

시장 규정 권고 공지문은 CFTC 규정 40.1(i)의 요건에 따라 거래소에서 발행하며, 따라서 구속력 있는 규칙이 됩니다. 이 시장 규정 권고 공지문(이하 "MRAN")은 MRAN의 공식 버전인 영문 텍스트를 번역한 것입니다. 저희는 이 영문 텍스트의 정확한 번역을 제공하기 위해 최선의 노력을 다 하였지만, 번역으로 인한 차이는 일체 구속력을 갖거나 법적인 효력을 미치지 않습니다. 본 번역본에 기재된 정보에 관해 궁금한 점이 있으시면 영문본을 참조하십시오.

게시 날짜를 기준으로 이 MRAN 내의 정보의 정확성을 보장하기 위해 최선의 노력을 다해 제작하였으나, 오류나 누락이 있을 시 CME Group은 이에 대한 책임을 지지 않습니다. 이 MRAN에 모든 정보가 빠짐 없이 수록된 것은 아니며 변경될 수 있습니다. 관련법에 따라, CME Group은 MRAN에 수록된 정보 또는 MRAN과 관련된 정보의 사용으로 인해 발생하는 손실에 대해서는 어떠한 책임도 (파실 여부에 상관 없이) 지지 않습니다.

이 MRAN의 내용은 다만 일반적인 이해를 돋기 위해 CME Group이 편집한 것이므로 투자, 금융, 법률 또는 규제 조언으로 해석되어서는 안 됩니다. 어떠한 행동을 취하거나 정보에 의존하기 전에 적절한 전문가의 조언을 받기를 권합니다.

CME Group이 제공하는 이 문서에 포함된 자료, 정보 및 진술은 유가증권, 선물 계약, 구조화 상품, 규제 대상 투자 계약 또는 기타 일체의 투자 상품을 매수하기 위한 제안 또는 권유가 아니며, 여기에 포함된 그 어떤 사항도 거래를 진행시키기 위한 개인의 계약이나 약속의 토대가 되거나, 그와 관련된 근거가 될 수 없습니다. 또한 이 MRAN은 금융상품을 매수 또는 매도하거나, 금융 자문을 제공하거나, 거래 플랫폼을 생성하거나, 예금을 활성화하거나 예치하거나, 그 밖의 금융 상품이나 금융 서비스를 제공하는 제안이나 청탁으로 간주되어서는 안 됩니다.

이 MRAN에서 설명하는 모든 예는 설명을 위한 예시용일 뿐이며, 실제 상황에서 CME Group의 성과를 나타내지 않을 수도 있습니다. 이 MRAN과 그 정보는 (예측 및 그 안에 포함된 향후 전망 진술 포함) CME Group이 작성하였으며 고문이나 대리인이 그 내용을 별도로 검증하지는 않았습니다. 그 특성상, 향후 전망에 대한 진술은 미래에 일어날 수도 있고 일어나지 않을 수도 있는 상황에 따라 많은 변수가 존재하기 때문에 수많은 추측, 위험 및 불확실성의 대상이 됩니다. 향후 전망 보고서는 미래의 성과를 보장하는 것이 아닙니다. 이 MRAN에 수록된 향후 예측에 관한 진술은 해당 진술이 언급된 날짜에만 해당되며, CME Group은 시간의 경과에 따라 해당 진술을 업데이트할 의무를 지지 않습니다. 본 MRAN에서 논의된 모든 상품 및 상품 관련 정보는 변경될 수 있습니다. 그러므로 이에 따른 관련 규정집을 참고하시고 궁금한 사항이 있으시면 CME Group에 문의하십시오.

본 문서에 수록된 규칙 및 명세에 관한 모든 사안은 CME, CBOT, NYMEX 및 COMEX의 공식 규정집(rulebooks)에 따라 언급된 것입니다. 계약 명세와 관련된 사안을 포함하여 모든 경우에 현행 규정을 참조해야 합니다.

CME Group은 본 MRAN에 포함된 일체의 자료나 정보가 모든 관할권 또는 국가에서 사용되거나 허용된다고 진술하지 않으며, 이러한 사용이나 배포가 일체의 관련 법규와 상반될 수 있는 경우에도 마찬가지입니다.

본 공지문은 규제 당국의 검토 또는 승인을 받지 않았으며 사용자는 본인의 책임 하에 본 공지문에 접근해야 합니다. 앞서 언급한 관할권 내에서 이루어지는 모든 거래에 따르는 위험은 관련 투자자가 감수해야 하며, 항상 해당 국가에서 적용되는 현지 법률과 규정을 준수하여 거래가 이루어져야 합니다.

싱가포르에서는 CME Inc., CBOT, NYMEX가 각각 공인 시장 운영자로 규제되고 CME Inc.는 증권 및 선물법(제 289 장)(("SFA"))에 따라 공인 청산소로 규제됩니다. 전술한 바와 같이, CME Group 중 SFA에 따라 규제 활동을 수행하거나 싱가포르의 금융 자문법(제 110 장)에 따라 금융자문 서비스 제공 인가를 받은 기업은 없습니다.

홍콩에서는 홍콩의 어떤 규제 당국도 본 공지문의 내용을 검토하지 않았습니다. 본 공지문에 포함된 정보에 대하여 주의할 것을 권장합니다. 이 공지문의 내용에 대해 조급이라도 의심이 든다면, 독립 전문가의 자문을 받을 것을 권장합니다. CME Group은 홍콩 증권선물 조례에 따라 선물계약을 거래하거나 자문할 수 있는 면허를 소지하고 있지 않습니다.

CME Group, Globe Logo, CME, Globex, E-Mini, CME Direct, CME DataMine, Chicago Mercantile Exchange는 시카고 상업거래소 (Chicago Mercantile Exchange, Inc)의 상표입니다. CBOT와 Chicago Board of Trade는 시카고 시무역위원회 (Board of Trade of the City of Chicago, Inc)의 상표입니다. NYMEX와 ClearPort는 뉴욕 상업거래소 (New York Mercantile Exchange, Inc)의 상표입니다. COMEX는 상품거래소 (Commodity Exchange, Inc)의 상표입니다. 기타 모든 상표는 해당 소유주의 재산입니다. 이를 상표는 이러한 상표를 소유하는 당사자의 서면 허가 없이 수정, 복제, 저작, 전송, 복사, 배포 또는 그 외 다른 방법으로 사용할 수 없습니다. 정보에 접근하는 사람에게 어떤 종류의 권리도 허가, 양도 또는 이전하지 않습니다.

시장규정 권고 공지문

거래소	CME, CBOT, NYMEX, COMEX
주제	대량 거래자, 소유권/통제권 보고서 및 미결제약정 데이터 일일 제출
참조 규정	규정 561
권고일	2020년 9월 28일
권고 번호	CME Group RA2014-5

본 권고 공지문은 2017년 9월 26일 발행된 시장규정 권고 공지문 RA1713-5를 대체하며, 2020년 9월 25일 발행된 CFTC 의견서 [20-30](#)에 적시된 CFTC 시장 감독 부서(Division of Market Oversight)의 비조치 의견서의 연장을 반영하기 위한 목적으로 발행됩니다.

비조치 의견의 연장에 따라, CFTC 서식 102B로 보고하여야 하는 거래량 기준 보고 계좌(volume threshold accounts)의 보고 기준(reporting threshold)은 다음 중 더 이른 시점까지 250 계약으로 유지됩니다. (a) 거래량 기준 보고 기준에 대한 CFTC 조치의 해당 발효일 또는 준수 시한 일자, (b) 2023년 9월 29일.

이 권고 공지문은 CFTC 소유권 및 통제권 보고("OCR") 규정과 관련하여 규정 561의 변화를 지속적으로 반영합니다. 2014년 11월 4일에 발행된 [시장 감독 안내 # MSN11-04-14](#) ("MSN11-04-14")에 언급된 것처럼 CME, CBOT, NYMEX, COMEX ("본 거래소들")는 CFTC의 OCR 규정에 준한 새로운 CFTC 서식 102A 및 102B의 제출을 의무화하며, CFTC의 OCR 규정이 요구하는 바에 따라 새로운 해당 서식들을 본 거래소들에 동일한 서식과 형태로 제출할 것을 요구합니다. 본 거래소들은 새로운 CFTC 102A, 102B 서식을 (CFTC의 OCR 규정에 명시된 대로) XML 파일 형식으로 제출하는 것을 수용하며, 또는 새로운 CFTC 102A, 102B 서식을 개선된 회사 규제 포털(Firm Regulatory Portal, "[FRP](#)")을 통해 수기로 제출하는 것을 수용합니다. XML 형식의 파일은 다음의 파일명으로 제출할 수 있습니다.

[PFTP_OCR_XCME_\[회사 ID\]_\[YYMMDD\]_\[HHMMSS\].xml](#) or
[PFTP_OCR_XCME_\[회사 ID\]_\[YYMMDD\]_\[HHMMSS\]_\[UNIQUIFIER\].xml](#)

CME/CBOT/NYMEX/COMEX 규정 561의 텍스트는 본 권고 공지문의 말미에 기재되어 있습니다.

CFTC 서식 102A 제출

보고 당사자들은 시장규제부에 처음으로 보고 대상이 된 각 계좌에 대하여 소유주, 관리자, 관리 계좌 및 서식에 요구된 일체의 정보를 정확하게 기재한 CFTC 서식 102A("특수 계좌의 식별")를 전자적으로 제출하여야 합니다.

완전한 CFTC 서식 102A 정보는 반드시 해당 계좌가 처음 보고 대상이 된 날로부터 삼(3)영업일 이내에 제출되어야 합니다. 그러나 시장규제부는 특수 계좌 유형, 보고 번호 및 이름, 자기매매 또는 고객거래 표식을 포함한 예비 계좌 정보를 해당 계좌가 처음으로 보고 대상이 된 날로부터 일(1) 영업일 이내에 제출할 것을 요구합니다.

시장규제부는 중대한 변화가 발생하여 기 제출된 정보가 부정확해진 계좌에 대해서는 업데이트된 보고서를 요구합니다. 업데이트된 보고서는 그러한 변화가 유효해지는 날로부터 삼(3)영업일 이내에 제출하여야 합니다. 중대한 변화에는 계좌명, 주소, 소유주, 관리자 또는 통제되는 계좌의 변화가 포함됩니다. 전술된 내용에도 불구하고, 시장규제부는 필요에 따라 동 부서가 필요하다고 판단하는 일체의 계좌에 대하여 업데이트를 요구할 수 있습니다.

특정 계좌가 만료/폐쇄된 것으로 간주되었다고 CFTC에 통지한 경우, 시장규제부에도 유사한 통지서를 반드시 제출하여야 합니다.

CFTC 서식 102B 제출

청산회원은 단일 거래일 중 250 계약 이상의 거래량 기준 보고 요건을 충족하는 거래 계좌에 대해 새로운 CFTC 서식 102B를 제출하도록 요구됩니다.

완전한 CFTC 양식 102B 정보는 반드시 해당 계좌가 처음으로 보고 대상이 된 날로부터 삼(3) 영업일 이내에 제출되어야 합니다. 그러나 시장규제부는 거래량 기준 보고 계좌(*volume threshold account*)에 대한 거래 계좌 정보, 관련 특수 계좌 번호 및 거래량 기준 보고 계좌 소유주(들)과 같은 예비 계좌 정보를 해당 계좌가 처음으로 보고 대상이 된 날로부터 일(1)영업일 이내에 제출할 것을 요구합니다.

시장규제부는 중대한 변화가 발생하여 기 제출된 정보가 부정확해진 계좌에 대해서는 업데이트된 신고서를 요구합니다. 업데이트된 신고서는 그러한 변화가 유효해지는 날로부터 삼(3)영업일 이내에 제출하도록 규정되어 있습니다. 중대한 변화에는 계좌명, 주소, 소유주, 관리자 또는 통제되는 계좌의 변화가 포함됩니다. 전술된 내용에도 불구하고, 시장규제부는 필요에 따라 둘 부서가 필요하다고 판단하는 계좌에 대하여 업데이트를 요구할 수 있습니다.

특정 계좌가 만료/폐쇄된 것으로 간주되었다고 CFTC에 통지하는 경우, 시장규제부에도 유사한 통지서를 반드시 제출하여야 합니다.

CME Group 회사 규제 포털(Firm Regulatory Portal)

CME Group 회사 규제 포털("FRP")은 정확하고 적시적인 계좌 및 포지션 보고를 지원하기 위해 다양한 보고서와 화면을 제공합니다.

FRP는 보고 대상 청산 회원이 대형 거래자 보고와 미결제 약정의 비교 보고서(보고 오류 리포트, "Misreporting Report")를 상품별, 계약월별, 그리고 옵션의 경우 행사가별로 생성할 수 있도록 개선되었습니다. 아울러 청산 회원은 "보고 오류 리포트"를 사용하여 보고된 포지션을 조회하고, 포지션 상계 및 각 포지션의 과대 보고 · 보고 누락과 같은 주가적인 잠재적 보고 오류를 식별하는 데에 도움이 되도록 정해진 쿼리 옵션(static queries)을 활용할 수 있습니다. 일체의 필요한 수정 사항을 수정 마감 시한까지 보고하기 위하여, 시장규제부는 보고 대상 회사들이 잠재적 보고 오류를 식별하는 데 도움이 되는 이 기능을 활용할 것을 강력히 권장합니다.

청산 회원과 옴니버스 계좌의 OCR 보고 업무를 지원하기 위해 최근에 FRP를 개선하였습니다. "식별되지 않은 특수계좌 리포트(Unidentified Special Accounts Reports)"를 활용하여 보고 대상 회사는 본 시장규제부가 아무런 계좌 정보를 보유하고 있지 않은 계좌에 대한 CFTC 서식 102A와 102B를 확인할 수 있습니다. FRP 포털은 보고 대상 회사가 CFTC 서식 102A와 102B에 계좌 정보를 수기로 입력할 수 있는 다양한 화면 또한 제공합니다.

FRP는 등록된 CME Group 로그인 아이디를 사용하여 <https://fltr.cmegroup.com/firmregulatoryportal/logon.jsp>에서 접속할 수 있으며 MarketRegLTRAlerts@cmegroup.com에 권한을 요청하면 됩니다. CME Group 로그인 아이디의 등록 방법은 [FRP 홈페이지](#)에서 확인하십시오. 기술적 문제에 대한 문의는 MarketRegLTRAlerts@cmegroup.com으로 연락하시기 바랍니다.

[FRP](#)에서는 매뉴얼도 제공됩니다.

옴니버스 계좌 보고

규정 561에 의거하여 보고 대상 포지션을 보유한 옴니버스 계좌는 반드시 보고 대상이 되는 대형 거래자 포지션을 보안 FTP("SFTP")를 통해 CME Group 파일 서버에 전송하여 시장규제부에 직접 제출해야 합니다. 옴니버스 보고 대상 기관은 CFTC가 지정한 알파 회사 ID(alpha firm ID)를 사용하여 대형 거래자 포지션을 제출할 수 있습니다. 특정 옴니버스 기관이 현재 대형 거래자 포지션을 제출하지 않고 있고 SFTP 제출 기능이 설정되어 있지 않으면, 해당 기관은 본 시장규제부의 [대량 거래자 그룹](#)(Large Trader Group)에 연락하여 자세한 보고 지침을 요청하십시오. 옴니버스 기관은 다음의 대량 거래자 파일 레이아웃을 사용할 수 있습니다.

<http://www.cftc.gov/IndustryOversight/MarketSurveillance/LargeTraderReportingProgram/ltrformat.html>

정확한 미결제 약정 및 대량 거래자 포지션의 보고를 보장하기 위해 청산 회원은 옴니버스 계좌를 포함하여 자사가 보유한 모든 계좌의 상계 지시(**offset instruction**)를 적시적으로 획득해야 합니다. 청산 회원은 자사의 장부에 옴니버스 계좌로 보유한 계좌에 대하여 정확한 포지션을 보고할 의무가 있습니다. 따라서 청산 회원은 옴니버스 계좌의 모든 포지션 상계가 아래에 명시된 수정 마감 시한 이전에 적시적으로 보고되도록 하기 위해 적절한 절차를 반드시 수립하여야 합니다.

CFTC 서식 40 제출

시장규제부서는 필요하다고 판단할 때마다 CFTC 서식 40의 제출을 요구할 수 있습니다.

정확하고 적시적인 보고 요건

미결제 약정, 대형 거래자 포지션, 그리고 해당하는 경우, 인도 가능 매수 포지션을 규정된 제출 마감 시한에 맞춰 정확하게 보고할 책임은 청산 회원과 옴니버스 계좌 측에 있음을 모든 청산 회사와 옴니버스 계좌에 다시 알립니다. 이 요건에는 옵션 배정에서 비롯되는 미결제 약정과 대량 매매자 포지션을 정확하게 보고하는 것이 포함됩니다.

미결제 약정(PCS) 제출: 모든 CME Group 거래소들의 PCS 수정 보고 제출 마감 시간은 오전 8:15 CT / 오전 9:15 ET

대량 거래자 보고: 오전 7:00 CT / 오전 8:00 ET, 모든 CME Group 상품의 경우

대량 거래자 수정 보고: 오전 9:00 CT/ 오전 10:00 ET, 모든 CME Group 상품의 경우.
대량 거래자 포지션에 관련된 오류 수정이나 일체의 다른 수정 사항은 웹
기반 회사 규제 포털(“**FRP**”) 애플리케이션을 사용해 작성하여 보고할 수
있습니다.

선물 계약의 특정 만기월, 또는 특정 옵션 계약 만기월의 모든 풋 또는 모든 콜 포지션이 보고 대상 기준 이상인 포지션은 보고되어야 합니다. 특정 계약에 보고 대상 포지션이 있는 계좌의 경우, 그 규모에 상관없이 모든 계약월의 계약 및 해당 계약과 합산되는 일체의 계약이 반드시 보고되어야 합니다. 각 거래소 규정집 5장의 말미에 나오는 포지션 한도 · 포지션 책임 수준 도표가 합산 관계를 명시합니다. 일체의 보고 대상이 되는 계약을 보유한 계좌에 대하여 각 거래소 규정집 5장의 말미에 나오는 "포지션 한도, 포지션 책임 및 보고 대상 수준 도표" 상의 당월(spot month), 개별 월(single month) 및 전체 월(all month) 합산 대상 구간(1) 과 구간(2) 행에 표시된 대로 당월, 개별 월 및 전체 월 합산 선물 대상 구간 (1)과 (2) 열에 표시된 "하나로 합산되는" 계약들이 모두 보고되어야 합니다.

위에 언급된 보고 의무를 준수하지 못하는 경우, CME, CBOT, NYMEX, COMEX 의 규정 512에 따라 제재로 이어질 수 있습니다.

본 권고 공지문과 관련한 질문이 있으시면 다음의 시장규제서 담당자에게 문의하십시오.

Minju Kang, Manager, Rules & Regulatory Outreach, +82 2 6297 0252

또는 Minju.Kang@cme.com

Lou Abarcar, Data Investigations Architect, 312.341.3236 or Lou.Abarcar@cme.com

Danyelle Franks, Lead Data Investigator, 312.341.7646 또는 Danyelle.Franks@cme.com

Erin Middleton, Senior Director, Rules and Regulatory Outreach, 312.341.3286 또는

Erin.Middleton@cme.com

Trenton Crawford, Senior Specialist, Rules & Regulatory Outreach, 312.307.9006, or

Trenton.Crawford@cme.com

본 권고 공지문과 관련한 미디어 문의는 312.930.3434 또는 news@cme.com을 통해 CME Group의 기업홍보팀으로 연락하시기 바랍니다.

CME/CBOT/NYMEX/COMEX

규정 561. 대량 거래자 포지션 및 거래량 기준 보고 계좌

561.A. 대량 거래자 보고 (Large Trader Reporting)

청산 회원, 옴니버스 계좌 및 해외 브로커는 5장 말미의 "해석 섹션"의 포지션 한도, 포지션 책임 및 보고 대상 기준 도표("포지션 한도 도표")에 명시된 대로 보고 의무가 있는 모든 대량 거래자의 일일 포지션 보고서를 제출해야 한다.

선물 계약의 특정 만기월, 특정 옵션 계약 만기월의 모든 풋이나 모든 콜 포지션, 또는 거래소에 상장된 스왑 계약의 보고 대상 기준(reportable level) 이상의 포지션은 보고되어야 한다. 특정 계약에 보고 대상 포지션이 있는 계좌의 경우, 그 규모에 상관없이 모든 계약 월의 계약 및 해당 계약과 합산되는 일체의 계약을 반드시 보고해야 한다.

아울러 본 거래소에 제출되는 일일 대량 거래자 포지션 보고서에는 각 보고 대상 계좌의 1) 보고 대상 상품의 계약월별 EFRP 매수·매도 거래량, 그리고 EOO의 경우 풋(put) 및 콜(call) 행사가별 매수·매도 거래량, 그리고 2) 보고 대상 상품의 인도 통지서 발행(issued) 건수 및 배정된(stopped) 인도 건수를 포함하여야 한다.

대량 거래자 보고서 외에 추가로, 청산 회원, 옴니버스 계좌 및 해외 브로커들은 각 보고 대상 계좌의 소유주, 관리자, 관리 계좌 및 서식에 요구된 일체의 정보를 정확하게 기재하여 각 해당 계좌가 신고 대상이 된 날로부터 3영업일 이내에 CFTC 서식 102A ("특수 계좌의 식별")를 본 거래소에 전산으로 제출하여야 한다. 3영업일 기준 제출 요건에도 불구하고, 특정 계좌가 보고 대상이 되는 첫날 청산 회원, 옴니버스계좌 및 해외 브로커들은 본 거래소의 지시에 따라, 다음의 정보를 제공하여야 한다. 계좌 유형, 보고 대상 계좌번호, 해당 계좌의 소유주 및 관리자 이름과 주소.

본 거래소는 매일 하나 이상의 대량 거래자 포지션 보고서 제출을 요구할 수 있다. 비즈니스 윤리 위원회(Business Conduct Committee)나 시장규제부는 일체의 청산 회원, 옴니버스 계좌나 해외 브로커에게 포지션 한도, 포지션 책임 및 보고 대상 수준 도표에 표시된 것보다 작은 규모의 포지션에 대한 보고서나 추가의 계좌 식별 정보를 제출할 것을 요구할 수 있다.

중대한 변화로 인하여 본 거래소에 기 제출한 정보가 부정확해진 경우, 청산 회원, 옴니버스 계좌나 해외 브로커는 그러한 변화가 발생한 날로부터 3영업일 이내에 정확한 정보를 기재하여 업데이트된 서식을 본 거래소에 전산으로 반드시 제출하여야 한다. 추가로, 일체의 중대한 변화가 없을 경우, 본 거래소는 정확한 기록의 관리를 위해 매년 새로 서식을 제출하도록 요구할 수 있다. 중대한 변화에는 계좌명, 주소, 소유주, 관리자 또는 관리되는 계좌의 변화가 포함(단, 이에 국한되지는 않음)된다.

561.B. 거래량 기준 보고 (Volume Threshold Reporting)

거래량 기준 보고 계좌(volume threshold account)는 CFTC 규정 15.04에 정의된 대로 "단일 거래일"에 거래된 계약의 거래량 보고 기준을 초과하여 보고 대상이 되는 계좌를 말한다. 청산회원사는 소유주, 관리자, 관리 계좌 및 보고서 서식이 요구하는 일체의 추가 정보를 포함한 거래량 기준 보고 계좌의 계좌 정보를 정확하게 기재하여 해당 계좌가 보고 대상이 된 첫날로부터 3영업일 이내에 CFTC 양식 102B("거래량 기준 보고 계좌 식별(Identification of Volume Threshold Accounts)")를 본 거래소에 전산으로 제출하여야 한다. 3영업일 기준 제출 요건에도 불구하고, 특정 계좌가 보고 대상이 되는 첫날 청산회원사, 옴니버스계좌 및 해외 브로커들은 본 거래소의 지시에 따라, 다음의 정보를 제공하여야 한다. 계좌 유형, 보고 대상 계좌 번호, 해당 계좌의 소유주 및 관리자 이름과 주소.

중대한 변화로 인하여 본 거래소에 기 제출한 정보가 부정확해진 경우, 청산회원사, 옴니버스 계좌나 해외 브로커는

그러한 변화가 발생한 날로부터 3일(영업일 기준) 이내에 정확한 정보를 기재하여 업데이트된 서식을 본 거래소에 전산으로 반드시 제출하여야 한다. 추가로, 일체의 중대한 변화가 없을 경우, 본 거래소는 정확한 기록의 관리를 위해 매년 새로 서식을 제출하도록 요구할 수 있다. 중대한 변화에는 계좌명, 주소, 소유주, 관리자 또는 관리되는 계좌의 변화가 포함(단, 이에 국한되지는 않음)된다.

561.C. 옴니버스 계좌 및 해외 브로커의 의무

옴니버스 계좌나 해외 브로커가 요구된 정보를 제출하지 못하면 비즈니스 윤리 위원회(Business Conduct Committee)의 공청회에 회부될 수 있으며, 그러한 옴니버스 계좌나 해외 브로커의 거래소 시장에 대한 액세스의 제한, 조건부 접속 또는 거부로 이어질 수 있다. 전술된 내용에도 불구하고, 그러한 계좌들을 지닌 청산 회원은 옴니버스 계좌나 해외 브로커가 본 거래소에 해당 정보를 제출하지 못한 경우, 포지션의 소유주 및 통제권과 관련한 정보를 입수하여 본 거래소에 제출할 책임을 지닌다. 청산 회원은 반드시 자사 고객이 일체의 중대한 변화를 포함하여, 정확하고 적시적인 소유주 및 통제권 정보를 제공하도록 요구하여야 한다.

본 거래소의 요청 시, 청산 회원, 옴니버스 계좌 및 해외 브로커는 반드시 CFTC 양식 40을 제출하여야 한다.

561.D. 보고 기준

모든 계약의 대량 거래자 보고 대상 기준은 5장 말미의 해석 섹션에 나오는 "포지션 한도, 포지션 책임 및 보고 대상 수준 도표("포지션 한도 도표")에 명시되어 있다.

단일 거래일에 특정 만기월의 선물 계약 또는 특정 옵션 계약 만기월의 모든 풋이나 모든 콜 50계약 이상을 거래한 계좌는 보고 대상 거래량 기준 보고 계좌(volume threshold account)에 해당한다. [현행 CFTC 비조치 의견서에 따라 보고 대상으로 간주되는 거래량 기준 보고 계좌(volune threshold account)의 기준은 250계약 이상으로 한다.]