**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=Σ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≤OTR≤2 | 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=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