附 件

申报费常见问题指南

一、适用对象

（一）哪些客户适用申报费？

实施申报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。

（二）是否免收做市商的申报费？

做市商做市交易免收申报费。

（三）申报费按照品种上的信息量计算还是合约上的信息量计算？

按照客户或非期货公司会员在各合约上的信息量单独计算申报费。

二、指标计算

（一）信息量、OTR、有成交的定单笔数分别如何计算？

$$信息量=报单、撤单等交易指令笔数之和$$

$$报单成交比\left(OTR\right)=\frac{信息量}{有成交的定单笔数}−1$$

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（OTR）视为大于2。

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。

（二）哪些交易指令被纳入信息量统计？哪些不被纳入？

FAK/FOK定单、市价单、组合定单、强行平仓定单被纳入信息量统计；强制减仓定单不被纳入信息量统计。

（三）FAK/FOK定单、市价单、组合定单的信息量如何计算？

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。

（四）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，相关指标如何计算？

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，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）具有实际控制关系的客户或非期货公司会员，相关指标如何计算？

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。

三、计费方式

（一）申报费的计算公式是？

申报费根据客户或非期货公司会员的OTR所在区间以及信息量分梯度计算，按日收取，申报费计算公式如下：

$$客户或非期货公司会员在某个合约上的申报费=$$

$$\sum\_{}^{}\begin{array}{c}（客户或非期货公司会员在该合约上各档位的信息量×\\相应费率）\end{array}$$

（二）PTA期货合约申报费收费标准是？

PTA期货合约申报费收费标准如下：

**表1 PTA期货合约申报费收费标准**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **报单成交比（OTR）****信息量** | **OTR≤2** | **OTR>2** |
| **信息量≤4000笔** | 0元/笔 | 0元/笔 |
| **4000笔<信息量≤8000笔** | 0元/笔 | 0.05元/笔 |
| **信息量>8000笔** | 0.20元/笔 | 1.50元/笔 |

（三）按照上述收费标准，若某客户某日在PTA某合约上的信息量为9000笔，则其当日在该合约上的申报费是？

情形1：若该客户当日在该合约上的OTR≤2，根据申报费计算公式，其当日在该合约上的申报费为：

(9000-8000) ×0.20+(8000-4000) ×0+4000×0=200（元）

情形2：若该客户当日在该合约上的OTR**>**2，根据申报费计算公式，其当日在该合约上的申报费为：

(9000-8000)×1.50+(8000-4000) ×0.05+4000×0=1700（元）

（四）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，其申报费如何计算？其在各期货公司会员处的申报费如何确定？

第一步，合并计算其在不同会员下的报单笔数、撤单笔数、信息量、有成交的定单笔数、OTR等指标，并按照申报费的计算公式计算出申报费总金额；

第二步，以其在不同会员下的信息量为权重，计算其在不同会员下的申报费。

（五）具有实际控制关系的客户或非期货公司会员，各自相应申报费如何计算？

第一步，合并计算具有实际控制关系的相关客户或非期货公司会员的报单笔数、撤单笔数、信息量、有成交的定单笔数、OTR等指标，并按照申报费的计算公式计算出申报费总金额；

第二步，以实际控制关系的相关客户或非期货公司会员各自信息量为权重，计算各自相应申报费。

（六）对于客户或非期货公司会员隶属于多个实际控制关系账户组，申报费如何计算？

按照前一问题中的步骤一、步骤二，计算其在各实际控制关系账户组下申报费，按照最大值原则确定其最终申报费金额。

四、收取方式

（一）交易所如何收取申报费？

每日结算时，申报费从会员结算准备金中扣划。

五、其他问题

（一）会员如何查询当日申报费具体情况？

可从郑商所会员服务平台-报表-财务管理报表-会员客户申报费明细表中查询。

（二）申报费是否适用于郑州商品交易所年度手续费优惠措施？

申报费不适用于郑州商品交易所年度手续费优惠措施。