

关于调整债券质押式回购交易购回价格计算公式的通知

各市场参与主体：

为配合《深圳证券交易所债券交易实施细则》的修订，我公司拟调整债券质押式回购交易购回价格计算公式。

自本通知实施日起达成的债券质押式回购交易，其购回价格计算公式调整为： $\text{购回价格} = 100 \text{元} + \text{每百元资金到期年收益} \times \text{实际占款天数} / 365 \text{（天）}$ 。其中，实际占款天数，是指回购交易的首次交收日（含）至到期交收日（不含）的实际天数，按自然日计算，以天为单位。

本通知实施日前达成的回购交易，其购回价格计算公式不变，即： $\text{购回价格} = 100 \text{元} + \text{每百元资金到期年收益} \times \text{回购天数} / 365 \text{（天）}$ 。其中，回购天数为回购品种对应的回购期限。

本次调整不涉及结算数据接口变更，购回价格数据仍通过接口数据“清算明细库”发送。

本通知自2017年5月22日起实施。

特此通知。

二〇一七年五月四日