

关于对工业硅、碳酸锂期货和期权交易收取申报费的通知

广期所发〔2024〕199号

各会员单位：

根据《广州期货交易所结算管理办法》第四十条，广州期货交易所（以下简称广期所）将自2024年10月25日交易时起，对工业硅期货、工业硅期权、碳酸锂期货和碳酸锂期权的交易收取申报费。

一、适用对象

当日在工业硅、碳酸锂期货合约或期权合约月份上信息量超过一定标准的客户和非期货公司成员。

做市商做市交易免收申报费。

二、收费公式

申报费按日、按期货合约或期权合约月份收取，具体收费标准如下：

期货合约或期权合约月份的申报费 = Σ （客户或非期货公司成员当日在该期货合约或期权合约月份上各档位的信息量 × 该档位收费标准）

品种	信息量	OTR \leq 2	OTR $>$ 2
工业硅期货	信息量 \leq 4000	0元/笔	0元/笔
	4000 < 信息量 \leq 8000	0元/笔	1元/笔
	信息量 $>$ 8000	2元/笔	5元/笔
碳酸锂期货	信息量 \leq 4000	0元/笔	0元/笔
	4000 < 信息量 \leq 8000	0元/笔	2元/笔
	信息量 $>$ 8000	4元/笔	10元/笔
工业硅期权	信息量 \leq 4000	0元/笔	0元/笔
	4000 < 信息量 \leq 8000	0元/笔	1元/笔
	信息量 $>$ 8000	2元/笔	5元/笔
碳酸锂期权	信息量 \leq 4000	0元/笔	0元/笔
	4000 < 信息量 \leq 8000	0元/笔	1元/笔
	信息量 $>$ 8000	2元/笔	5元/笔

其中，信息量 = 下单、撤单、询价等交易指令笔数之和。
报单成交比（OTR）= 信息量 / 有成交下单笔数 - 1。若客户或非期货公司会员某日在某期货合约或期权合约月份上有信息量但无成交，则当日在该期货合约或期权合约月份上其报单成交比（OTR）视为大于 2。上述信息量包括附加立即全部成交否则自动撤销（FOK）和立即成交剩余指令自动撤销（FAK）属性的指令、市价指令产生的报单和撤单笔数。

三、计费说明

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下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，确定其在对应会员处应付的申报费。

具有实际控制关系的客户或非期货公司会员视为一个客户计收申报费，对其信息量和有成交下单笔数合并计算后按收费公式计收申报费，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。

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，广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

根据《广州期货交易所异常交易行为管理办法》第七条的规定，实施申报费的合约上，符合交易所规定情形的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。

会员单位应当在申报费措施实施前做好相应准备工作，及时升级技术系统，完善相关风险控制机制，确保业务平稳运行。申报费业务指引详见《广州期货交易所申报费业务指南》。

特此通知。

附件：广州期货交易所申报费业务指南

广州期货交易所
2024年7月19日

广州期货交易所申报费业务指南

根据《广州期货交易所结算管理办法》，广州期货交易所（以下简称广期所）对期货及期权交易收取申报费，具体收费标准及相关问题说明如下。

一、适用对象

当日在工业硅、碳酸锂期货合约或期权合约月份上信息量超过一定标准的客户和非期货公司成员。

做市商做市交易免收申报费。

二、收费公式

根据客户、非期货公司成员在期货合约、期权合约月份的报单成交比（Order to Trade Ratio, OTR）所在区间、信息量梯度收费标准计算申报费，期货按合约、按日收取，期权按合约月份、按日收取。

期货合约或期权合约月份的申报费 = Σ （客户或非期货公司成员当日在该期货合约或期权合约月份上各档位的信息量×该档位收费标准）

具体收费标准举例如下：

表：收费标准示例

品种	信息量	OTR \leq 2	OTR $>$ 2
工业硅期货	信息量 \leq 4000	0 元/笔	0 元/笔
	4000 < 信息量 \leq 8000	0 元/笔	1 元/笔
	信息量 $>$ 8000	2 元/笔	5 元/笔

碳酸锂期货	信息量≤4000	0 元/笔	0 元/笔
	4000 < 信息量≤8000	0 元/笔	2 元/笔
	信息量>8000	4 元/笔	10 元/笔
工业硅期权	信息量≤4000	0 元/笔	0 元/笔
	4000 < 信息量≤8000	0 元/笔	1 元/笔
	信息量>8000	2 元/笔	5 元/笔
碳酸锂期权	信息量≤4000	0 元/笔	0 元/笔
	4000 < 信息量≤8000	0 元/笔	1 元/笔
	信息量>8000	2 元/笔	5 元/笔

其中，信息量 = 下单、撤单、询价等交易指令笔数之和。
 报单成交比（OTR）= 信息量/有成交下单笔数-1。若客户或非期货公司会员某日在某期货合约或期权合约月份上有信息量但无成交，则当日在该期货合约或期权合约月份上其报单成交比（OTR）视为大于 2。

三、计费说明

限价单、市价单：若全部成交仅计 1 笔下单笔数；若主动撤单，则计 1 笔下单笔数和 1 笔撤单笔数；若盘后被动撤单，则不计撤单笔数。

附加 FAK/FOK 属性订单：若全部成交仅计 1 笔下单笔数；若未成交或未全部成交而产生撤单，则计 1 笔下单笔数和 1 笔撤单笔数。

套利订单：期货套利订单的各腿合约信息量分别计入各腿合约上，不重复统计。

强行平仓订单：均计入信息量。

强制减仓订单：均不计入信息量。

期权询价订单：计入信息量。

有成交下单笔数：若某笔订单部分或全部成交，则该笔订单计为 1 笔有成交的下单笔数，1 笔订单若分多次成交不重复统计。

实控组客户计费：具有实际控制关系的客户或非期货公司会员，交易所对其下单笔数、撤单笔数、询价笔数、信息量、有成交下单笔数、OTR 等指标合并计算，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。

多会员处开户客户计费：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，对其全部交易编码的下单笔数、撤单笔数、询价笔数、信息量、有成交下单笔数、OTR 等指标合并计算，并根据该客户在不同会员处的信息量比例，确定其在对应会员处应付的申报费。

四、申报费计算示例

根据申报费相关计费规则，按照收费标准示例表进行计费，不同情景下的申报费计算示例如下。

（一）情景一：单个客户

假设客户当日在工业硅期货 2409 合约的 OTR 为 3，信息量为 10,000 笔，则客户第 1 笔到第 4,000 笔信息量按照 0 元/笔计费，第 4,001 笔到第 8,000 笔信息量按照 1 元/笔计费，第 8,001 笔到第 10,000 笔信息量按 5 元/笔计费，则客户当日在工业硅期货 2409 合约的申报费为（4,000 笔×1 元/笔）+

$(2,000 \text{ 笔} \times 5 \text{ 元/笔}) = 14,000 \text{ 元}$ 。

（二）情景二：实控组客户

假设客户 A 和客户 B 存在实际控制关系，客户 A 当日在碳酸锂期货 2409 合约的信息量为 3,000 笔，有成交下单笔数为 1,000 笔，客户 B 当日在碳酸锂期货 2409 合约的信息量为 6,500 笔，有成交下单笔数为 2,000 笔，则该实际控制关系账户组当日在碳酸锂期货 2409 合约的信息量为 $3,000 + 6,500 = 9,500$ 笔，OTR 为 $9,500 \div (1,000 + 2,000) - 1 = 2.17$ ，该实控组当日在碳酸锂期货 2409 合约的申报费为 $4,000 \text{ 笔} \times 2 \text{ 元/笔} + (9,500 - 8,000) \text{ 笔} \times 10 \text{ 元/笔} = 23,000 \text{ 元}$ 。申报费按信息量比例在实控组内客户间分配，客户 A 的申报费为 $23,000 \times (3,000 \div 9,500) = 7,263.16 \text{ 元}$ ；客户 B 的申报费为 $23,000 - 7,263.16 = 15,736.84 \text{ 元}$ 。

（三）情景三：单个客户，有多个交易编码

假设客户在会员 A、会员 B 处均开有交易编码，在会员 A 处的交易编码当日在工业硅期权 2410 合约月份的信息量为 4,500 笔，有成交下单笔数为 1,500 笔，在会员 B 处的交易编码当日在工业硅期权 2410 合约月份的信息量为 7,000 笔，有成交下单笔数为 1,000 笔，则该客户当日在工业硅期权 2410 合约月份的信息量为 $4,500 + 7,000 = 11,500$ 笔，OTR 为 $11,500 \div (1,500 + 1,000) - 1 = 3.6$ ，该客户当日在工业硅期权 2410 合约月份的申报费合计为 $4,000 \text{ 笔} \times 1 \text{ 元/笔} + (11,500 - 8,000) \text{ 笔} \times 5 \text{ 元/笔} = 21,500 \text{ 元}$ 。申报费按信息量比例在各会员处分配，客户在会员 A 处应付的申报费为 $21,500 \times$

$(4,500 \div 11,500) = 8,413.04$ 元；在会员 B 处应付的申报费为 $21,500 - 8,413.04 = 13,086.96$ 元。

（四）情景四：实控组客户，组内有客户有多个交易编码

假设客户 A 和客户 B 存在实际控制关系，客户 B 在会员 C、会员 D 处均开有交易编码。客户 A 当日在碳酸锂期权 2410 合约月份的信息量为 2,000 笔，有成交下单笔数为 400 笔；客户 B 在会员 C 处的交易编码当日在碳酸锂期权 2410 合约月份的信息量为 5,000 笔，有成交下单笔数为 2,000 笔，在会员 D 处的交易编码当日在碳酸锂期权 2410 合约月份的信息量为 3,000 笔，有成交下单笔数为 1,600 笔。则该实控组当日在碳酸锂期权 2410 合约月份的信息量为 $2,000 + 5,000 + 3,000 = 10,000$ 笔，OTR 为 $10,000 \div (400 + 2,000 + 1,600) - 1 = 1.5$ ，该实控组当日在碳酸锂期权 2410 合约月份的申报费合计为 $(10,000 - 8,000) \text{ 笔} \times 2 \text{ 元/笔} = 4,000$ 元。按信息量比例，客户 A 的申报费为 $4,000 \times (2,000 \div 10,000) = 800$ 元，客户 B 的申报费为 $4,000 - 800 = 3,200$ 元。客户 B 在会员 C 处应付的申报费为 $3,200 \times [5,000 \div (5,000 + 3,000)] = 2,000$ 元；在会员 D 处应付的申报费为 $3,200 - 2,000 = 1,200$ 元。

五、收取方式

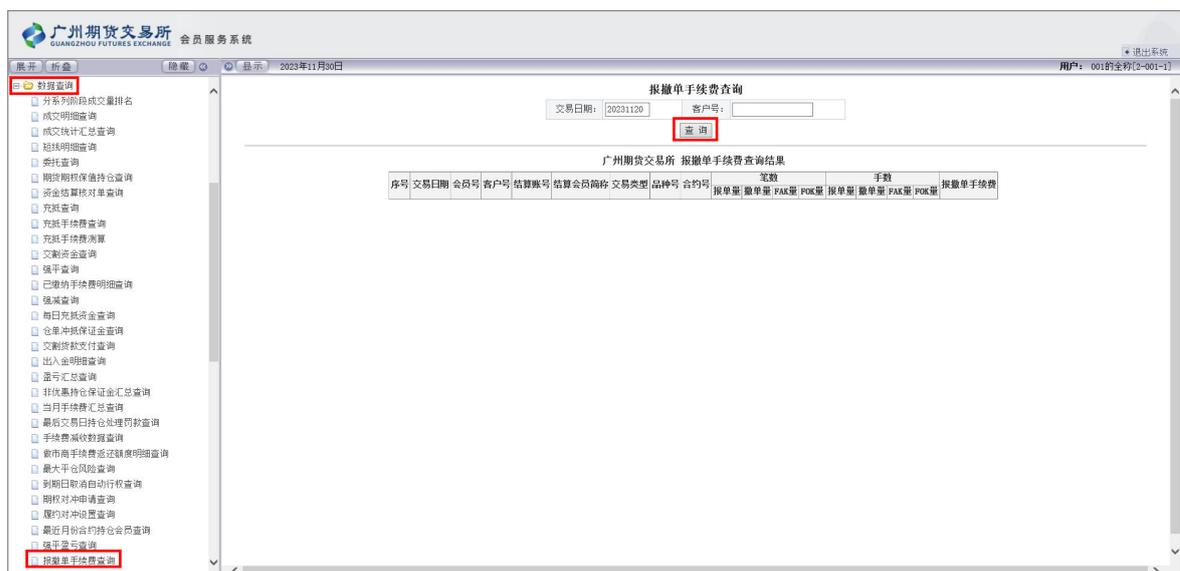
当日结算时，从相关会员的结算准备金中扣划申报费。如遇特殊情况无法在当日结算时扣划申报费的，广期所可在下一交易日结算时扣划，具体情况另行通知。

六、信息量、申报费及相关预警信息查询

会员单位业务人员可通过“会员服务系统-业务窗口-数据查询”模块进行信息量、申报费及相关预警信息查询。

（一）申报费（报撤单手续费）查询

点击左侧菜单“数据查询→报撤单手续费查询”，输入交易日期、客户号（不输默认为全部客户），点击【查询】按钮，可查询客户在不同期货合约或期权合约月份的报撤单量及申报费（报撤单手续费）。如图例 1。



图例 1

（二）申报费（报撤单手续费）信息量预警查询

点击左侧菜单“数据查询→报撤单手续费信息量预警查询”，输入交易日期，选择交易类型、品种、指标类型（以上不选默认为全部），点击【查询】按钮。如有客户当日信息量或申报费（报撤单手续费）达到预警阈值，其客户信息、信息量及申报费（报撤单手续费）等信息将在页面中显示，具体触发预警的项目将在“预警说明”列显示。此页面申报费数据为盘中实时试算数据，实际收取以结算后申报费（报撤单手续费）查询页面为准。如图例 2。



图例 2

七、其他事项

根据《广州期货交易所异常交易行为管理办法》第七条的规定，实施申报费的合约上，符合交易所规定情形的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。