

아시아 시장에 대한 면책조항

선물 및 스왑 거래는 모든 투자자에게 적합한 것은 아니며 원금손실의 위험이 따릅니다. 선물 및 스왑은 레버리지를 이용하는 투자이며 계약금액의 일정 비율만으로도 거래가 가능하기 때문에 선물 및 스왑 포지션에 예치된 증거금 이상의 손실을 입을 수도 있습니다. 따라서 거래 시 손해를 보더라도 타격을 입지 않을 정도의 자금만을 이용하는 것이 바람직합니다. 또한 모든 거래에서 수익을 기대할 수는 없으므로 한 번의 거래에는 이러한 자금 중 일부만을 투자하는 것이 좋습니다.

본 자료상의 모든 정보 및 기타 자료들을 금융상품에 대한 매수/매도의 제안이나 권유, 금융 관련 자문의 제공, 거래 플랫폼의 구축, 예치금의 활용 또는 수취, 관할권과 유형을 막론한 다른 어떠한 것이든지 금융상품 또는 금융서비스의 제공을 위한 것으로 받아들여져서는 안 됩니다. 본 자료상의 정보는 정보전달의 목적으로만 제공되며 자문을 제공하고자 하는 목적이 아닐뿐더러 자문으로 받아들여져서도 안 됩니다. 본 정보는 개개인의 목표, 재정적 여건 또는 필요를 고려하지 않았습니니다. 본 자료에 따라 행동을 취하거나 이에 의존하기에 앞서 적절한 전문가의 조언을 구하시기 바랍니다.

본 자료상의 정보는 있는 그대로 받아들여져야 하며 명시적이든 묵시적이든 그 내용에 대하여 어떠한 종류의 보증도 하지 않습니다. CME 그룹은 어떠한 오류나 누락에 대하여도 아무런 책임을 지지 않습니다.

본 자료는 CME 그룹이나 또는 그 임직원, 또는 대리인에 의하여 고안되거나 확인 또는 검증되지 않은 정보를 포함하거나 해당 정보에 대한 링크를 제공할 수 있습니다. CME 그룹은 해당 정보에 대해 어떠한 책임도 지지 않으며, 정보의 정확성이나 완전성을 보장하지 않습니다. CME 그룹은 해당 정보 또는 제공되는 하이퍼링크가 제 3자의 권리를 침해하지 않음을 보장하지 않습니다. 본 자료가 외부 웹사이트로의 링크를 포함하고 있을 경우라도, CME 그룹은 어떠한 제 3자 또는 그들이 제공하는 서비스 및 상품에 대하여도 지지 또는 권고, 승인, 보증이나 소개를 하는 것이 아닙니다.

CME 그룹 및 “芝商所”는 CME Group Inc.의 상표입니다. Globex 로고, E-mini, E-micro, Globex, CME 및 Chicago Mercantile Exchange 는 Chicago Mercantile Exchange Inc. (‘CME’)의 상표입니다. CBOT 및 Chicago Board of Trade 는 Board of Trade of the City of Chicago, Inc. (‘CBOT’)의 상표입니다. ClearPort 및 NYMEX 는 New York Mercantile Exchange, Inc. (‘NYMEX’)의 상표입니다. 이들 상표는 그 소유권자의 서면 승인 없이 수정, 복제, 검색시스템에 저장, 전송, 복사, 배포 또는 사용될 수 없습니다.

Dow Jones 는 Dow Jones Company, Inc.의 상표입니다. 그 외의 모든 상표는 각 해당 소유자의 자산입니다.

본문에서 규정 및 상품명세에 대해 언급한 모든 내용은 CME, CBOT, NYMEX 의 공식 규정에 따른 것이며 이 공식 규정은 본문 내용에 우선합니다. 계약 명세와 관련한 모든 경우에 있어서 현행 규정을 참고해야 합니다.

CME 와 CBOT 및 NYMEX 는 각각 싱가포르에서 Recognized Market Operator (공인시장운영자)로 등록되어 있으며 홍콩특별행정구(Hong Kong S.A.R.)의 Automated Trading Service (자동매매서비스) 제공자로 승인을 받았습니다. 뿐만 아니라 본 자료 상의 정보는 일본 법률 제 25 호 금융상품거래법(1948 년, 개정)에 의한 어떠한 해외금융상품시장에 대한 직접적인 접근이나 또는 해외금융상품시장 거래에 대한 청산서비스를 제공하는 것으로 간주할 수 없습니다. 일본 등 아시아의 어떤 관할권에서도 어떠한 유형의 금융서비스도 제공자로서, 또는 제공할 수 있을 것으로 간주될 만한, 등록이나 허가를 받지 않았습니니다. CME 그룹 산하의 어떤 기관도 중국 또는 대만의 어떠한 금융서비스에 대하여도 이를 제공하거나 제공할 수 있을 것으로 간주될 만한 등록이나 허가를 받지 않았습니니다. 본 자료는 한국 및 호주에서 각각 자본시장법 제 9 조 5 항 및 2001 년 기업법(C)와 그 관련 규정상의 정의에 의한 “전문투자자” 에의 배포를 위한 것으로서 그에 따라 배포가 제한됩니다.

시장 규정 권고 공지문

거래소	CME, CBOT, NYMEX, COMEX
주제	대량 거래자, 소유권/통제권 보고서 및 미결제약정 데이터 일일 제출
참조 규정	규정 561
권고일	2017년 9월 26일
권고 번호	CME 그룹 RA1713-5

본 권고 공지문은 2017년 1월 10일 발행된 시장 규정 권고 공지문을 대체하며, 2017년 9월 25일 발행된 CFTC 의견서 [17-45](#)에 적시된 CFTC 시장 감독 부서(Division of Market Oversight)의 비조치 의견서 내용을 반영하기 위한 목적으로 발행됩니다.

이 비조치 의견서에 따르면 CFTC 서식 102B로 보고하여야 하는 거래량 기준 보고 계좌(volume threshold accounts)의 보고 기준(reporting threshold)은 다음 중 더 이른 시점까지 250계약으로 유지됩니다. (a) 거래량 기준 보고 기준에 대한 CFTC 조치의 해당 발효일 또는 준수 시한 일자 중 더 늦은 날짜와 (b) 2020년 9월 28일. 해당 비조치 의견에 따라 본 권고 공지문의 CFTC 서식 102B 제출 섹션을 수정합니다.

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_[FIRMID]_[YYMMDD]_[HHMMSS].xml or
PFTP_OCR_XCME_[FIRMID]_[YYMMDD]_[HHMMSS]_[UNIQUEIFIER].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 102B 를 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 동 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 그룹 회사 규제 포털(Firm Regulatory Portal)

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

FRP 는 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 추가적인 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 FRP 를 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 102A 와 102B 를 확인할 수 있습니다. FRP 포털은 보고 대상 회사가 CFTC 서식 102A 와 102B 에 계좌 정보를 수기로 입력할 수 있는 다양한 화면 또한 제공합니다.

FRP 는 등록된 CME Group 로그인 아이디를 사용하여 <https://fltr.cmegroup.com/firmregulatoryportal/logon.jsp> 에서 접속할 수 있으며 MarketRegLTRAlerts@cmegroup.com 에 권한을 요청하면 됩니다. CME Group 로그인 아이디의 등록 방법은 [FRP 홈페이지](#) 에서 확인하십시오. 기술적 문제에 대한 문의는 MarketRegLTRAlerts@cmegroup.com 으로 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 그룹 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: 오후 6:00 미국중부표준시(CT) / 오후 7:00 ET, NYMEX 및 COMEX
상품의 경우
오후 7:30 CT / 오후 8:30 ET, CME 및 CBOT 상품의 경우

미결제 약정(PCS) 제출: 모든 CME 그룹 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 그룹 상품의 경우

대량 거래자 수정 보고: 오전 9:00 CT/ 오전 10:00 ET, 모든 CME 그룹 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, COMEX의 규정 512에 따라 제재로 이어질 수 있습니다.

본 권고 공지문과 관련한 질문이 있으시면 다음의 시장규제서 담당자에게 문의하십시오.

Sandra Valtierra, Manager, 312.347.4137, 또는 Sandra.Valtierra@cmegroup.com

Danyelle Franks, Sr. Database Integrity Admin., 312.341.7646, 또는 Danyelle.Franks@cmegroup.com

Erin Middleton, Manager, Rules and Regulatory Outreach, 312.341.3286 또는

Erin.Middleton@cmegroup.com

본 권고 공지문과 관련한 미디어 문의는 CME 그룹의 기업홍보팀 312.930.3434 또는 news@cmegroup.com 에 문의하십시오.

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, 또는 특정 옵션 계약 만기월의 모든 풋이나 모든 콜의 포지션이 보고 대상 기준에 이른 포지션을 보고할 의무가 있다. 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

옵니버스 계좌나 해외 브로커가 요구된 정보를 제출하지 못하면 비즈니스 윤리 위원회(Business Conduct Committee)의 공청회에 회부될 수 있으며, 그러한 옵니버스 계좌나 해외 브로커의 거래소 시장에 대한 액세스의 제한, 조건부 접속 또는 거부로 이어질 수 있다. 전술된 내용에도 불구하고, 그러한 계좌들을 지닌 청산 회원은 옵니버스 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, 옵니버스 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(volume threshold account)의 기준은 250계약 이상으로 한다.]*