

关于各交易所收取申报费的通知

尊敬的客户：

根据上海期货交易所、上海国际能源交易中心、大连商品交易所、郑州商品交易所、广州期货交易所发布的关于申报费的通知，自 2024 年 10 月 25 日（即 10 月 24 日晚连续交易）起对全部期货、期权品种收取申报费（中金所股指期货暂不收取），并调整申报费计算方式。请您充分了解各交易所关于申报费的收取标准、业务规则，及时跟踪交易所规则的变动情况，合规、理性参与交易。

交易所对信息量超过一定标准的客户收取申报费。您在我司的期货账户若在盘中达到一定信息量，则按照 $OTR>2$ 的收费标准实时收取申报费；当日结算时根据交易所的收取情况重新计收，超额收取的部分将于当日结算时退还至您的期货账户。中金所股指期货的申报费根据交易所规则在盘中实时收取。

目前申报费的收取金额不设上限，请密切关注您的交易情况及期货账户的实时资金状况，妥善使用交易软件并做好相应的风险防控。请采取积极有效的措施，包括但不限于设置申报数量限制、发现异常立即中止申报等措施，避免因交

易程序异常或频繁报撤单等产生大额申报费。大额申报费可能导致您的期货账户可用资金或权益小于零、出现穿仓的风险。

根据您的实时交易情况，当您的期货账户正在产生或者将产生大额申报费时，我司有权采取必要的风控措施控制因申报费产生的资金风险，包括但不限于冻结申报费资金、限制交易权限、限制出金、限制登录等。每日结算扣除申报费时，若您账户的可用资金不足，我司将保留采取相应风控措施的权利。

如有其他需求，请与我司联系，我们将竭诚为您服务。
特此通知。

附件：

1. 各交易所申报费收取情况汇总表(2024年10月24日晚连续交易起生效)
2. 各交易所关于申报费的通知

国新国证期货有限责任公司

2024年10月23日

各交易所申报费收取情况汇总表（2024年10月24日晚夜盘起生效）

说明：本表信息仅供参考，请以各交易所实际收取情况为准。

交易所	序号	代码	产品名称	产品类型	分组	是否收取申报费	申报费收取详情	交易所通知链接
中金所	1	IF	沪深300股指期货	期货		根据客户股指期货各合约的申报数量收取。	股指期货申报费根据客户股指期货各合约的申报数量收取，每笔申报费为一元。申报是指买入、卖出及撤销委托。	(1) 2015年07月31日发布《关于调整股指期货手续费标准的通知》 http://www.cffex.com.cn/jystz/20150731/19201.html
	2	IC	中证500股指期货	期货				
	3	IM	中证1000股指期货	期货				
	4	IH	上证50股指期货	期货				
	5	IO	沪深300股指期货期权	现货期权		暂不收取申报费。		(2) 2022年07月18日发布《关于中证1000股指期货和股指期货合约上市交易有关事项的通知》（中金所发〔2022〕41号） http://www.cffex.com.cn/jystz/20220718/28855.html
	6	MO	中证1000股指期货期权	现货期权				
	7	HO	上证50股指期货期权	现货期权				
	8	TS	2年期国债	期货		对信息量超过一定标准的客户收取申报费	一、适用范围 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=Σ非期货公司会员、客户在该国债期货合约上各档位的交易量*相应费率，具体费率标准如下： (1) 当1笔≤信息量≤4000笔时，费率为0元/笔。 (2) 当4001笔≤信息量≤8000笔时： 若OTR≤2，费率为0元/笔。 若OTR>2，费率为1元/笔。 (3) 当8001笔≤信息量≤12000笔时： 若OTR≤2，费率为10元/笔。 若OTR>2，费率为20元/笔。 (4) 当12001笔≤信息量时： 若OTR≤2，费率为20元/笔。 若OTR>2，费率为50元/笔。 OTR计算公式如下： OTR=信息量/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，交易所可在下一交易日结算时扣划。	(3) 中国金融期货交易所收费一览表 http://www.cffex.com.cn/zjszf/20230420/23701.html (4) 2024年05月24日发布《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） http://www.cffex.com.cn/jystz/20240524/38564.html
	9	TF	5年期国债	期货				
	10	T	10年期国债	期货				
	11	TL	30年期国债	期货				
上期所	12	ag	白银	期货	A组	对信息量超过一定标准的客户收取申报费	一、各品种申报费收费标准 1. 当1笔≤信息量≤4000笔时 ，费率为0元/笔。 2. 当4001笔≤信息量≤8000笔时 ： 若OTR≤2，则A组品种1.5元/笔，B组品种0.5元/笔，C组品种0.1元/笔。 若OTR>2，则A组品种3元/笔，B组品种1元/笔，C组品种0.2元/笔。 3. 当8001笔≤信息量≤40000笔时 ： 若OTR≤2，则A组品种7.5元/笔，B组品种2.5元/笔，C组品种0.5元/笔。 若OTR>2，则A组品种15元/笔，B组品种5元/笔，C组品种1元/笔。 4. 当40001笔≤信息量时 ： 若OTR≤2，则A组品种25元/笔，B组品种5元/笔，C组品种2元/笔。 若OTR>2，则A组品种50元/笔，B组品种10元/笔，C组品种5元/笔。 二、申报费计费说明 (一) 适用范围 交易所按照收费公式，对当日在期货合约或期权合约月份上申报、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。 非期货公司会员参照客户执行。 交易所批准的做市商在做市品种上免收申报费。 (二) 收费公式 交易所根据客户在期货合约或期权合约月份上的报单成交比（Order to Trade Ratio, OTR）所在区间以及信息量分梯度计算申报费，按日收取。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算申报费，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。具有实际控制关系的相关客户视为一个客户计算申报费。 1. 期货品种 客户在某一期货合约上的申报费=Σ（客户在某一期货合约上各档位信息量 相应费率）。 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，OTR=（信息量/1）- 1。 2. 期权品种 客户在某一期权合约月份上的申报费=Σ（客户在某一期权合约月份上各档位信息量 相应费率）。 信息量=报单、撤单、询价等交易指令笔数之和。 客户在某一期权合约月份上的信息量为该合约月份的全部期权合约的信息量之和。 客户在某一期权合约月份上的有成交的报单笔数为该合约月份的全部期权合约的有成交的报单笔数之和。 客户在某一期权合约月份上的报单成交比（OTR）=（某一期权合约月份上的信息量/某一期权合约月份上的有成交的报单笔数）- 1。某一期权合约月份上的有成交的报单笔数为0时，OTR=（某一期权合约月份上的信息量/1）- 1。 (三) 信息量计算 1. 主要原则 一是范围原则 ：统计有效进入交易系统的交易类指令。例如：被交易系统驳回的未有效进入交易系统的指令不纳入统计。查询系统状态等非交易类指令不纳入统计。客户集合竞价报撤单已有效进入交易系统，纳入统计。 二是时间原则 ：统计交易时段（含集合竞价时段）的信息量，不同品种（或指令）非交易时段的信息量不纳入统计。例如：客户当日收盘时仍未撤单的指令，不纳入撤单笔数统计。在TAS指令交易时段结束后，客户未撤单的TAS指令不纳入撤单笔数统计。强制减仓是非交易时段业务，不纳入统计。 三是豁免原则 ：行权申请、期权对冲申请、期转现等不纳入统计。 2. 计算说明 FAK/FOK指令（立即成交剩余指令自动撤销指令/立即全部成交否则自动撤销指令） ：如全部成交的，计1笔报单笔数；如未成交或未全部成交而产生撤单的，计1笔报单笔数和1笔撤单笔数。 有成交的报单笔数 ：如某笔报单部分或全部成交的，则该笔报单计为1笔有成交的报单，1笔报单如分多次成交的，不重复统计。如某笔报单完全没有成交的，则该笔报单计为0笔有成交的报单。 强行平仓 ：计入信息量。 强制减仓 ：不计入信息量。 询价指令 ：计入信息量（仅针对期权）。 TAS指令 ：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。 (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，交易所可在下一交易日结算时扣划，具体情况另行通知。 三、其他事项 期货公司会员应当切实加强客户交易行为管理，采取实际有效措施，防范客户出现因申报费透支导致资金不足的情形。	(1) 2022年07月29日发布《关于在期货和期权合约对客户信息量收取申报费的通知》（上期发〔2022〕229号） https://www.shfe.com.cn/news/notice/911341847.html (2) 2022年12月20日发布《关于螺纹钢期权和白银期权上市交易有关事项的通知》（上期发〔2022〕397号） https://www.shfe.com.cn/news/notice/911402281.html (3) 2023年6月6日发布《关于氧化铝期货上市交易有关事项的通知》（上期发〔2023〕179号） https://www.shfe.com.cn/news/notice/911403031.html (4) 2023年7月18日发布《关于合成橡胶期货上市交易有关事项的通知》（上期发〔2023〕228号） https://www.shfe.com.cn/news/notice/911403270.html (5) 2023年7月18日发布《关于合成橡胶期权上市交易有关事项的通知》（上期发〔2023〕229号） https://www.shfe.com.cn/publicnotice/notice/202405/t20240522_801753.html (6) 2024年05月22日发布《上海期货交易所关于调整申报费收费标准的通知》（上期发〔2024〕177号） https://www.shfe.com.cn/publicnotice/notice/202405/t20240522_801753.html (7) 2024年08月27日发布《关于铅、锡和氧化铝期权上市交易有关事项的通知》（上期发〔2024〕315号） https://www.shfe.com.cn/publicnotice/notice/202408/t20240827_802186.html (8) 2024年09月06日发布《上海期货交易所关于调整期权品种申报费计算方式的通知》（上期发〔2024〕324号） https://www.shfe.com.cn/publicnotice/notice/202409/t20240906_802459.html
	13	ag_o	白银期权	期货期权	B组			
	14	a1	铝	期货	A组			
	15	a1_o	铝期权	期货期权	B组			
	16	ao	氧化铝	期货	C组			
	17	ao_o	氧化铝期权	期货期权	B组			
	18	au	黄金	期货	A组			
	19	au_o	黄金期权	期货期权	B组			
	20	br	丁二烯橡胶	期货	C组			
	21	br_o	丁二烯橡胶期权	期货期权	B组			
	22	bu	沥青	期货	A组			
	23	cu	铜	期货	A组			
	24	cu_o	铜期权	期货期权	B组			
	25	fu	燃料油	期货	A组			
	26	hc	热轧卷板	期货	A组			
	27	ni	镍	期货	A组			
	28	ni_o	镍期权	期货期权	B组			
	29	pb	铅	期货	A组			
	30	pb_o	铅期权	期货期权	B组			
	31	rb	螺纹钢	期货	A组			
32	rb_o	螺纹钢期权	期货期权	B组				
33	ru	天然橡胶	期货	A组				
34	ru_o	天胶期权	期货期权	B组				
35	sn	锡	期货	A组				
36	sn_o	锡期权	期货期权	B组				
37	sp	漂针浆	期货	A组				
38	ss	不锈钢	期货	A组				
39	wr	线材	期货	C组				
40	zn	锌	期货	A组				
41	zn_o	锌期权	期货期权	B组				

各交易所申报费收取情况汇总表（2024年10月24日晚夜盘起生效）

说明：本表信息仅供参考，请以各交易所实际收取情况为准。

交易所	序号	代码	产品名称	产品类型	分组	是否收取申报费	申报费收取详情	交易所通知链接
能源中心	42	bc	国际铜	期货	C组	对信息量超过一定标准的客户收取申报费	一、各品种申报费收费标准 1. 当1笔≤信息量≤4000笔时：费率为0元/笔。 2. 当4001笔≤信息量≤8000笔时： 若OTR≤2，则A组品种1.5元/笔，B组品种0.5元/笔，C组品种0.1元/笔。 若OTR>2，则A组品种3元/笔，B组品种1元/笔，C组品种0.2元/笔。 3. 当8001笔≤信息量≤40000笔时： 若OTR≤2，则A组品种7.5元/笔，B组品种2.5元/笔，C组品种0.5元/笔。 若OTR>2，则A组品种15元/笔，B组品种5元/笔，C组品种1元/笔。 4. 当40001笔≤信息量时： 若OTR≤2，则A组品种25元/笔，B组品种5元/笔，C组品种2元/笔。 若OTR>2，则A组品种50元/笔，B组品种10元/笔，C组品种5元/笔。 二、申报费计费说明 （一）适用对象 上期能源按照收费公式，对当日在期货合约或期权合约月份上申报、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。 非期货公司会员和境外特殊非经纪参与者参照客户执行。 上期能源批准的做市商在做市品种上免收申报费。 （二）收费公式 上期能源根据客户在期货合约或期权合约月份上的申报成交比（Order to Trade Ratio, OTR）所在区间以及信息量分档度计算申报费，按日收取。对于同一客户在不同开户机构处的交易编码，对其全部交易编码的信息量和有成交的申报笔数合并计算后按收费公式计算申报费，并根据该客户在不同开户机构处的信息量比例，确定其在相关开户机构处应付的申报费。具有实际控制关系的相关客户视为一个客户计算申报费。 1. 期货品种 客户在某一期货合约月份上的申报费=Σ（客户在某一期货合约月份上各档位信息量 相应费率）。 信息量=申报、撤单、询价等交易指令笔数之和。 申报成交比（OTR）=（信息量/有成交的申报笔数）- 1。有成交的申报笔数为0时，OTR=（信息量/1）- 1。 2. 期权品种 客户在某一期权合约月份上的申报费=Σ（客户在某一期权合约月份上各档位信息量 相应费率）。 信息量=申报、撤单、询价等交易指令笔数之和。 客户在某一期权合约月份上的信息量为该合约月份的全部期权合约的信息量之和。 客户在某一期权合约月份上的有成交的申报笔数为该合约月份的全部期权合约的有成交的申报笔数之和。 客户在某一期权合约月份上的申报成交比（OTR）=（某一期权合约月份上的信息量/某一期权合约月份上的有成交的申报笔数）- 1。某一期权合约月份上的有成交的申报笔数为0时，OTR=（某一期权合约月份上的信息量/1）- 1。 （三）信息量计算 1. 主要原则 一是范围原则：统计有效进入交易系统的交易类指令。例如：被交易系统驳回的未有效进入交易系统的指令不纳入统计。查询系统状态等非交易类指令不纳入统计。客户集合竞价的报撤单已有效进入交易系统，纳入统计。 二是时间原则：统计交易时段（含集合竞价时段）的信息量，不同品种（或指令）非交易时段的信息量不纳入统计。例如：客户当日收盘时仍未撤单的指令，不纳入撤单笔数统计。在TAS指令交易时段结束后，客户未撤单的TAS指令不纳入撤单笔数统计。强制减仓是非交易时段业务，不纳入统计。 三是豁免原则：行权申请、期权自对冲申请、期转现等不纳入统计。 2. 计算说明 FAK/FOK指令（立即成交剩余指令自动撤销指令/立即全部成交否则自动撤销指令）：如全部成交的，计1笔申报笔数；如未成交或未全部成交而产生撤单的，计1笔申报笔数和1笔撤单笔数。 有成交的申报笔数：如某笔报单部分或全部成交的，则该笔报单计为1笔有成交的报单，1笔报单如分多次成交的，不重复统计。如某笔报单完全没有成交的，则该笔报单计为0笔有成交的报单。 强行平仓：计入信息量。 强制减仓：不计入信息量。 询价指令：计入信息量（仅针对期权）。 TAS指令：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。 （四）收取方式 当日结算时，从相关会员、境外特殊参与者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，上期能源可在下一交易日结算时扣划，具体情况另行通知。 三、其他事项 期货公司会员、境外特殊非经纪参与者和境外中介机构应当切实加强客户交易行为管理，采取实际有效措施，防范客户出现因申报费透支导致资金不足的情形。	（1）2021年11月12日发布《关于在期货和期权合约对客户信息量收取申报费的通知》（上能发〔2021〕91号） https://www.ine.cn/news/notice/5018.html （2）2022年07月29日发布《关于调整原油期货品种申报费收费标准的通知》（上能发〔2022〕47号） https://www.ine.cn/news/notice/6054.html （3）2023年08月11日发布《关于集运指数（欧线）期货上市交易有关事项的通知》（上能发〔2023〕54号） https://www.ine.cn/news/notice/130243.html （4）2024年05月22日发布《上海国际能源交易中心关于调整申报费收费标准的通知》（上能发〔2024〕40号） https://www.ine.cn/news/notice/131371.html （5）2024年09月06日发布《上海国际能源交易中心关于调整期权品种申报费计算方式的通知》（上能发〔2024〕67号） https://www.ine.cn/news/notice/131833.html
	43	ec	SCFIS欧线	期货	C组			
	44	lu	低硫燃料油	期货	A组			
	45	nr	20号胶	期货	A组			
	46	sc	原油	期货	A组			
47	sc_o	原油期货	期货期权	B组				
大商所	48	a	黄大豆1号	期货	对信息量超过一定标准的客户收取申报费	一、适用对象 当日在我所期货、期权合约上信息量超过一定标准的客户和非期货公司会员。 做市商做市交易免收申报费。 二、收费标准 申报费按日收取，期货合约申报费按合约统计，期权合约申报费按合约月份统计。各期货、期权合约收费标准如下： （1）当1笔≤信息量≤4000笔时，费率为0元/笔。 （2）当4001笔≤信息量≤8000笔时： 若OTR≤2，费率为0元/笔。 若OTR>2，则棕榈油、豆粕、鸡蛋、苯乙烯、乙二醇、液化石油气、聚丙烯、聚氯乙烯期货3元/笔，聚乙烯、玉米期货2元/笔，黄大豆1号、黄大豆2号、豆粕、纤维板、粳米、玉米淀粉期货1元/笔，生猪、铁矿石、焦煤、焦炭、股合板期货0.1元/笔，全部期权品种1元/笔。 （3）当8001笔≤信息量时： 若OTR≤2，则棕榈油、豆粕、鸡蛋、苯乙烯、乙二醇、液化石油气、聚丙烯、聚氯乙烯期货6元/笔，聚乙烯、玉米期货4元/笔，黄大豆1号、黄大豆2号、豆粕、纤维板、粳米、玉米淀粉期货2元/笔，生猪、铁矿石、焦煤、焦炭、股合板期货0.2元/笔，全部期权品种2元/笔。 若OTR>2，则棕榈油、豆粕、鸡蛋、苯乙烯、乙二醇、液化石油气、聚丙烯、聚氯乙烯期货15元/笔，聚乙烯、玉米期货10元/笔，黄大豆1号、黄大豆2号、豆粕、纤维板、粳米、玉米淀粉期货5元/笔，生猪、铁矿石、焦煤、焦炭、股合板期货0.5元/笔，全部期权品种5元/笔。 合约申报费=Σ（客户或者非期货公司会员当日在合约上各档位信息量×该档位收费标准）。 信息量=申报笔数+撤单笔数；申报成交比（OTR）=信息量/有成交申报笔数-1。 同一客户在不同期货公司会员处开多个交易编码的，或者具有实际控制关系的客户和非期货公司会员，报单笔数、撤单笔数、有成交申报笔数等指标合并计算。 三、收取方式 当日结算时，从会员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的，可在下一交易日结算时扣划，具体情况另行通知。 四、其他事项 期货公司会员应当切实加强客户交易行为管理，采取实际有效措施，防范客户出现因申报费透支导致资金不足等情形。	（1）2020年11月23日发布《关于对棕榈油期货合约交易收取申报费的通知》（大商所发〔2020〕525号） http://www.dce.com.cn/daliangshangpin/ywfw/jystz/ywtz/6251866/index.html （2）2021年11月12日发布《关于对棕榈油、铁矿石期货合约交易收取申报费的通知》（大商所发〔2021〕499号） http://www.dce.com.cn/daliangshangpin/ywfw/jystz/ywtz/6296543/index.html （3）2022年07月29日发布《关于对部分期货合约交易收取申报费的通知》（大商所发〔2022〕419号） http://www.dce.com.cn/daliangshangpin/ywfw/jystz/ywtz/8508587/index.html （4）2022年08月05日发布《部分期货合约交易申报费收取相关问题（2022年8月5日实施）》 http://www.dce.com.cn/daliangshangpin/ywfw/jystz/ywtz/8605414/index.html （5）2024年05月23日发布《关于调整部分期货合约申报费收费标准的通知》（大商所发〔2024〕241号） http://www.dce.com.cn/daliangshangpin/ywfw/jystz/ywtz/8604489/index.html （6）2024年07月19日发布《关于对部分期货、期权合约收取申报费的通知》（大商所发〔2024〕337号） http://www.dce.com.cn/daliangshangpin/ywfw/jystz/ywtz/8605414/index.html （7）2024年08月09日发布《关于鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权上市交易有关事项的通知》（大商所发〔2024〕365号） http://www.dce.com.cn/daliangshangpin/ywfw/jystz/ywtz/8607642/index.html	
	49	a_o	黄大豆1号期权	期货期权				
	50	b	黄大豆2号	期货				
	51	b_o	黄大豆2号期权	期货期权				
	52	bb	细木工板	期货				
	53	c	黄玉米	期货				
	54	c_o	玉米期权	期货期权				
	55	cs	玉米淀粉	期货				
	56	cs_o	玉米淀粉期权	期货期权				
	57	eb	苯乙烯	期货				
	58	eb_o	苯乙烯期权	期货期权				
	59	eg	乙二醇	期货				
	60	eg_o	乙二醇期权	期货期权				
	61	fb	中密度纤维板	期货				
	62	i	铁矿石	期货				
	63	i_o	铁矿石期权	期货期权				
	64	j	冶金焦炭	期货				
	65	jd	鲜鸡蛋	期货				
	66	jd_o	鸡蛋期权	期货期权				
	67	jm	焦煤	期货				
	68	l	线型低密度聚乙烯	期货				
	69	l_o	聚乙烯期权	期货期权				
	70	lh	生猪	期货				
	71	lh_o	生猪期权	期货期权				
	72	m	豆粕	期货				
	73	m_o	豆粕期权	期货期权				
	74	p	棕榈油	期货				
75	p_o	棕榈油期权	期货期权					
76	pg	液化石油气	期货					
77	pg_o	LPG期权	期货期权					
78	pp	聚丙烯	期货					
79	pp_o	聚丙烯期权	期货期权					
80	rr	粳米	期货					
81	v	聚氯乙烯	期货					
82	v_o	聚氯乙烯期权	期货期权					
83	y	豆油	期货					
84	y_o	豆油期权	期货期权					

各交易所申报费收取情况汇总表（2024年10月24日当晚夜盘起生效）

说明：本表信息仅供参考，请以各交易所实际收取情况为准。

交易所	序号	代码	产品名称	产品类型	分组	是否收取申报费	申报费收取详情	交易所通知链接
广期所	85	lc	碳酸锂	期货		对信息量超过一定标准的客户收取申报费	<p>一、适用范围 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会员。 做市商做市交易免收申报费。</p> <p>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（客户或非期货公司会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） （1）当1笔≤信息量≤4000笔时，费率为0元/笔。 （2）当4001笔≤信息量≤8000笔时： 若OTR≤2，费率为0元/笔。 若OTR>2，则工业硅期货、工业硅期权、碳酸锂期权1元/笔，碳酸锂期货2元/笔。 （3）当8001笔≤信息量时： 若OTR≤2，则工业硅期货、工业硅期权、碳酸锂期权2元/笔，碳酸锂期货4元/笔。 若OTR>2，则工业硅期货、工业硅期权、碳酸锂期权5元/笔，碳酸锂期货10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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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》。</p>	(1) 2024年7月19日发布《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） http://www.gfex.com.cn/gfex/tzts/202407/c7ad5fa27e0744a39babceefcbecf81f.shtml
	86	lc_o	碳酸锂期货	期货期权				
	87	si	工业硅	期货				
	88	si_o	工业硅期权	期货期权				

各交易所申报费收取情况汇总表（2024年10月24日晚夜盘起生效）

说明：本表信息仅供参考，请以各交易所实际收取情况为准。

交易所	序号	代码	产品名称	产品类型	分组	是否收取申报费	申报费收取详情	交易所通知链接
郑商所	89	AP	鲜苹果	期货	A组	对信息量超过一定标准的客户收取申报费	<p>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协会会员。其中，做市商做市交易免收申报费。</p> <p>二、期货品种申报费计算公式 期货品种申报费根据客户或非期货协会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。 客户或非期货协会会员在某个期货合约上的申报费=Σ（客户或非期货协会会员在该期货合约上各档位的数量×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。 若客户或非期货协会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。</p> <p>三、期权品种申报费计算公式 期权申报费根据客户或非期货协会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。 客户或非期货协会会员在某个期权合约月份上的申报费=Σ（客户或非期货协会会员在该合约月份上各档位的数量×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。 若客户或非期货协会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。</p> <p>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协会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协会会员，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。</p> <p>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协会会员，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协会会员的信息量按比例确定相应的申报费。若客户或非期货协会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协会会员处开有多个交易编码的，按照客户在不同期货协会会员下产生的信息量按比例确定相应的申报费。</p> <p>六、收费标准</p> <p>（一）精对苯二甲酸期货TA： （1）当1笔≤信息量≤4000笔时，费率为0元/笔。 （2）当4001笔≤信息量≤8000笔时： 若OTR≤2，费率为0元/笔。 若OTR>2，费率为2元/笔。 （3）当8001笔≤信息量≤20000笔时： 若OTR≤2，费率为5元/笔。 若OTR>2，费率为10元/笔。 （4）当20001笔≤信息量时： 若OTR≤2，费率为10元/笔。 若OTR>2，费率为40元/笔。</p> <p>（二）其他品种： （1）当1笔≤信息量≤4000笔时，费率为0元/笔。 （2）当4001笔≤信息量≤8000笔时： 若OTR≤2，费率为0元/笔。 若OTR>2，则A组品种3元/笔，B组品种1元/笔。 （3）当8001笔≤信息量时： 若OTR≤2，则A组品种7.5元/笔，B组品种2.5元/笔。 若OTR>2，则A组品种15元/笔，B组品种5元/笔。</p>	<p>（1）2021年11月12日发布《关于对PTA期货合约交易收取申报费的通知》（郑商函〔2021〕904号） http://www.czce.com.cn/cn/gyjys/jysdt/ggytz/webin/2021/11/1605603143725553.htm</p> <p>（2）2021年11月12日发布《关于发布申报费常见问题指南的通知》（郑商函〔2021〕905号）</p> <p>（3）2022年07月29日发布《关于对部分期货合约交易收取申报费的通知》（郑商函〔2022〕437号） http://www.czce.com.cn/cn/gyjys/jysdt/ggytz/webin/2022/07/1655818689351606.htm</p> <p>（4）2024年05月21日发布《关于调整部分期货品种申报费的通知》（郑商函〔2024〕302号） http://www.czce.com.cn/cn/gyjys/jysdt/ggytz/webin/2024/05/1715232136958603.htm</p> <p>（5）2024年7月19日发布《关于对部分品种交易收取申报费的通知》（郑商函〔2024〕479号） http://www.czce.com.cn/cn/gyjys/jysdt/ggytz/webin/2024/07/1715237246527911.htm</p> <p>（6）2024年8月16日发布《关于对部分期货合约交易收取申报费的通知》（郑商函〔2024〕559号） http://www.czce.com.cn/cn/gyjys/jysdt/ggytz/webin/2024/08/1715239665769043.htm</p>
	90	APC	苹果看涨期权	期货期权	B组			
	91	APP	苹果看跌期权	期货期权	B组			
	92	CF	一号棉花	期货	A组			
	93	CFC	棉花看涨期权	期货期权	B组			
	94	CFP	棉花看跌期权	期货期权	B组			
	95	CJ	红枣	期货	A组			
	96	CJC	红枣看涨期权	期货期权	B组			
	97	CJP	红枣看跌期权	期货期权	B组			
	98	CY	棉纱	期货	B组			
	99	FG	玻璃	期货	A组			
	100	FGC	玻璃看涨期权	期货期权	B组			
	101	FGP	玻璃看跌期权	期货期权	B组			
	102	JR	粳稻	期货	B组			
	103	LR	晚籼稻	期货	B组			
	104	MA	甲醇MA	期货	A组			
	105	MAC	甲醇看涨期权	期货期权	B组			
	106	MAP	甲醇看跌期权	期货期权	B组			
	107	OI	菜籽油	期货	A组			
	108	OIC	菜籽油看涨期权	期货期权	B组			
	109	OIP	菜籽油看跌期权	期货期权	B组			
	110	PF	短纤	期货	B组			
	111	PFC	短纤看涨期权	期货期权	B组			
	112	PF	短纤看跌期权	期货期权	B组			
	113	PK	花生仁	期货	B组			
	114	PKC	花生仁看涨期权	期货期权	B组			
	115	PKP	花生仁看跌期权	期货期权	B组			
	116	PM	普通小麦	期货	B组			
	117	PR	瓶片期货	期货	B组			
	118	PX	对二甲苯	期货	A组			
	119	PXC	对二甲苯看涨期权	期货期权	B组			
	120	PXP	对二甲苯看跌期权	期货期权	B组			
	121	RI	早籼稻	期货	B组			
	122	RM	菜籽粕	期货	A组			
	123	RMC	菜籽粕看涨期权	期货期权	B组			
	124	RMP	菜籽粕看跌期权	期货期权	B组			
	125	RS	油菜籽	期货	B组			
	126	SA	纯碱	期货	A组			
	127	SAC	纯碱看涨期权	期货期权	B组			
	128	SAP	纯碱看跌期权	期货期权	B组			
	129	SF	硅铁	期货	A组			
	130	SFC	硅铁看涨期权	期货期权	B组			
	131	SFP	硅铁看跌期权	期货期权	B组			
	132	SH	烧碱	期货	A组			
	133	SHC	烧碱看涨期权	期货期权	B组			
	134	SHP	烧碱看跌期权	期货期权	B组			
	135	SM	锰硅	期货	A组			
	136	SMC	锰硅看涨期权	期货期权	B组			
	137	SMP	锰硅看跌期权	期货期权	B组			
	138	SR	白砂糖	期货	A组			
	139	SRC	白糖看涨期权	期货期权	B组			
	140	SRP	白糖看跌期权	期货期权	B组			
	141	TA	精对苯二甲酸	期货	B组			
	142	TAC	PTA看涨期权	期货期权	B组			
	143	TAP	PTA看跌期权	期货期权	B组			
	144	UR	尿素	期货	A组			
	145	URC	尿素看涨期权	期货期权	B组			
	146	URP	尿素看跌期权	期货期权	B组			
	147	WH	优质强筋小麦	期货	B组			
	148	ZC	动力煤ZC	期货	B组			
	149	ZCC	动力煤看涨期权	期货期权	B组			
	150	ZCP	动力煤看跌期权	期货期权	B组			

附件 2:

各交易所关于申报费的通知

1. 上海期货交易所关于调整期权品种申报费计算方式的通知（上期发〔2024〕324号）
2. 上海国际能源交易中心关于调整期权品种申报费计算方式的通知（上能发〔2024〕67号）
3. 关于对部分期货、期权合约收取申报费的通知（大商所发〔2024〕337号）
4. 关于鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权上市交易有关事项的通知（大商所发〔2024〕365号）
5. 关于对部分品种交易收取申报费的通知（郑商函〔2024〕479号）
6. 关于对瓶片期货交易收取申报费的通知（郑商函〔2024〕559号）
7. 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）

1. 上海期货交易所关于调整期权品种申报费计算方式的通知

上期发〔2024〕324号

各会员单位：

经研究决定，上海期货交易所（以下简称上期所）将自2024年10月25日（即10月24日晚连续交易）起调整期权品种申报费计算方式，由按期权合约计算申报费调整为按期权合约月份计算申报费，具体内容如下。

一、收费公式

上期所根据客户在期权合约月份上的报单成交比（Order to Trade Ratio, OTR）所在区间以及信息量分梯度计算申报费，按日收取。即，客户在某一期权合约月份上的申报费=Σ（客户在某一期权合约月份上各档位信息量×相应费率）。

客户在某一期权合约月份上的信息量为该合约月份的全部期权合约的信息量之和。

客户在某一期权合约月份上的有成交的报单笔数为该合约月份的全部期权合约的有成交的报单笔数之和。

客户在某一期权合约月份上的报单成交比（OTR）=（某一期权合约月份上的信息量/某一期权合约月份上的有成交的报单笔数）- 1。某一期权合约月份上的有成交的报单笔数为0时，OTR=（某一期权合约月份上的信息量/1）- 1。

非期货公司会员参照客户执行。具有实际控制关系的相关客户视为一个客户计收申报费。上期所批准的做市商在做市品种上免收申报费。

二、收费标准

各期权品种的申报费收费标准如下：

信息量 \ 报单成交比 OTR	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	0.5 元/笔	1 元/笔
8001 笔 \leq 信息量 \leq 40000 笔	2.5 元/笔	5 元/笔
40001 笔 \leq 信息量	5 元/笔	10 元/笔

上述收费标准适用白银期权、丁二烯橡胶期权、黄金期权、螺纹钢期权、铝期权、镍期权、铅期权、铜期权、天然橡胶期权、锌期权、锡期权和氧化铝期权。

三、其他事项

期货公司会员应当切实加强客户交易行为管理，采取实际有效措施，防范客户出现因申报费透支导致资金不足的情形。

各品种申报费收费标准和计费说明详见附件。

特此通知。

附件：各品种申报费收费标准和计费说明

上海期货交易所

2024 年 9 月 6 日

附件

各品种申报费收费标准和计费说明

一、各品种申报费收费标准

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	A 组 1.5 元/笔 B 组 0.5 元/笔 C 组 0.1 元/笔	A 组 3 元/笔 B 组 1 元/笔 C 组 0.2 元/笔
8001 笔≤信息量≤40000 笔	A 组 7.5 元/笔 B 组 2.5 元/笔 C 组 0.5 元/笔	A 组 15 元/笔 B 组 5 元/笔 C 组 1 元/笔
40001 笔≤信息量	A 组 25 元/笔 B 组 5 元/笔 C 组 2 元/笔	A 组 50 元/笔 B 组 10 元/笔 C 组 5 元/笔

注：A 组包括白银、不锈钢、黄金、螺纹钢、铝、镍、铅、热轧卷板、燃料油、石油沥青、铜、天然橡胶、锌、锡和纸浆，共 15 个期货品种。B 组包括白银期权、丁二烯橡胶期权、黄金期权、螺纹钢期权、铝期权、镍期权、铅期权、铜期权、天然橡胶期权、锌期权、锡期权和氧化铝期权，共 12 个期权品种。C 组包括丁二烯橡胶、线材和氧化铝，共 3 个期货品种。

二、申报费计费说明

(一) 适用对象

交易所按照收费公式，对当日在期货合约或期权合约月份上

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。

非期货公司会员参照客户执行。

交易所批准的做市商在做市品种上免收申报费。

（二）收费公式

交易所根据客户在期货合约或期权合约月份上的报单成交比（Order to Trade Ratio, OTR）所在区间以及信息量分梯度计算申报费，按日收取。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。具有实际控制关系的相关客户视为一个客户计收申报费。

1. 期货品种

客户在某一期货合约上的申报费 = Σ （客户在某一期货合约上各档位信息量 \times 相应费率）。

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，OTR = （信息量 / 1） - 1。

2. 期权品种

客户在某一期权合约月份上的申报费 = Σ （客户在某一期权合约月份上各档位信息量 \times 相应费率）。

信息量=报单、撤单、询价等交易指令笔数之和。

客户在某一期权合约月份上的信息量为该合约月份的全部期权合约的信息量之和。

客户在某一期权合约月份上的有成交的报单笔数为该合约月份的全部期权合约的有成交的报单笔数之和。

客户在某一期权合约月份上的报单成交比 (OTR) = (某一期权合约月份上的信息量 / 某一期权合约月份上的有成交的报单笔数) - 1。某一期权合约月份上的有成交的报单笔数为 0 时, $OTR = (某一期权合约月份上的信息量 / 1) - 1$ 。

(三) 信息量计算

1. 主要原则

一是范围原则: 统计有效进入交易系统的交易类指令。例如: 被交易系统驳回的未有效进入交易系统的指令不纳入统计。查询系统状态等非交易类指令不纳入统计。客户集合竞价的报撤单已有效进入交易系统, 纳入统计。

二是时间原则: 统计交易时段(含集合竞价时段)的信息量, 不同品种(或指令)非交易时段的信息量不纳入统计。例如: 客户当日收盘时仍未撤单的指令, 不纳入撤单笔数统计。在 TAS 指令交易时段结束后, 客户未撤单的 TAS 指令不纳入撤单笔数统计。强制减仓是非交易时段业务, 不纳入统计。

三是豁免原则: 行权申请、期权自对冲申请、期转现等不纳

入统计。

2. 计算说明

FAK/FOK 指令（立即成交剩余指令自动撤销指令/立即全部成交否则自动撤销指令）：如全部成交的，计 1 笔报单笔数；如未成交或未全部成交而产生撤单的，计 1 笔报单笔数和 1 笔撤单笔数。

有成交的报单笔数：如某笔报单部分或全部成交的，则该笔报单计为 1 笔有成交的报单，1 笔报单如分多次成交的，不重复统计。如某笔报单完全没有成交的，则该笔报单计为 0 笔有成交的报单。

强行平仓：计入信息量。

强制减仓：不计入信息量。

询价指令：计入信息量（仅针对期权）。

TAS 指令：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。

（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，交易所可在下一交易日结算时扣划，具体情况另行通知。

2. 上海国际能源交易中心关于调整期权品种申报费计算方式的通知

上能发〔2024〕67号

各会员单位、境外特殊参与者、境外中介机构：

经研究决定，上海国际能源交易中心（以下简称上期能源）将自2024年10月25日（即10月24日晚连续交易）起调整期权品种申报费计算方式，由按期权合约计算申报费调整为按期权合约月份计算申报费，具体内容如下。

一、收费公式

上期能源根据客户在期权合约月份上的报单成交比（Order to Trade Ratio, OTR）所在区间以及信息量分梯度计算申报费，按日收取。即，客户在某一期权合约月份上的申报费= Σ （客户在某一期权合约月份上各档位信息量 \times 相应费率）。

客户在某一期权合约月份上的信息量为该合约月份的全部期权合约的信息量之和。

客户在某一期权合约月份上的有成交的报单笔数为该合约月份的全部期权合约的有成交的报单笔数之和。

客户在某一期权合约月份上的报单成交比（OTR）=（某一期权合约月份上的信息量/某一期权合约月份上的有成交的报单笔数）- 1。某一期权合约月份上的有成交的报单笔数为0时，OTR=（某一期权合约月份上的信息量/1）- 1。

非期货公司会员和境外特殊非经纪参与者参照客户执行。具有实际控制关系的相关客户视为一个客户计收申报费。上期能源批准的做市商在做市品种上免收申报费。

二、收费标准

各期权品种的申报费收费标准如下：

信息量 \ 报单成交比 OTR	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	0.5 元/笔	1 元/笔
8001 笔 \leq 信息量 \leq 40000 笔	2.5 元/笔	5 元/笔
40001 笔 \leq 信息量	5 元/笔	10 元/笔

上述收费标准适用原油期权。

三、其他事项

期货公司会员、境外特殊经纪参与者和境外中介机构应当切实加强客户交易行为管理，采取实际有效措施，防范客户出现因申报费透支导致资金不足的情形。

各品种申报费收费标准和计费说明详见附件。

特此通知。

附件：各品种申报费收费标准和计费说明

上海国际能源交易中心

2024 年 9 月 6 日

附件

各品种申报费收费标准和计费说明

一、各品种申报费收费标准

信息量 \ 报单成交比 OTR	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 1.5 元/笔 B 组 0.5 元/笔 C 组 0.1 元/笔	A 组 3 元/笔 B 组 1 元/笔 C 组 0.2 元/笔
8001 笔 \leq 信息量 \leq 40000 笔	A 组 7.5 元/笔 B 组 2.5 元/笔 C 组 0.5 元/笔	A 组 15 元/笔 B 组 5 元/笔 C 组 1 元/笔
40001 笔 \leq 信息量	A 组 25 元/笔 B 组 5 元/笔 C 组 2 元/笔	A 组 50 元/笔 B 组 10 元/笔 C 组 5 元/笔

注：A 组包括低硫燃料油、20 号胶和原油，共 3 个期货品种。

B 组包括原油期权，共 1 个期权品种。C 组包括国际铜和集运指数（欧线），共 2 个期货品种。

二、申报费计费说明

（一）适用对象

上期能源按照收费公式，对当日在期货合约或期权合约月份上报单、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。

非期货公司会员和境外特殊非经纪参与者参照客户执行。

上期能源批准的做市商在做市品种上免收申报费。

（二）收费公式

上期能源根据客户在期货合约或期权合约月份上的报单成交比（Order to Trade Ratio, OTR）所在区间以及信息量分梯度计算申报费，按日收取。对于同一客户在不同开户机构处的交易编码，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开户机构处的信息量比例，确定其在相关开户机构处应付的申报费。具有实际控制关系的相关客户视为一个客户计收申报费。

1. 期货品种

客户在某一期货合约上的申报费 = Σ （客户在某一期货合约上各档位信息量 \times 相应费率）。

信息量 = 报单、撤单、询价等交易指令笔数之和。

报单成交比（OTR） = $(\text{信息量} / \text{有成交的报单笔数}) - 1$ 。有成交的报单笔数为 0 时， $\text{OTR} = (\text{信息量} / 1) - 1$ 。

2. 期权品种

客户在某一期权合约月份上的申报费 = Σ （客户在某一期权合约月份上各档位信息量 \times 相应费率）。

信息量 = 报单、撤单、询价等交易指令笔数之和。

客户在某一期权合约月份上的信息量为该合约月份的全部期权合约的信息量之和。

客户在某一期权合约月份上的有成交的报单笔数为该合约

月份的全部期权合约的有成交的报单笔数之和。

客户在某一期权合约月份上的报单成交比 (OTR) = (某一期权合约月份上的信息量 / 某一期权合约月份上的有成交的报单笔数) - 1。某一期权合约月份上的有成交的报单笔数为 0 时, $OTR = (某一期权合约月份上的信息量 / 1) - 1$ 。

(三) 信息量计算

1. 主要原则

一是范围原则: 统计有效进入交易系统的交易类指令。例如: 被交易系统驳回的未有效进入交易系统的指令不纳入统计。查询系统状态等非交易类指令不纳入统计。客户集合竞价的报撤单已有效进入交易系统, 纳入统计。

二是时间原则: 统计交易时段(含集合竞价时段)的信息量, 不同品种(或指令)非交易时段的信息量不纳入统计。例如: 客户当日收盘时仍未撤单的指令, 不纳入撤单笔数统计。在 TAS 指令交易时段结束后, 客户未撤单的 TAS 指令不纳入撤单笔数统计。强制减仓是非交易时段业务, 不纳入统计。

三是豁免原则: 行权申请、期权自对冲申请、期转现等不纳入统计。

2. 计算说明

FAK/FOK 指令(立即成交剩余指令自动撤销指令/立即全部成交否则自动撤销指令): 如全部成交的, 计 1 笔报单笔数; 如

未成交或未全部成交而产生撤单的，计 1 笔报单笔数和 1 笔撤单笔数。

有成交的报单笔数：如某笔报单部分或全部成交的，则该笔报单计为 1 笔有成交的报单，1 笔报单如分多次成交的，不重复统计。如某笔报单完全没有成交的，则该笔报单计为 0 笔有成交的报单。

强行平仓：计入信息量。

强制减仓：不计入信息量。

询价指令：计入信息量（仅针对期权）。

TAS 指令：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。

（四）收取方式

当日结算时，从相关会员、境外特殊参与者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，上期能源可在下一交易日结算时扣划，具体情况另行通知。

3. 关于对部分期货、期权合约收取申报费的通知

大商所发〔2024〕337号

各会员单位及相关主体：

根据《大连商品交易所结算管理办法》第三十八条规定，经研究决定，自2024年10月25日交易时（即10月24日晚夜盘）起对聚氯乙烯、聚丙烯、乙二醇、苯乙烯、液化石油气、焦炭、焦煤、粳米、玉米淀粉、鸡蛋、胶合板、纤维板期货合约及全部期权合约收取申报费。其他期货合约申报费维持不变。具体事项通知如下：

一、适用对象

当日在我所期货、期权合约上信息量超过一定标准的客户和非期货公司会员。

做市商做市交易免收申报费。

二、收费标准

申报费按日收取，期货合约申报费按合约统计，期权合约申报费按合约月份统计。各期货、期权合约收费标准如下：

品种	收费标准：元/笔				
	信息量 ≤4000 笔	4000 笔<信息量≤8000 笔； OTR≤2	4000 笔<信息量≤8000 笔； OTR>2	信息量>8000 笔； OTR≤2	信息量>8000 笔； OTR>2
棕榈油、豆粕、 鸡蛋、苯乙烯、 乙二醇、液化石 油气、聚丙烯、 聚氯乙烯期货	0	0	3	6	15
聚乙烯、 玉米期货	0	0	2	4	10
黄大豆1号、黄 大豆2号、豆油、 纤维板、粳米、 玉米淀粉期货	0	0	1	2	5
全部期权	0	0	1	2	5
生猪、铁矿石、 焦煤、焦炭、胶 合板期货	0	0	0.1	0.2	0.5

合约申报费=Σ（客户或者非期货公司会员当日在合约上各档位信息量×该档位收费标准）。

信息量=报单笔数+撤单笔数；报单成交比（OTR）=信息量/有成交报单笔数-1。

同一客户在不同期货公司会员处开立多个交易编码的，或者具有实际控制关系的客户和非期货公司会员，报单笔数、撤单笔数、有成交报单笔数等指标合并计算。

三、收取方式

当日结算时，从会员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的，可在下一交易日结算时扣划，具体情况另行通知。

四、其他事项

期货公司会员应当切实加强客户交易行为管理，采取实际有效措施，防范客户出现因申报费透支导致资金不足等情形。

特此通知。

大连商品交易所

2024年7月19日

4. 关于鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权上市交易有关事项的通知

大商所发〔2024〕365号

各有关单位：

中国证监会已同意大连商品交易所（以下简称“大商所”）鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权注册，现将上市交易有关事项通知如下：

一、上市交易时间

鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权自2024年8月23日（周五）起上市交易。当日8:55-9:00集合竞价，9:00开盘。8月23日（周五）当晚，玉米淀粉期权开展夜盘交易。

二、上市交易合约

首日挂牌的鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权合约月份分别从JD2501、CS2501和LH2501开始。鸡蛋期权首日挂牌合约月份分别为JD2501、JD2502、JD2503、JD2504、JD2505、JD2506、JD2507。玉米淀粉期权首日挂牌合约月份分别为CS2501、CS2503、CS2505、CS2507。生猪期权首日挂牌合约月份分别为LH2501、LH2503、LH2505、LH2507。

三、挂牌基准价

根据BAW美式期权定价模型计算鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权合约的挂牌基准价，模型中的利率取最新的一年期定期存款基准

利率，波动率取标的期货合约历史波动率。挂牌基准价于上市前一个交易日结算后，通过会员服务系统随结算数据一同发布，也可通过大商所网站（www.dce.com.cn）查询。

四、交易指令

鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权交易可以使用限价指令和限价止损（盈）指令，每次最大下单数量与标的期货相同。

五、行权与履

在每个交易日的交易时间以及到期日的 15:00-15:30，客户可以提交“行权”、“双向期权持仓对冲平仓”、“行权后双向期货持仓对冲平仓”和“履约后双向期货持仓对冲平仓”申请。在到期日的交易时间以及到期日的 15:00-15:30，客户可以提交“取消期权自动行权申请”。

六、持仓限额

鸡蛋期权持仓限额为 400 手，玉米淀粉期权持仓限额为 15000 手，生猪期权持仓限额为 125 手。鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权与标的期货分开限仓。非期货公司会员和客户持有的某月份期权合约中所有看涨期权的买持仓量和看跌期权的卖持仓量之和、看跌期权的买持仓量和看涨期权的卖持仓量之和，分别不得超过期权品种的持仓限额。具有实际控制关系的持仓合并计算。

七、组合保证金

自 2024 年 8 月 23 日结算时起，鸡蛋期权 2501 合约月份、

玉米淀粉期权 2501 合约月份及生猪期权 2501 合约月份的合约参与组合保证金优惠。

八、相关费用

鸡蛋期权交易手续费为 0.5 元/手，玉米淀粉期权交易手续费为 0.2 元/手，生猪期权交易手续费为 1.5 元/手。鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权行权（履约）手续费收取标准与期权交易手续费相同。

鸡蛋期权套期保值交易手续费为 0.25 元/手，玉米淀粉期权套期保值交易手续费为 0.1 元/手，生猪期权套期保值交易手续费为 0.75 元/手。

自 2024 年 10 月 25 日交易时（即 10 月 24 日晚夜盘）起对鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权合约收取申报费，适用对象及收费标准与我所已上市期权品种一致（见下表）。申报费按日收取，期权合约申报费按合约月份统计。

表：鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权申报费收费标准表

期权品种	收费标准：元/笔				
	信息量≤ 4000 笔	4000 笔<信 息量≤8000 笔；OTR≤2	4000 笔<信息 量≤8000 笔； OTR>2	信息量> 8000 笔； OTR≤2	信息量> 8000 笔；OTR >2
鸡蛋期权、 玉米淀粉期权、 生猪期权	0	0	1	2	5

合约申报费=Σ（客户或者非期货公司会员当日在合约上各档位信息量×该档位收费标准）。

信息量=报单笔数+撤单笔数；报单成交比（OTR）=信息量/有成交报单笔数-1。

同一客户在不同期货公司会员处开立多个交易编码的，或者具有实际控制关系的客户和非期货公司会员，报单笔数、撤单笔数、有成交报单笔数等指标合并计算。

九、做市商制度及合约询价

鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权交易实行做市商制度。非期货公司会员和客户可以在非做市商持续报价合约上向做市商询价，做市商持续报价合约以大商所网站发布为准。询价请求应当指明期权合约代码，对同一期权合约的询价时间间隔不应低于60秒。同一交易编码在一个期权品种上每日询价次数上限为200次。

请各有关单位做好鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权上市交易准备工作，加强风险防范，确保市场平稳运行。

特此通知。

大连商品交易所
2024年8月9日

5. 关于对部分品种交易收取申报费的通知

郑商函〔2024〕479号

各会员单位：

根据《郑州商品交易所期货结算管理办法》第二十七条规定，经研究决定，自2024年10月24日当晚夜盘交易时起，对部分品种交易收取申报费，具体如下：

品种	信息量	OTR≤2	OTR>2
棉花期货、玻璃期货、纯碱期货、硅铁期货、锰硅期货、红枣期货、苹果期货、对二甲苯期货、烧碱期货、尿素期货	信息量≤4000笔	0元/笔	0元/笔
	4000笔<信息量≤8000笔	0元/笔	3元/笔
	信息量>8000笔	7.5元/笔	15元/笔
普通小麦期货、优质强筋小麦期货、早籼稻期货、晚籼稻期货、粳稻期货、动力煤期货、棉纱期货、油菜籽期货	信息量≤4000笔	0元/笔	0元/笔
	4000笔<信息量≤8000笔	0元/笔	1元/笔
	信息量>8000笔	2.5元/笔	5元/笔
白糖期权、棉花期权、PTA期权、甲醇期权、菜粕期权、菜籽油期权、动力煤期权、花生期权、烧碱期权、对二甲苯期权、短纤期权、纯碱期权、硅铁期权、锰硅期权、尿素期权、苹果期权、红枣期权、玻璃期权	信息量≤4000笔	0元/笔	0元/笔
	4000笔<信息量≤8000笔	0元/笔	1元/笔
	信息量>8000笔	2.5元/笔	5元/笔

其中，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；期权品种申报费根据客户或非期货公司会员在期权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（详见附件）。

期货公司会员应当切实加强客户交易行为管理，采取实际有效措施，防范客户出现因申报费透支导致资金不足的情形。

特此通知。

附件：申报费计费说明

郑州商品交易所
2024年7月19日

附件

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 \times 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。

6. 关于对瓶片期货交易收取申报费的通知

郑商函〔2024〕559号

各会员单位：

根据《郑州商品交易所期货结算管理办法》第二十七条规定，经研究决定，自2024年10月24日当晚夜盘交易时起，对瓶片期货交易收取申报费，具体如下：

品种	信息量	OTR \leq 2	OTR $>$ 2
瓶片期货	信息量 \leq 4000笔	0元/笔	0元/笔
	4000笔 $<$ 信息量 \leq 8000笔	0元/笔	1元/笔
	信息量 $>$ 8000笔	2.5元/笔	5元/笔

其中，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；期权品种申报费根据客户或非期货公司会员在期权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（详见附件）。

期货公司会员应当切实加强客户交易行为管理，采取实际有效措施，防范客户出现因申报费透支导致资金不足的情形。

特此通知。

附件：申报费计费说明

郑州商品交易所

2024年8月16日

附件

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 \times 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。

7. 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会员。

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 （客户或非期货公司会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≤2	OTR>2
工业硅期货	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。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

附件

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会员。

做市商做市交易免收申报费。

二、收费公式

根据客户、非期货公司会员在期货合约、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 （客户或非期货公司会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≤2	OTR>2
工业硅期货	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 $(4,000 \text{ 笔} \times 1 \text{ 元/笔}) + (2,000 \text{ 笔} \times 5 \text{ 元/笔}) = 14,000 \text{ 元}$ 。

（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 元; 客户 B 的申报费为 $23,000-7,263.16=15,736.84$ 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 $4,000 \text{ 笔} \times 1 \text{ 元/笔} + (11,500-8,000) \text{ 笔} \times 5 \text{ 元/笔}=21,500$ 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 $(10,000 - 8,000)$ 笔 $\times 2$ 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 $3,200 \times [5,000 \div (5000+3000)] = 2,000$ 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、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。