

关于修改《上海证券交易所交易规则》及《上海证券交易所债券交易实施细则》涉及债券交易若干条款的通知

2017-04-14

 |  | 

各市场参与者：

经中国证监会批准，上海证券交易所（以下简称本所）对《上海证券交易所交易规则》（以下简称《交易规则》）、《上海证券交易所债券交易实施细则》（以下简称《实施细则》）中涉及债券质押式回购交易的若干条款进行了修改，具体修改内容如下：

一、《交易规则》相关条款修改内容

修改质押式回购收盘价的计算方法。第4.1.3条修改为：“除本规则另有规定外，证券的收盘价为当日该证券最后一笔交易前一分钟所有交易的成交量加权平均价（含最后一笔交易），当日无成交的，以前收盘价为当日收盘价。

债券质押式回购的收盘价为当日该证券最后一笔交易前一小时所有交易的成交量加权平均价（含最后一笔交易），当日无成交的，以前收盘价为当日收盘价。”

二、《实施细则》相关条款修改内容

（一）增加质押式回购开盘价和收盘价计算方法的相关条款

增加一条作为第十六条：“债券回购交易开盘价，为当日该回购品种集合竞价中产生的价格；集合竞价不能产生开盘价的，连续竞价中的第一笔成交价为开盘价。

债券回购的收盘价为当日该证券最后一笔交易前一小时所有交易的成交量加权平均价（含最后一笔交易），当日无成交的，以前收盘价为当日收盘价。”

（二）修改债券回购回购价的计算公式

原第十八条修改为：“回购到期日，证券登记结算机构根据回购价公式计算应进行交割的资金和质押券数量。

回购价计算公式为：回购价=100元+年收益率×100元×实际占款天数/365。

本条第二款所称实际占款天数，是指当次回购交易的首次交收日（含）至到期交收日（不含）的实际日历天数。”

上述修改内容自2017年5月22日起实施。2017年5月22日前达成的回购交易到期回购价仍按原公式计算。

特此通知。

上海证券交易所

二〇一七年四月十四日

分享：