

## 各期货交易所申报费收取规则

能源中心	报单成交比OTR	OTR≤2	OTR>2
	信息量		
	1笔≤信息量≤4000笔	0	0
	4001笔≤信息量≤8000笔	原油 0.25元/笔 20号胶 0.01元/笔 低硫燃料油 0.25元/笔 国际铜 0.01元/笔 原油期货 0.01元/笔 集运指数（欧线） 0.01元/笔	原油 0.50元/笔 20号胶 0.02元/笔 低硫燃料油 0.50元/笔 国际铜 0.02元/笔 原油期货 0.02元/笔 集运指数（欧线） 0.02元/笔
	8001笔≤信息量≤40000笔	原油 2.00元/笔 20号胶 0.05元/笔 低硫燃料油 1.25元/笔 国际铜 0.05元/笔 原油期货 0.05元/笔 集运指数（欧线） 0.05元/笔	原油 4.00元/笔 20号胶 0.10元/笔 低硫燃料油 2.50元/笔 国际铜 0.10元/笔 原油期货 0.10元/笔 集运指数（欧线） 0.10元/笔
	40001笔≤信息量	原油 40元/笔 20号胶 1元/笔 低硫燃料油 25元/笔 国际铜 1元/笔 原油期货 1元/笔 集运指数（欧线） 1元/笔	原油 80元/笔 20号胶 2元/笔 低硫燃料油 50元/笔 国际铜 2元/笔 原油期货 2元/笔 集运指数（欧线） 2元/笔

上期所	报单成交比OTR	OTR≤2	OTR>2
	信息量		
	1笔≤信息量≤4000笔	0	0
	4001笔≤信息量≤8000笔	A组品种 0.25元/笔 B组品种 0.01元/笔	A组品种 0.50元/笔 B组品种 0.02元/笔
	8001笔≤信息量≤40000笔	A组品种 1.25元/笔 B组品种 0.05元/笔	A组品种 2.50元/笔 B组品种 0.10元/笔
	40001笔≤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
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、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、锌期权、螺纹钢期权、白银期权、氧化铝、丁二烯橡胶、丁二烯橡胶期权			

### 一、适用对象

- 交易所按照收费公式，对当日在期货和期权合约上申报、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

- 客户在期货和期权某个合约上的申报费 =  $\Sigma$  客户在该合约上各档位的消息量 \* 相应费率  
消息量 = 报单、撤单、询价等交易指令笔数之和。  
报单成交比 (OTR) = (消息量 / 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。  
上述消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。
- 如相关合约有TAS指令的，TAS指令的消息量和标的合约信息量合并计算。

### 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消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消息量比例，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。

大商所	报单成交比OTR	OTR≤2	OTR>2
	信息量		
	信息量≤4000笔	0	0
	4000笔<信息量≤8000笔	0	棕榈油 0.40元/笔 铁矿石 0.10元/笔 豆粕 0.60元/笔 豆油 0.30元/笔 黄大豆1号 0.05元/笔 黄大豆2号 0.10元/笔 玉米 1.60元/笔 生猪 0.10元/笔 线型低密度聚乙烯 0.60元/笔
	信息量>8000笔	棕榈油 0.8元/笔 铁矿石 0.2元/笔 豆粕 1.2元/笔 豆油 0.6元/笔 黄大豆1号 0.1元/笔 黄大豆2号 0.2元/笔 玉米 3.2元/笔 生猪 0.2元/笔 线型低密度聚乙烯 1.2元/笔	棕榈油 2.00元/笔 铁矿石 0.50元/笔 豆粕 3.00元/笔 豆油 1.50元/笔 黄大豆1号 0.25元/笔 黄大豆2号 0.50元/笔 玉米 8.00元/笔 生猪 0.50元/笔 线型低密度聚乙烯 3.00元/笔

一、适用对象  
当日在期货合约上信息量笔数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：  
 $\text{合约申报费} = \Sigma (\text{非期货公司会员或者客户当日在合约上各档位信息量} \times \text{该档位收费标准})$   
 其中，信息量=下单笔数+撤单笔数，报单成交比(OTR)=信息量/有成交下单笔数-1  
 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和非期货公司会员，交易所对其下单笔数、撤单笔数、下  
 单手数、撤单手数和成交手数等指标合并计算。

~客户申报费具体如何？  
 (1) 申报收费政策对信息量收费。  
 (2) 申报收费政策按合约统计信息量和OTR确定合约当日收费标准。  
 (3) 申报收费政策的OTR=信息量/有成交下单笔数-1。如客户当日有信息量但无成交，OTR为极大值。  
 (4) 申报收费政策按照逐笔收取、累进收取的原则，计算客户每笔信息量所对应的收费档位，逐笔计费(OTR按照收盘后客户当日全部下单、撤单、交易情况仅计算一次)。  
 例如，客户当日在棕榈油期货2209合约的OTR为3，信息量为10000笔，则客户第1笔到第4000笔信息量按照0元/笔计费，第4001笔到第8000笔信息量按照0.4元/笔计费，第8001笔到第10000笔信息量按照2元/笔计费，则客户当日在棕榈油期货2209合约的申报费为(4000笔×0.4元/笔)+(2000笔×2元/笔)=5600元。

~客户当日在多个会员交易，申报收费在不同会员如何收取？  
 按照“逐笔收取”的原则计算客户在不同会员的申报收费，即计算出客户每一笔信息量的收费额，再按照这些信息量归属的会员计算出每个会员的收费额。  
 例如，客户当日在棕榈油期货2209合约的OTR为3，信息量为10000笔，其中第1笔到第5000笔归属A会员，第5001笔到第10000笔归属B会员。则对A会员的申报收费额为(4000笔×0元/笔)+(1000笔×0.4元/笔)=400元；对B会员的申报收费额为(3000笔×0.4元/笔)+(2000笔×2元/笔)=5200元。

~FAK/FOK指令单笔下单全部成交或当天交易时间结束自动失效信息量计1次，有撤单行为信息量计2次。  
 ~市价(限价)止盈(止损)指令下单后，即使不触发价格条件也计算下单笔数和下单手数。

郑商所	报单成交比OTR	OTR≤2	OTR>2
	信息量		
	信息量≤4000笔	0	0
	4000笔<信息量≤8000笔	0	甲醇 0.10元/笔 白糖 0.10元/笔 菜油 0.10元/笔 菜粕 0.10元/笔 短纤 0.10元/笔 花生 0.10元/笔
	信息量>8000笔	甲醇 1.00元/笔 白糖 1.00元/笔 菜油 0.25元/笔 菜粕 1.00元/笔 短纤 1.00元/笔 花生 1.00元/笔	甲醇 2.00元/笔 白糖 2.50元/笔 菜油 0.75元/笔 菜粕 3.00元/笔 短纤 2.00元/笔 花生 4.50元/笔
中金所	报单成交比OTR	OTR≤2	OTR>2
	信息量		
	信息量≤4000笔	PTA 0.00元/笔	PTA 0.00元/笔
	4000笔<信息量≤8000笔	PTA 0.00元/笔	PTA 0.10元/笔
	8000笔<信息量≤20000笔	PTA 1.00元/笔	PTA 4.00元/笔
	信息量>20000笔	PTA 10.00元/笔	PTA 40.00元/笔

申报费计费说明：  
 一、适用对象  
 在实施申报收费的品种上，每日单合约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、收费公式  
 申报费根据客户或非期货公司会员在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合约上的申报费=Σ(客户或非期货公司会员在该合约上各档位的信息量×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。  
 若客户或非期货公司会员某日在某合约上有信息量但无成交，则当日在该合约上其报单成交比视为大于2。

三、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。  
 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。

四、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。

中金所	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。
-----	---