附件5

**选拔赛考核指标计算方法**

一、有效持续报价时间比例指标计算

持续报价义务的评价指标为有效持续报价时间比例，参考《郑州商品交易所期权做市商协议书》（以下简称《协议》）中规定的做市商有效持续报价累计时间除以履行合约的全部交易时间。有效持续报价持续时间计算方法如下：1.有效持续报价未成交或成交后双边挂单量仍不低于10手的，其持续时间为撤单时间（未撤单时按闭市时间）与报单时间的差；2.有效持续报价成交后至少有一边挂单量小于10手的，其持续时间为成交后单边最早小于10手的成交时间与报单时间的差。

有效持续报价时间比例=$\frac{履行合约有效持续报价累计时间}{履行合约累计交易时间}$

该指标按日、月计算如下：

日有效持续报价时间比例=$\frac{日履行合约有效持续报价累计时间}{日履行合约累计交易时间}$

月有效持续报价时间比例=$\frac{月履行合约有效持续报价累计时间}{月履行合约累计交易时间}$

二、有效回应询价比例指标计算

回应报价义务完成情况的评价指标为有效回应询价比例，参考《协议》中规定的做市商有效回应报价累计次数除以市场全部询价次数。

有效回应询价比例=$\frac{有效回应报价累计次数}{市场全部询价次数}$

该指标按日、月计算如下：

日有效回应询价比例=$\frac{当日有效回应报价累计次数}{当日市场全部询价次数}$

月有效回应询价比例=$\frac{当月有效回应报价累计次数}{当月市场全部询价次数}$

三、期权成交量指标计算

期权成交量是指参赛机构在该期权品种上的双边报价成交量和单边报价成交量之和。

四、盈亏指标计算

盈亏分为持仓盈亏和平仓盈亏。盈亏仅考察期权盈亏及期权对应的标的合约的盈亏。

盈亏计算

盈亏=期货期权平仓盈亏+期货期权持仓盈亏-缴纳手续费