

此为所附《市场规范建议通告》(Market Regulation Advisory Notice) (“MRAN”) 英文原文之译本；正式文本为 MRAN 英文版。尽管我们已尽合理努力提供准确翻译，但若对 MRAN 译本所提供信息有任何疑问，请查阅 MRAN 英文版。任何由于翻译造成之差异或分歧不具约束力且无法律效力。

市场监管建议通告

交易所	芝加哥商品交易所 (CME)、芝加哥商品期货交易所 (CBOT)、纽约商业交易所 (NYMEX) 和纽约商品交易所 (COMEX)
主题	每日提交大额交易商、所有权/控制权报告以及未平仓合约数据
规则参考	规则 561
建议日期	2017 年 9 月 26 日
建议编号	芝商所 RA1713-5
生效日期和合规日期	见下文

本建议通告将取代 2017 年 1 月 10 日的市场监管建议通告 RA1605-5R，其发布是由于 CFTC 市场监管部门于 2017 年 9 月 25 日发布之 CFTC 函件 [17-45](#) 上所载的无行动暂免导致。

根据无行动暂免，CFTC 表格 102B 内报告交易量门槛账户的交易量门槛将维持在 250 份合约，直到以下两种情况有一种先发生：(a) 某个处理报告交易量门槛之 CFTC 行动的相关生效日期或合规日期（以后者为准），及(b) 2020 年 9 月 28 日。因无行动暂免之故，本建议通告 CFTC 表格 102B 提交部分已予修改。

本建议通告继续反映有关 CFTC 所有权和控制权报告 (“OCR”) 规则对规则 561 作出的更改。正如在 2014 年 11 月 4 日的市场监控通知# MSN11-04-14 (“MSN11-04-14”) 中所指出，CME、CBOT、NYMEX 和 COMEX (“各交易所”) 要求按 CFTC 之 OCR 规则提交新 CFTC 表格 102A 和 102B，并要求按 CFTC 之 OCR 规则所规定的相同格式和方式提交该等新表格。交易所接受以 XML 格式文件（如 CFTCOCR 规则所定义）提交新 CFTC 表格 102A 和 102B，或通过升级的机构监管平台 (“FRP”) 人工提交新 CFTC 表格 102A 和 102B。XML 格式文件可以下述文件名进行提交：

PFTP_OCR_XCME_[FIRMID]_[YYMMDD]_[HHMMSS].xml 或
PFTP_OCR_XCME_[FIRMID]_[YYMMDD]_[HHMMSS]_[UNIQUEIFIER].xml

本建议通告的末尾列出了 CME/CBOT/NYMEX/COMEX 规则 561 的文本。

CFTC 表格 102A 提交

报告方需要向市场监管部 (Market Regulation Department) 提交一份电子形式的 CFTC 表格 102A (“特殊账户识别”), 准确地识别所有人、控制人、受控制账户以及表格对每个首次应报告 账户要求的任何额外信息。

完整的 CFTC 表格 102A 信息必须在账户成为应报告的首日后三 (3) 个营业日内提交。但是, 市场监管部要求 在账户成为应报告的首日后一 (1) 个营业日内提交初步账户信息, 包括 *特殊账户起源、报告编号和名称以及机构或客户指示标志*。

市场监管部要求为因重大变化造成先前提交之信息不准确的账户提供更新后的报告。更新后的报告需要在 该等变化生效后三 (3) 个营业日内提交。重大变化包括账户名称、地址、所有人、控制人或受控制账户的变化。尽管有上述规定, 市场监管部也可以根据需要要求对其认为必要更新的任何账户进行更新。

如果关于账户被视为已过期/已关闭的通知被提交至 CFTC, 则类似的通知也必须向市场监管部提交。 **CFTC 表**

格 102B 提交

清算会员需要为单个交易日达到 250 份或以上合约交易量门槛的交易账 户提交新的 CFTC 表格 102B。

完整的 CFTC 表格 102B 信息必须在账户根据修订后的规则成为应报告账户的首日后三 (3) 个营业日内提交。 但是, 市场监管部将要求在账户成为应报告账户首日后一 (1) 个营业日内提交初步账户信息, 例如 交易量 门槛账户的交易账户数据、关联特殊账号以及交易量门槛账户所有人。

市场监管部要求为因重大变化造成先前提交之信息不准确的账户提供更新后的报告。 更新后的报告需要在 该等变化生效后三个营业日内提交。重大变化包括账户名称、地址、所有人、控制人 或受控制账户的变化。尽管有上述规定, 市场监管部也可以根据需要要求对其认为必要更新的任何账户进行更新。

如果关于账户被视为已过期/已关闭的通知被提交至 CFTC, 则类似的通知也必须向市场监管部提交。

芝商所机构监管平台

芝商所机构监管平台 ([“FRP”](#)) 提供各种报告和屏幕以协助完成及时准确的账户和头寸报告。

FRP 已经被升级以允许报告的清算机构能够按产品、合约、合约月份以及行权价格 (针对期权) 生成大额交 易商和未平仓合约比较报告 (“错报报告”, “Misreporting Report”)。错报报告也允许清算会员机构 查询 报告的头寸以及利用静态查询帮助识别额外的潜在的报告不符之处, 例如潜在的头寸抵消以及头寸报 告过度 或不足。市场监管部强烈鼓励机构利用此项功能帮助识别潜在的报告不符之处, 以确保在规定的调整截止时间 之前提交任何必要的调整。

FRP 近期增强了帮助清算机构和综合账户 (Omnibus Accounts) 进行 OCR 报告的功能。

未识别特殊账户报告(Unidentified Special Accounts)允许报告机构识别市场监管部没有任何账户信息的 CFTC 表格 102A 和 102B 账户。FRP 平台也有允许报告机构为 CFTC 表格 102A 和 102B 账户手动输入账户信息的屏幕。

可以在下列网址使用注册的 SMART Click ID 登入 FRP:

<https://ftr.cmegroup.com/firmregulatoryportal/logon.jsp>, 也可以发送电子邮件至 MarketRegLTRAAlerts@cmegroup.com 申请平台登入。获取 SMART Click ID 的注册说明可以在 FRP 主页上找到。若有技术问题, 请发送电子邮件至 LargeTraderSupport@cmegroup.com。

FRP 上提供了使用手册。

综合账户报告

依照规则 561, 持有应报告头寸的综合账户 (Omnibus Account) 必须通过芝商所文件服务器安全 FTP (“SF TP”) 直接向市场监管部提交大户持仓报告。综合报告实体(Omnibus Reporting Entities)可以使用 CFTC 分配的阿尔法机构 ID 提交大户持仓。如果综合实体目前没有提交大户持仓 (大额交易商头寸, Large Trader Position) 并且也没有设置为通过 SFTP 提交, 那么, 该实体应联系 [市场监管部大额交易商组 \(Large Trader Group\)](#) 以获得进一步的报告指引。综合实体可以使用下列大额交易商文件格式: <http://www.cftc.gov/IndustryOversight/MarketSurveillance/LargeTraderReportingProgram/ltrformat.html>

为了确保准确的未平仓合约和大户持仓, 清算会员要获得他们所管理的所有账户的及时的头寸抵消说明, 包括综合账户。清算会员负责综合性地准确报告他们的账簿上载有之账户的头寸。因此, 清算会员必须要有适当的程序确保综合账户的任何头寸抵消得到及时报告, 不得迟于下文规定的调整截止时间。

CFTC 表格 40 提交

市场监管部在其认为必要的情况下可能会要求提交 CFTC 表格 40。

准确和及时报告要求

所有清算机构和综合账户应注意他们有责任按照要求的提交截止期限准确地报告未平仓合约、大户持仓以及在适用的时候报告符合交割条件的多头仓位。这项要求包括确保因期权履约指派产生的未平仓合约和大户持仓是准确的。

未平仓合约 (PCS) 提交:	NYMEX 和 COMEX 产品为美国中部时间下午 6:00/东部时间下午 7:00 CME 和 CBOT 产品为中部时间下午 7:30/东部时间下午 8:30
未平仓合约 (PCS) 调整:	所有芝商所旗下交易所 PCS 调整的截止时间是美国中部时间上午 8: 15/ 东部时间上午 9:15
大额交易商提交:	所有芝商所交易所产品为美国中部时间上午 7:00/东部时间上午 8:00
大额交易商调整:	所有芝商所交易所产品为美国中部时间上午 9:00/东部间区上午 10: 00 对大户持仓文件的错误更正或任何其它调整可以使用机构监管平台 (“FRP”) 的网络应用程序完成。

达到或高于期货合约某一特定到期月或者某一特定期权合约到期月所有看涨或看跌期权应报告水平的头寸 必须进行报告。对于某一特定合约内应报告头寸的账户, 任何合约月和任何与该合约并集的任何合约之所

有头寸（不论大小）都必须报告。各交易所规则手册第5章末尾释义部分中头寸限制、头寸责任和应报告水平表确立并集关系。如果任何合约中的某个账户处于可报告状态，则各交易所规则手册第5章末尾释义部分中头寸限制、头寸责任和应报告水平表中现货月、单月及所有月份并集成期货等效边第(1)列和第(2)列所述之所有“并集成”合约必须进行报告。

未能遵守以上任何报告要求可能会导致依照 CME、CBOT、NYMEX 和 COMEX 规则 512 的处罚。关于本建议通告若

有问题，可以联系下列市场监督人员：

Sandra Valtierra, 经理, +1 312.347.4137 或 Sandra.Valtierra@cmegroup.com

Danyelle Franks, 数据库高级管理员, +1 312.341.7646 或 Danyelle.Franks@cmegroup.com

Erin Middleton, 规则与监管拓展主管专员, +1 312.341.3286 或 Erin.Middleton@cmegroup.com

有关本建议通告的媒体垂询，请联系芝商所公司传讯部，电话：312.930.3434 或 news@cmegroup.com。

CME/CBOT/NYMEX/COMEX 规则 561. 大户持仓和交易量门槛账户

1561. A. 大户报告

清算会员、综合账户和外国经纪商应以电子形式向交易所提交按交易所规则手册第5章末尾释义部分中头寸限制、头寸责任和应报告水平表所述须进行报告的所有头寸的每日大户持仓报告。

达到或高于期货合约某一特定到期月或者某一特定期权合约到期月所有看涨或看跌期权应报告水平的头寸必须进行报告。对于某一特定合约内应报告头寸的账户，任何合约月和任何与该合约集的任何合约的所有头寸（不论大小）都必须报告。

对于每个应报告账户，向交易所提交的每日大户持仓报告还必须包括 1) 按合约月划分（若是 E00，按看涨和看跌行权划分）的应报告产品的卖出和买入 EFRP 交易量以及 2) 对应报告产品的发出的交割通知数量和停止的交割数量。

除大户持仓报告外，清算会员、综合账户和外国经纪商必须在问题账户成为应报告账户首日的三个营业日内，以电子形式向交易所提交所需的 CFTC 表 102A（“特殊账户识别”），准确识别所有人、控制人、受控制账户和每个应报告账户所需的任何额外信息。尽管有在三个营业日内提交表格的要求，清算会员、综合账户和外国经纪商必须在交易所的指导下，在该账户成为应报告账户的首日内提供下列信息：账户类型、应报告账号以及账户所有人和控制人的姓名和地址。

交易所可要求每日以电子形式提交多于一份的大户持仓报告。商业行为委员会或市场监管部有权要求持有头寸数量少于头寸限制、头寸责任和应报告水平表所述头寸的任何清算会员、综合账户或外国经纪商提交报告或额外账户信息。

若任何重大变化导致先前提交给交易所的信息变得不准确，则该清算会员、综合账户或外国经纪商必须在 该变更生效的三个营业日内以电子形式向交易所提交反映准确信息的更新表格。此外，若无任何重大变化，交易所可要求每年以电子形式提交新表，以维持记录准确度。重大变化包括但不限于账户名称、地址、控制人或受控制账户变化。

561. B. 交易量门槛报告

交易量门槛账户是指根据 CFTC 条例 15.04 定义的单个交易日交易之合约达到交易量门槛的任何账户。清算会员应在相关账户成为交易量门槛账户首日的三个营业日内以电子形式向交易所提交要求的 CFTC 表格 102B（“识别交易量门槛账户”），准确地识别交易量门槛账户的账户信息，包括所有人、控制人、受控制账

户以及报告要求的任何其它信息。尽管有在三个营业日提交表格的要求，清算会员、综合账户和外国经纪商必须在交易所的指导下，在该账户成为交易量门槛账户的首日内提供下列信息：账户类型、应报告账号以及账户所有人和控制人的姓名和地址。

若任何重大变更导致先前提交给交易所的信息变得不准确，则该清算会员、综合账户或外国经纪人必须在 该变更生效的三个营业日内以电子形式向交易所提交反映准确信息的更新表格。此外，若无任何重大变化，交易所可要求每年提交新表，以维持记录准确度。重大变化包括但不限于账户名称、地址、控制人或受控制账户变化。

561. C. 综合账户和外国经纪商的义务

综合账户或外国经纪商未能提交要求的信息可能会导致遭到商业行为委员会聆讯，造成该等综合账户或外国经纪商被限制进入、有条件进入、或拒绝进入任何交易所市场。尽管有以上规定，如果综合账户或外国经纪商未能向交易所提供信息，具有这些账户的清算会员仍应负责获取并向交易所提供有关头寸所有权和 控制权的信息。清算机构必须要求他们的客户提供准确和及时的所有人和控制人信息，包括任何重大变化。

经交易所要求，清算会员、综合账户和外国经纪商必须提交 CFTC 表格 40。

561. D. 可报告水平

交易所规则手册第 5 章末尾释义部分中头寸限制、头寸责任和应报告水平表规定了所有合约的大户交易的应报告水平。

在期货合约的特定到期月份内或在特定期权合约到期月份的所有看涨或看跌期权中，单个交易日交易量为 50 份合约或以上的任何交易账户均属于应报告的交易量门槛账户。[根据现有 CFTC 无行动豁免，就被视作可报告交易量门槛账户而言，当前门槛为 250 份或以上合约。]