**关于修改《深圳证券交易所债券交易实施细则》第三十九条的通知**

各市场参与人：

为完善债券质押式回购交易的计价方式，经中国证监会批准,本所对《深圳证券交易所债券交易实施细则（2016年修订）》(以下简称“《实施细则》”)第三十九条进行了修改,现将有关事项通知如下:

将《实施细则》第三十九条修改为：“债券回购交易实行‘一次成交、两次结算’。

债券回购交易初次结算的结算价格为100元。回购到期二次结算的结算价格为购回价，购回价等于每百元资金的本金和利息之和，其计算公式为：

购回价=100元+每百元资金到期年收益×实际占款天数/365（天）

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）的实际天数，按自然日计算，以天为单位。”

二、对于本通知施行前已达成的债券回购交易，其到期购回价仍按原公式计算，即“购回价=100元+每百元资金到期年收益×回购天数/365（天）。回购天数，是指《实施细则》第三十四条所述债券回购品种对应的回购期限”。

三、本通知自2017年5月22日起施行。本所发布的《深圳证券交易所债券交易实施细则（2016年修订）》（深证会[2016]140号）及《关于实施<深圳证券交易所债券交易实施细则（2016年修订）>第六条、第三十二条有关事项的通知》（深证会[2016]188号）同时废止。

请各会员单位、基金管理公司等做好相关业务和技术准备工作。

特此通知

附件：深圳证券交易所债券交易实施细则（2017年修订）



深圳证券交易所

2017年4月14日