

上海期货交易所文件

上期发〔2022〕229号

关于在期货和期权合约对客户信息量收取申报费的通知

各会员单位：

为强化监管效能，保障市场平稳运行，根据《上海期货交易所结算细则》第三十七条，上海期货交易所（以下简称上期所）将自2022年8月5日（即8月4日晚连续交易）起，在期货和期权合约对客户超过一定标准的信息量收取申报费。

一、适用对象

1. 上期所按照收费公式，对当日在期货和期权合约上报单、撤单或询价（仅针对期权）等交易指令笔数超过一定标准的客户收取申报费。

2. 非期货公司会员参照客户执行。

3. 上期所批准的做市商在做市品种上免收申报费。

二、收费公式

1. 客户在期货和期权某个合约上的申报费 = Σ 客户在该合约上各档位的信息量 \times 相应费率，具体费率标准如下。

报单成交比 OTR 信息量	OTR \leq 2	OTR $>$ 2
1笔 \leq 信息量 \leq 4000笔	0	0
4001笔 \leq 信息量 \leq 8000笔	A组品种 0.25元/笔 B组品种 0.01元/笔	A组品种 0.5元/笔 B组品种 0.02元/笔
8001笔 \leq 信息量 \leq 40000笔	A组品种 1.25元/笔 B组品种 0.05元/笔	A组品种 2.5元/笔 B组品种 0.1元/笔
40001笔 \leq 信息量	A组品种 25元/笔 B组品种 1元/笔	A组品种 50元/笔 B组品种 2元/笔

其中，A组品种包括白银、铝、黄金、石油沥青、铜、燃料油、热轧卷板、镍、铅、螺纹钢、天然橡胶、锡、纸浆、不锈钢和锌。B组品种包括线材、铝期权、黄金期权、铜期权、天然

橡胶期权和锌期权。

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/有成交的报单笔数）- 1。有成交的报单笔数为 0 时，视其为 1 来计算 OTR。上述信息量包括立即全部成交否则自动撤销指令（FOK）和立即成交剩余指令自动撤销指令（FAK）产生的报单和撤单笔数。

2. 如相关合约有 TAS 指令的，TAS 指令的信息量和标的合约信息量合并计算。

三、计费说明

1. 对于同一客户在不同会员处的交易编码，对其全部交易编码的信息量和有成交的报单笔数合并计算后按收费公式计收申报费；并根据该客户在不同会员处的信息量比例，确定其在相关会员处应付的申报费。

2. 具有实际控制关系的相关客户视为一个客户计收申报费。

四、收取方式

当日结算时，从相关会员的结算准备金中扣划申报费。如遇特殊情况无法在当日结算时扣划申报费的，上期所可在下一交易日结算时扣划，具体情况另行通知。

五、其他事项

1. 为实施上述业务，会员单位应当在 2022 年 8 月 4 日前完成技术系统升级。具体事宜请与相关技术系统供应商联系。

2. 根据《上海期货交易所异常交易行为管理办法》第九条的规定，实施申报费收费的合约上产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。

特此通知。

上海期货交易所

2022 年 7 月 29 日

上海期货交易所

2022 年 7 月 29 日印发

打字：徐紫莹

校对：陈柳伯

共印 1 份