关于债券质押式回购交易业务调整的客户提示性公告

尊敬的客户：

2017年5月22日起，深、沪交易所债券质押式回购新规正式实施，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。业务调整的相关内容如下：

1、回购计息天数从现行回购期限的名义天数修改为资金实际占款天数，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。回购交易资金实际占款天数既可能多于回购名义天数，也可能少于回购名义天数；计价方式改变后，客户需调整现有报价习惯，以实际平均年化利率报价；

2、深、沪交易所全年计息天数统一修改为365 天；

3、回购收盘价修改为当日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。

请客户及时准确地了解相关规则变化，适时调整投资行为和投资习惯，注意投资风险，理性参与回购交易。

特此通知。

华林证券股份有限公司

二零一七年五月十九日

附：

购回价计算公式为：

购回价格=100元+每百元资金到期年收益×实际占款天数/365（天）

上交所于5月22日开始实施债券质押式回购新规

<http://www.sse.com.cn/aboutus/mediacenter/hotandd/c/c_20170519_4313753.shtml>

深交所：新的质押式回购计息方式将于5月22日施行

http://www.szse.cn/main/aboutus/bsyw/39771859.shtml#