
	<h1 style="text-align: center;">보 도 자 료</h1> <h2 style="text-align: center;">배포 시부터 보도 가능</h2>	
---	--	--

담당기관	금융위원회	자본시장조사단	김홍식 단장(2156-3300), 황현일 사무관(2156-3311)
	금융감독원	자본시장조사2국	조효제 국장(3145-5650) 고영집 팀장(3145-5639)
		특별조사국	조철래 국장(3145-5100), 안승근 팀장(3145-5108)
배포부서	금융위원회 대변인실(2156-9543~48), 금융감독원 공보실(3145-5789~92)		
배 포 일	2015. 10. 28. (수)		총 5 매

제 목 : 자본시장 불공정거래에 대한 조사결과 조치

1. 조치 개요

- 증권선물위원회는 '15. 10. 28. 제19차 정례회의를 개최하여 시세조종 등 불공정거래를 한 혐의로 코스닥 상장법인 대표이사 등 4인을 검찰에 고발하기로 하였음

2. 주요 위반 내용

① 담보주식의 반대매매 및 경영권 상실을 방지하기 위해 허위 보도자료를 배포한 혐의

- 상장법인 A사의 대표이사 및 실질적 사주인 甲은 신제품 개발사업 실패설로 주가가 급락하자 담보로 제공한 A사 주식의 반대매매 및 경영권 상실 등을 우려하여

실패 사실을 인지하고 있음에도 '실패설은 사실이 아니다'라는 허위 보도 자료를 배포함으로써 주가 하락을 방지한 혐의가 있음

[(붙임) 'A사 주식에 대한 부정거래행위 금지 위반' 참조]

② 증권사 前 임원인 파생상품 운용역의 코스피200 옵션 시세조종 혐의

- 증권사 前 임원인 파생상품 운용역 甲은 본인의 성과급을 극대화할 목적으로 2013.7.1. ~ 2015.3.31. 기간 동안 기초자산(코스피200 지수) 움직임에 비해 가격변동이 적고, 일반투자자 접근이 용이한 저가격 (0.1p 내외) 옵션 종목을 선택하여,

주문 제출시 증거금을 필요로 하는 일반투자자에 비해 증거금 부담 없이 대량의 주문 제출이 가능한 사후증거금 계좌를 이용,

본인 포지션을 유리한 가격에 구축 또는 청산하기 위하여 물량소진 및 허수주문 등의 수법으로 파생상품의 시세를 조종하여 약 42억원의 부당이득을 취함

[(붙임) '코스피200 옵션 종목에 대한 시세조종 금지 위반' 참조]

3. 투자자 유의사항

- 앞으로도 금융당국은 시세조종 등 시장 투명성을 저해하는 불공정 거래에 대해 엄중하게 조치함으로써 시장질서를 확립해 나갈 예정임
- 아울러 시세조종 등 불공정거래가 의심될 경우 금융위원회 자본시장조사단 또는 금융감독원에 적극적으로 제보하여 주시기 바랍니다

< 증권불공정거래 신고센터 >

- ☞ 금융위원회 자본시장조사단 신고/제보 전화 ☎ 02-2156-3333)
- ☞ 금융감독원 증권불공정거래 신고센터(<http://www.cybercop.or.kr>) 접속

불공정거래 조사결과 조치내역

1. A사 주식에 대한 부정거래행위 금지 위반

가. 사건의 개요

- 최대주주가 담보로 제공한 상장주식의 반대매매 및 경영권 상실을 방지할 목적으로 신제품 개발사업 실패 사실을 인지하고 있음에도 허위 보도자료를 배포한 사건임

나. 조사결과

□ 부정거래 행위 금지 위반

- 상장법인인 A사의 대표이사 및 실질적 사주인 甲은 자회사의 신제품 개발사업 실패설(루머)이 시장에 확산되면서 A사의 주가가 급락하자 A사의 최대주주인 B사가 보유중인 A사 주식 대부분을 담보로 제공한 상태로 추가 자금동원 능력이 거의 없는 상황에서 A사 주식의 담보 가치 하락에 따른 반대매매 및 경영권 상실 등을 우려하여 신제품 개발사업 실패 사실을 인지하고 있음에도 '실패설은 사실이 아니다'라는 허위 보도자료를 배포함으로써 주가(담보가치) 하락을 방지한 혐의가 있음

다. 조치내용

- 고 발 : 甲 [대표이사 겸 실질사주]
A사* [코스닥상장법인(대표이사 甲)]
B사* [비상장법인(대표이사 甲), A사의 최대주주]
* 양벌규정 적용

문의 : 자본시장조사2국 조사6팀장 고영집
(☎02-3145-5639)

2. 코스피200 옵션 종목에 대한 시세조종 금지 위반

가. 사건의 개요

- 증권사의 파생상품 운용역 甲은 본인의 성과급을 극대화할 목적으로, 본인 포지션을 유리한 가격에 구축 또는 청산하기 위하여 물량소진 및 허수주문을 이용하여 시세조종행위를 반복한 사건임

나. 조사결과

□ 시세조종 금지 위반

- 증권사 파생상품 운용역인 甲은 2013.7.1 ~ 2015.3.31 기간 중 코스피 200 옵션 33개 종목을 대상으로 총 6,930,535 계약을 매매하는 과정에서, 높은 시장지배력을 바탕으로 일중 수십차례 본인 포지션을 유리한 가격에 구축 또는 청산하기 위하여 물량소진주문 및 허수주문 등 총 26,663회에 걸쳐 18,337,370계약의 시세조종 주문을 제출하여 코스피200 옵션 33개 종목의 시세를 인위적으로 변동시키고 약 42억원의 부당이득을 취득한 혐의가 있음

다. 조치내용

- 고 발 : 甲[前 C증권사 소속 파생상품 운용역]

문의 : 특별조사국 파생상품조사팀장 안승근
(☎02-3145-5108)

참고 : 혐의자의 시세조종 개요

- 혐의자는 장중에 매수·매도를 반복하고, 장종료 후에는 미결제 약정을 보유하지 않는 데이트레이더이자, 짧은 시간내에 1 ~ 2틱의 매매이익을 추구하는 전형적인 스캘퍼(Scalper)로서
 - 대량의 연속주문 등을 이용하여 매도(매수)1호가 잔량을 모두 소진시킨 후
 - 매수(매도)1~2호가 등에 체결의사 없는 대량의 매수주문을 신규제출하고, 사전에 제출해 놓은 매도(매수)1~3호가의 매도 주문을 취소시키는 방법으로 호가잔량을 변동시켜 매수(매도)세를 유인하고
 - 이후 가격이 상승(하락)하면 매도(매수)주문을 제출, 포지션을 청산하여 매매이익을 실현

