附 件

信息量与OTR计算说明

**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。