년 4 월 1 일 사이에 CME iLink® 게이트웨이를 통하여 자사의 주문 라우팅/프런트엔드 시스템을 CME Globex 플랫폼에 연결해 본 거래소의 인증을 의무적으로 받아야 하는 모든 기관은 2016 년 4 월 1 일까지 반드시 자사 시스템이 개정된 규칙 요건을 완전히 충족하는지 확인하여야 합니다.

CME, CBOT, NYMEX, COMEX 규칙 536.B.2.(“Globex 주문 입력 - 전산 주문 라우팅/프런트 엔드 시스템의 전산 감사 추적 기록 요건)는 CME iLink® 게이트웨이를 통해 CME Globex 플랫폼에 액세스하는 일체의 시스템과 관련된 전산 감사 추적 내역에 그러한 연결을 통해 이뤄진 모든 활동의 완전하고 정확한 기록을 담고, 주문 라우팅이나 프런트엔드 시스템이 전산 통신을 수령하거나 생성하는 순간부터 그 내용이 CME Globex 에 전송될 때까지 모든 전산 통신 내역을 기록할 것을 규정합니다. 더 나아가, 이 규칙은 CME Globex 에 대한 연결을 보증하는 CMF 들은 전산 감사 추적 기록을 최소 5 년간 관리하거나 관리되도록 할 책임을 규정합니다.

CME iLink® 게이트웨이를 통해 CME Globex 에 액세스하는 거래 시스템의 주문 라우팅/프런트엔드 감사 추적 기록을 관리할 책임을 지닌 회사들은 규정된 형식에 따라 데이터를 표시할 역량을 반드시 갖춰야 합니다. 거래소 Drop Copy 에는 거래소 수준의 감사 추적 기록만 반영되고 해당 회사의 시스템 내부 정보는 포함되지 않으므로, Exchange Drop Copy 메시지나 파일은 규칙 536.B.2.의

요건을 충족하지 못합니다. 더 나아가 연결된 기관은 반드시 **해당 시스템이 지원하는 모든 거래 기능이 감사 추적 기록에 적절하게 반영되었는지** 확인해야 합니다. 그러한 주문 라우팅이나 프론트엔드 시스템을 관리할 책임을 지닌 회사들의 편의를 위하여 본 거래소들은 [CME Group Client Systems Wiki](#)의 연결 인증 프로세스에 새로운 데이터 정의, 형식 요건 및 유효성 검증 규칙을 업데이트하여 본 거래소들과 연결하는 회사의 시스템이 필수적으로 캡처해야 하는 최소한의 추적 감사 요소를 제공하고 있습니다.

CME 그룹의 시장규제부서는 주문 라우팅/프론트엔드 감사 추적 기능을 매년 재검토하여 당사 인증을 받은 시스템들이 최소한의 수용 가능한 감사 추적 요소를 캡처하고 있는지 검증합니다.

감사 추적 기록 보존 책임

Globex와의 연결을 보장하는 CMF 들은 모든 전산 주문의 주문 라우팅/프론트엔드 시스템의 감사 추적 기록을 관리하거나 관리되도록 할 책임이 있습니다(해당 CMF의 고객이 아래에 설명한 것처럼 또 다른 CMF 이거나 주식회사인 경우는 제외함). 이러한 기록에는 CME iLink® 게이트웨이를 통해 Globex 플랫폼에 입력된 주문의 입력, 수정, 취소 및 그러한 메시지들("전산 감사 추적 기능")에 대한 응답이 포함됩니다. 이러한 감사 추적 기록을 관리할 책임은 CMF 들에 있으나, 다수 CMF 는 감사 추적 기록 보존 업무를 공급업체에 아웃소싱하거나, 자사 시스템에 직접 연결된 고객들에게 데이터 관리 비용을 부담시킵니다.

보증인 CMF(Guaranteeing CMF)가 다른 CMF 이거나 주식 회사인 고객과 직접 연결되어 있는 경우, 보증인 CMF 는 해당 CMF 나 기업 주식 회사에 전산 감사 추적 기능을 유지할 책임이 그들에게 있다는 사실을 알릴 수 있습니다. 이서면 통지서가 효력을 발생하는 순간부터, 고객 CMF 나 주식 회사는 이 규칙에 의거하여 전산 감사 추적 기록을 관리할 책임을 지닙니다.

CME Globex와 새로 연결하게 되면 연결된 기관은 본 시스템의 실시간 환경에 액세스하기 전에 반드시 테스트/인증 환경에서 생성된 감사 추적 보고서 샘플을 제출해야 합니다. 당사 시스템에 연결된 기관이나 청산회원은 새 시스템이 실시간 환경 속에 배포된 직후, 당사 시장규제부서에 프로덕션 환경 속에서 작성된 완전한 감사 추적 보고서를 제출하여야 합니다. 이러한 감사 추적 보고서 검토 절차의 목적은 감사 추적 기록이 최소한의 데이터 요건을 충족하고, 보고서를 사람이 읽을 수 있는 표준 형식으로 작성할 수 있는지 확인하기 위한 것입니다. 샘플이나 프로덕션 환경의 감사 추적 기록 신고서 제출과 관련한 질문은 AuditTrail@CMEGroup.com에 전송하십시오.

CME, CBOT, NYMEX, COMEX 규칙 536.B의 내용은 다음과 같습니다.

536.B. Globex 주문 입력

1. 통칙

Globex에 주문을 입력하는 각 Globex 단말기 운영자는 [CME Group Client Systems Wiki](#)에 명시된 입력 시점의 CME iLink® 메시지 사양에 준하여 자동으로 표시될 필수 입력 항목을 각 [애플리케이션 메시지](#)에 정확히 입력하여야 합니다. 이러한 필수 입력 항목에는 운영자의 사용자 ID(Tag 50 ID), 가격, 수량, 상품, 만기월, CTI 코드, 자동/수기 표시 목록(Tag 1028) 및 계좌번호(섹션 C의 조항은 제외), 그리고 옵션 상품의 경우, 풋 또는 콜 및 행사 가격이 포함되되 이에 국한되지는 않습니다. Globex 단말기 운영자의 사용자 ID는 주문 메시지와 함께 Globex에 제출되는 각 주문서에 반드시 표시되어야 합니다. 규칙 574에 의거하여 액세스를 얻은 Globex 단말기 운영자의 경우에는 그의 Globex 액세스를 보증한 청산 회원사가 다음의 입력 항목, 즉 운영자의 사용자 ID, CTI 코드, 자동/수기 표시 목록 및 계좌번호에 대한 Globex 단말기 운영자의 본 규칙 준수를 책임집니다. 규칙 574의 내용에도 불구하고, 규칙 574에 따라, 청산 회원사는 비회원사 운영자가 각 애플리케이션 메시지 입력 항목을 정확하게 입력하지 않았다는 것을 실제로 알았거나, 알았어야 마땅할 경우, 적절한 조치를 취해야 합니다.

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/프런트엔드 시스템의 전산 감사 추적 기록 필수 입력 사항

본 거래소가 CME iLink®를 통해 Globex 플랫폼과의 연결을 인증한 기관들은 Globex에 입력되는 각 메시지의 감사 추적 기록을 생성할 책임을 지닙니다. Globex에 대한 연결을 보증하는 청산 회원사들은 전산 감사 추적 기록을 관리하거나 관리되도록 할 책임을 지닙니다. 전산 감사 추적 기록은 반드시 최소 5년간 유지되어야 하며, 청산 회원사들은 시장규제부서의 요청 시 이러한 데이터를 표준 형식으로 작성할 역량을 반드시 갖춰야 합니다.

그러한 각각의 전산 감사 추적 기록은 반드시 완전하고 정확해야 하며, 시스템이 수신하거나 생성하는 모든 전산 통신 내용을 기록해야 합니다. 그러한 통신 기록에는 그러한 시스템이 Globex에서 수신하는 모든 전산 통신이 포함됩니다.

이러한 전산 감사 추적 기록에는 모든 주문 수령증, 주문 입력, 주문 수정 및 응답 수령 시간을 운영 시스템이 도달할 수 있는 최대한의 정밀도 수준까지 기록하되, 최소 1,000분의 1초 단위까지 기록하여야 합니다. 이렇게 기록된 시간은 주문 입력자가 절대 수정할 수 없어야 합니다. 해당 데이터에는 반드시 다음의 정보가 포함되어야 합니다(이에 국한되지는 않음). 거래일, 상품, 거래소 코드, 만기월, 수량, 주문 유형, 주문 획득 요건(order qualifier), 가격, 매수/매도 표시 목록, 지정가/트리거 가격, 주문번호, 고유거래번호, 계좌번호, 세션 ID, Tag 50 ID, 자동/수기 표시 목록(Tag 1028), 적용되는 경우 자기 매칭 방지 ID(Tag 7928), 호스트 주문번호, 트레이더 주문번호, 청산 회원사, 액션 유형, 액션 상태 코드, 고객 유형 표시 목록, 출처(origin), 타임스탬프를 포함한 주문 입력에 관련된 모든 입력 항목의 기록. 실행된 주문의 감사 추적 기록에는 해당 거래의 실행 시간과 모든 기재 정보를 반드시 기록해야 합니다.

보증인 청산회원사(Guaranteeing Clearing Firm)가 다른 청산회원이거나 주식 회원사인 고객과 직접 연결되어 있는 경우, 해당 청산회원사는 자사에 전산 감사 추적 기능을 유지할 책임이 있다는 사실을 자신의 고객인 다른 청산회원이나 주식 회원사에 통지할 수 있습니다. 이 서면 통지서가 효력을 발생하는 순간부터, 고객 청산회원이나 주식 회원사는 이 규칙에 의거하여 전산 감사 추적 기록을 관리할 책임을 지닙니다. 이 문서에

담긴 그 어떤 내용도 위에 언급한 일체 회사의 관련 CFTC 규정의 기록 보관 조항(규칙 1.31 또는 1.35 포함) 준수 의무를 면제하지 않습니다.

본 권고 고지서에 관한 질문은 시장규제부서에 문의하십시오.

Maricela George, Data Investigator, 312.435.3614

Terry Quinn, Manager, 312.435.3753

Laetizia Moreau, Director, 312.435.3619

본 특별 종합 안내와 관련한 질문이 있는 미디어 관계자는 CME그룹의 기업홍보팀 312.930.3434 또는 news@cmegroup.com에 문의하십시오.