

증권선물위원회

의결 제2022-70호

1. 조치대상자의 인적사항

제재대상	내용(회사명, 성명 등)
기 관	Citadel Securities (Hong Kong) Limited
임직원	
기 타	

2. 조치내용

☐ 과징금 118억 8,000만원 (시장질서 교란행위 금지 위반)

☐ 과태료 11억 1,580만원 (공매도 제한 위반)

3. 조치이유

가. 지적사항

☐ 시장질서 교란행위 금지 위반

- Citadel Securities (Hong Kong) Limited(해외 소재 금투업자)는 '17.10월~'18.5월 기간 중 264개 종목에 대해 고빈도 알고리즘 매매기법을 이용하여 고가·물량소진 매수주문, 저가·물량소진 매도주문, 호가공백 메우기 주문 등 합계 169,594회, 304,963,719주의 시장질서 교란주문을 제출하여 주식의 수요·공급 상황이나 가격에 대한 오해를 유발하거나 가격을 왜곡할 우려가 있는 행위를 한 사실이 있음

* 호가관여율 : 47.5%, 주가변동률 : 1.53%, 부당이득금액 : 산정불가

☐ 공매도 제한 위반

- Citadel Securities (Hong Kong) Limited는 〇〇〇〇 〇〇〇〇〇〇〇〇
및 〇〇〇〇 〇〇〇〇〇 명의 증권계좌를 운용하며, 동사들이 해당
주식을 소유하지 않은 상태에서 ‘16.11월~‘19.5월 기간 중 7일
동안 총 165회에 걸쳐 총 25개 종목 150,106주를 공매도한
사실이 있음

나. 근거법규

- ☐ 시장질서 교란행위 금지 위반 (「자본시장과 금융투자업에 관한 법률」
제429조의2, 제178조의2 제2항 제4호)
- ☐ 공매도 제한 위반 (「자본시장과 금융투자업에 관한 법률」 제449조 제
1항 제39호, 제180조 제1항 제1호 및 동법 시행령 390조)