

	<h1>보도자료</h1>	
<h2>배포 시부터 보도 가능</h2>		

담당기관	금융위원회	자본시장조사단	김홍식 단장(2156-3300), 윤송이 사무관(2156-3334)
	금융감독원	특별조사국	조철래 국장(3145-5100), 안승근 팀장(3145-5108) 김대준 팀장(3145-5104)
배포부서	금융위원회 대변인실(2156-9543~48), 금융감독원 공보실(3145-5786,5790)		
배포일	2015. 12. 23. (수)		총 5 매

### 제 목 : 자본시장 불공정거래에 대한 조사결과 조치

#### 1. 조치 개요

- 증권선물위원회는 '15. 12. 23. 제23차 정례회의를 개최하여 시세조종 등 불공정거래를 한 혐의로 증권사 소속 파생상품 운용역 등 2명을 검찰 고발하기로 하였음

#### 2. 주요 위반 내용

##### ① 증권사 파생상품 운용역의 코스피200 선물 시세조종 혐의

- 증권사 직원인 파생상품 운용역 甲은 본인의 성과급을 극대화할 목적으로 '13.12.12. ~ '14.9.11. 기간 동안 증거금 부담 없이 대량 주문 제출이 가능한 사후증거금 계좌를 이용,
- 본인 포지션을 유리한 가격에 청산하기 위하여 대량의 허수주문을 제출하는 수법으로 코스피200 선물의 시세를 인위적으로 변동시켜 약 14억원의 부당이득을 취득한 혐의가 있음

[(붙임) '코스피200 선물에 대한 시세조종 금지 위반' 참조]

##### ② 상장사 최대주주 겸 대표이사가 감사 결정 후 동 정보가 공개되기 전에 보유중인 차명주식을 매도하여 손실을 회피한 혐의

- B사 최대주주 겸 대표이사인 甲은 결손금 보전 및 재무구조 개선 목적으로 5:1 감자를 실시하기로 결정하고 동 정보가 공개되기 이전에 보유중이던 차명주식을 매도하는 한편 우호지분 보유자인 지인들에게 동 사실을 알려 손실을 회피하도록 한 혐의가 있음

[(붙임) 'B사 주식에 대한 미공개정보 이용금지 위반' 참조]

#### 3. 투자자 유의사항

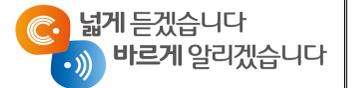
- 앞으로도 금융당국은 시세조종이나 미공개정보 이용행위 등 시장 투명성을 저해하는 불공정거래에 대해 엄중하게 조치함으로써 시장 질서를 확립해 나갈 예정임
- 아울러 불공정거래가 의심되는 경우 금융위원회 자본시장조사단 또는 금융감독원에 적극적으로 제보하여 주시기 바랍니다

#### < 증권불공정거래 신고센터 >

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



☞ 본 자료를 인용하여 보도할 경우에는 출처를 표기하여 주시기 바랍니다.  
<http://www.fsc.go.kr>, <http://www.fss.or.kr>



# 불공정거래 조사결과 조치내역

## 1. 코스피200 선물에 대한 시세조종 금지 위반

### 가. 사건의 개요

- 증권사의 파생상품 운용역 甲이 본인의 성과급을 극대화할 목적으로 본인 포지션을 유리한 가격에 청산하기 위해 대량의 허수주문을 이용하여 시세조종행위를 반복한 사건\*임
- ※ 한국거래소로부터 이상거래 심리결과를 통보받아 조사에 착수한 사건임

### 나. 조사결과

#### □ 시세조종 금지 위반

- A증권사 파생상품 운용역인 甲은 2013.12.12. ~ 2014.9.11. 기간 중 코스피200 선물 3개 종목을 대상으로 총 85,326계약(11조원 규모)을 매매하는 과정에서

높은 시장지배력을 바탕으로 일중 수십차례 본인 포지션을 유리한 가격에 청산하기 위하여 허수주문을 38,780회(791,024 계약, 102조원 규모) 제출하는 등

코스피200 선물 3개 종목의 시세를 인위적으로 변동시키고 약 14억원의 부당이득을 취득한 혐의가 있음

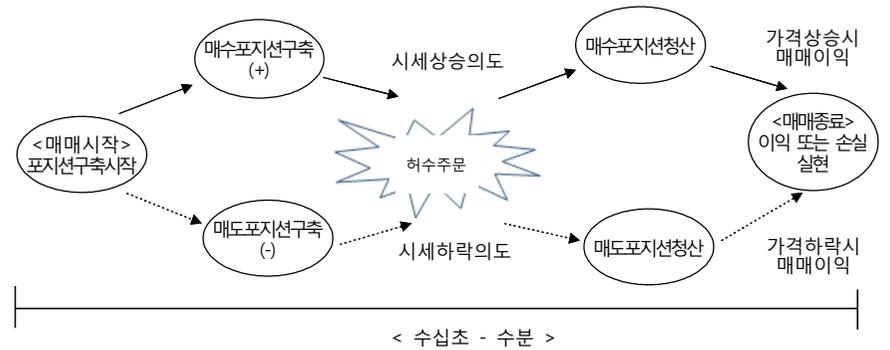
### 다. 조치내용

- 고 발 : 甲 [A증권사 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
  - 매수(매도)1~2호가 등에 체결의사 없는 대량의 매수주문을 제출하고 취소시키는 방법으로 호가잔량을 변동시켜 매수(매도)세를 유인하고
  - 이후 가격이 상승(하락)하면 매도(매수)주문을 제출, 포지션을 청산하여 매매이익을 실현



## 2. B사 주식에 대한 미공개정보 이용금지 위반

### 가. 사건의 개요

- 상장법인의 최대주주 겸 대표이사가 5:1 감자결정 정보를 직무상 지득하고 동 정보 공개 전에 보유하던 차명주식을 전량 매도하여 손실을 회피하는 한편 우호지분 보유자이던 지인들에게 이를 알려 주식매매에 이용하게 한 사건임

### 나. 조사결과

#### □ 미공개정보 이용금지 위반

- 상장법인 B사의 최대주주 겸 대표이사 甲은 결손금 보전 및 재무구조 개선 목적으로 5:1 감자를 실시하기로 결정하고

동 정보가 공개되기 전에 차명으로 보유중인 B사 주식 전량을 매도하는 한편 지인 3명에게도 동 정보를 전달하여 동사 주식 매매에 이용하게 함으로써 약 717백만원의 손실을 회피한 혐의가 있음

### 다. 조치내용

- 고 발 : 甲 [B사 최대주주 겸 대표이사]

문의 : 특별조사국 특별조사5팀장 김대준  
(☎02-3145-5104)