

附 件 2

申报费计费说明

一、适用对象

在实施申报费的品种上，每日信息量达到一定标准的客户或非期货公司会员。其中，做市商做市交易免收申报费。

二、期货品种申报费收费公式

期货品种申报费根据客户或非期货公司会员在期货合约上的报单成交比（Order to Trade Ratio, OTR）所在区间以及信息量分梯度计算，按日收取。

客户或非期货公司会员在某个期货合约上的申报费= Σ (客户或非期货公司会员在该期货合约上各档位的信息量 \times 相应费率)

其中，信息量=报单、撤单等交易指令笔数之和；报单成交比（OTR）=（信息量/有成交的定单笔数）-1。

若客户或非期货公司会员某日在某期货合约上有信息量但无成交，则当日在该期货合约上其报单成交比视为大于2。

三、期权品种申报费收费公式

期权申报费根据客户或非期货公司会员在合约月份上的报单成交比所在区间以及信息量分梯度计算，按日收取。

客户或非期货公司会员在某个期权合约月份上的申报费= Σ (客户或非期货公司会员在该合约月份上各档位的信息

量×相应费率)

其中，信息量=报单、撤单、询价等交易指令笔数之和；
报单成交比（OTR）=（信息量/有成交的定单笔数）-1。

若客户或非期货公司会员某日在某期权合约月份上有信息量但无成交，则当日在该期权合约月份上其报单成交比视为大于2。

四、信息量计算

有成交的定单笔数：若某笔定单部分或全部成交，则该笔定单计为1笔成交，1笔定单若分多次成交不重复统计。

FAK/FOK定单：若全部成交仅计1笔报单笔数；若未成交或未全部成交而产生撤单，则计1笔报单笔数和1笔撤单笔数。

市价单：若全部成交仅计1笔报单笔数；若未成交或未全部成交而产生撤单，则计1笔报单笔数和1笔撤单笔数。

组合定单：组合定单的各腿合约信息量分别计入各腿合约上。

强行平仓定单：均计入信息量。

强制减仓定单：均不计入信息量。

询价指令：计入信息量（仅针对期权）。

对于同一客户在不同期货公司会员处开有多个交易编码的，或者具有实际控制关系的客户或非期货公司会员，交

易所对其报单笔数、撤单笔数、信息量、有成交的定单笔数、OTR 等指标合并计算。

五、收取方式

当日结算时，申报费从会员结算准备金中扣划。

对于具有实际控制关系的客户或非期货公司会员，根据申报费计算方法合并计算申报费，并按照实际控制关系账户组下各客户或非期货公司会员的信息量按比例确定相应的申报费。若客户或非期货公司会员隶属于多个实际控制关系账户组，则先计算其在各实际控制关系账户组下应付的申报费，最后按最大值原则确定其应付的申报费。

对于同一客户在不同期货公司会员处开有多个交易编码的，按照客户在不同期货公司会员下产生的信息量按比例确定相应的申报费。