

关于氧化铝期货上市交易有关事项的通知

上期发〔2023〕179号

各有关单位：

中国证监会已同意上海期货交易所（以下简称上期所）氧化铝期货注册。根据上期所相关规则，现将有关事项通知如下：

一、上市时间

氧化铝期货自2023年6月19日（周一）起上市交易，当日08:55-09:00集合竞价，09:00开盘。

二、交易时间

每周一至周五，09:00-10:15、10:30-11:30和13:30-15:00。连续交易时间，每周一至周五21:00-次日01:00。法定节假日前第一个工作日（不包含周六和周日）的连续交易时间段不进行交易。

三、挂牌合约

A02311、A02312、A02401、A02402、A02403、A02404、A02405、A02406。

四、挂牌基准价

由上期所在上市前一交易日公布。

五、交易保证金和涨跌停板

交易保证金为合约价值的9%；涨跌停板幅度为±7%，首日涨跌停板幅度为其2倍。

六、持仓公布

当某一合约收盘后的持仓量达到4万手（单边）时，交

易所将公布该月份合约前 20 名期货公司会员的成交量、买持仓量、卖持仓量以及该期货品种期货公司会员、非期货公司会员的总成交量、总买持仓量和总卖持仓量。

七、交易手续费

成交金额的万分之零点一，平今仓交易暂免收交易手续费。

八、申报费收取

氧化铝品种各合约的申报费费率标准如下。

表一：氧化铝申报费费率表

信息量 \ 报单成交比 OTR	OTR ≤ 2	OTR > 2
1 笔 ≤ 信息量 ≤ 4000 笔	0	0
4001 笔 ≤ 信息量 ≤ 8000 笔	0.01 元/笔	0.02 元/笔
8001 笔 ≤ 信息量 ≤ 40000 笔	0.05 元/笔	0.1 元/笔
40001 笔 ≤ 信息量	1 元/笔	2 元/笔

注释：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。

请各有关单位做好氧化铝期货上市的各项准备工作，加强风险防范，确保市场平稳运行。

特此通知。

上海期货交易所

2023 年 6 月 6 日