

COMMODITY EXCHANGE 징계 조치 통지문

사건 번호: COMEX 17-0646-BC**비회원:** SHINGO YAMAMOTO**관련 규정:** NYMEX 규정 575.A. 시장 질서 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 안된다.

조사 결과: 2018년 6월 12일 청문회에서 Shingo Yamamoto ("Yamamoto")가 제시한 합의 제안 따라 Yamamoto는 아래 처벌에 기반한 규정 위반 행위가 있었음을 시인하거나 부인하지 않았으며, COMEX 기업책임경영위원회 패널 ("BCC")는 2016년 8월에서 2017년 3월 사이 여러 거래일에 Yamamoto가 시가결정시간에 Globex 전산 거래 플랫폼에서 주문집계장의 깊이를 식별하기 위한 목적으로 다양한 금 및 구리 선물 계약 주문을 입력한 것으로 판단했습니다. 이러한 주문의 입력과 취소로 인하여 공시되는 참고 개장 가격("IOP")에 변동이 초래되었습니다.

따라서 본 패널은 Yamamoto가 NYMEX 규정 575.A. (시장 질서 교란 행위 금지)를 위반한 것으로 판단하였습니다.

처벌: 해당 합의 제안에 의거하여 본 패널은 Yamamoto에 본 위반건 및 동반 위반건 NYMEX 17-0646-BC에 대하여 총 \$25,000의 벌금을 (벌금 중 \$5,000는 COMEX에 할당되고) 명하였으며, 영업일 기준으로 20일간 (1) 모든 CME Group Inc. 거래소 회원가입 신청; (2) CME Group Inc. 거래 플로어 출입; 및 (3) CME Globex를 포함하여 CME Group Inc.가 소유하거나 통제하는 모든 전산 거래 및 청산 플랫폼에 대한 직간접적 접근 금지를 명하였습니다. 자격 금지 기간은 2018년 6월 14일부터 당일을 포함한 2018년 7월 12일까지 유지됩니다.

발효일: 2018년 6월 14일