

发文:上海证券交易所

文号:上证债字(2011)177号

日期:2011-08-18

关于发布质押式回购定盘利率的通知

各市场参与者:

为促进债券市场发展,反映本所回购市场综合利率水平,本所即日起在外部网站公布质押式回购定盘利率(以下简称“定盘利率”),供市场参与者参考。现将定盘利率编制方法和发布渠道公布如下:

一、定盘利率品种

204001 一天期回购、204007 七天期回购。

二、编制方法

单只回购品种某一交易日的定盘利率计算公式如下:

$$\text{定盘利率} = \frac{\sum \text{当日逐笔成交价} \times \text{当日逐笔成交量}}{\text{当日总成交量}} \times \frac{\text{回购品种天数}}{\text{到期结算日} - \text{首期结算日}}$$

其中:

首期结算日=首次交易日后的第一个工作日

到期结算日=回购到期日后的第一个工作日

回购到期日=首次交易日+回购品种天数。若该日非交易日,顺延至下一工作日。

若该回购品种当日无交易,则定盘利率取上一交易日的定盘利率。

三、发布渠道

本所在官方网站“信息披露—交易信息披露—债券回购定盘利率”栏目下,逐日发布前一交易日相关回购品种的定盘利率。若年末遇回购到期结算日不确定,则顺延公布。

本所同时提供2006年5月8日至今的定盘利率数据查询。

特此通知。

上海证券交易所

二〇一一年八月十八日