

关于国债期货实施梯度申报费有关事项的通知

中金所发〔2024〕29号

各会员单位：

根据《中国金融期货交易所结算细则》，交易所将自2024年7月1日起，对在国债期货合约上信息量和委托成交比（以下简称OTR）达到一定标准的非期货公司会员、客户收取梯度申报费。现将具体事项通知如下：

一、适用情形

1. 交易所对单日在国债期货合约上信息量和OTR达到一定标准的非期货公司会员、客户收取梯度申报费。信息量是指买入、卖出以及撤销委托笔数的总和，报单和撤单各计为1笔。因即时全部成交或撤销限价指令、即时成交剩余撤销限价指令、市价指令产生的报单和撤单计入信息量统计。

2. 同一客户通过不同期货公司会员申报交易，其信息量、OTR等指标合并计算。一组实际控制关系账户的信息量、OTR合并计算，其收费标准与单个客户相同。

3. 做市商在国债期货做市品种上免收梯度申报费。

二、收费标准

梯度申报费按日收取。非期货公司会员、客户在国债期货合约上的梯度申报费=∑非期货公司会员、客户在该国债期货合约上各档位的信息量*相应费率，具体费率标准如下：

表：国债期货梯度申报费标准

		第一种情形	第二种情形
		$0 \leq \text{OTR} \leq 2$	$\text{OTR} > 2$
第一档	1~4000笔	免收	免收
第二档	4001~8000笔	免收	1元/笔
第三档	8001~12000笔	10元/笔	20元/笔
第四档	≥ 12001 笔	20元/笔	50元/笔

OTR 计算公式如下：

$OTR = \text{信息量} / \text{有成交的委托笔数} - 1$

非期货公司会员、客户在国债期货合约上有成交的委托笔数为 0 时，视其为 1 计算 OTR。

同一客户通过不同期货公司会员申报交易，按照客户在不同期货公司会员下产生的信息量比例，确定其在相关期货公司会员处的申报费。

三、收取方式

当日结算时，交易所从结算会员的结算准备金中扣划申报费。因特殊情况当日结算时无法扣划申报费的，交易所可以在下一交易日结算时扣划。

四、其他事项

会员应当切实履行客户交易行为管理职责，积极采取相关措施，有效预防客户出现因资金不足不能及时支付申报费等费用的情形。

本通知自 2024 年 7 月 1 日起实施。

特此通知。

中国金融期货交易所

2024 年 5 月 24 日