

中证机构间报价系统股份有限公司

中证报价发〔2017〕25号

关于修改《报价系统非公开发行债券质押式 协议回购交易主协议》到期结算额 计算方式的通知

各参与人：

经中国证券业协会批准，中证机构间报价系统股份有限公司对《报价系统非公开发行债券质押式协议回购交易主协议》第二条内容中关于“到期结算额”的计算方式进行了修改，修改后为“到期结算额：正回购方约定的在到期结算日向逆回购方支付的资金额，单位为元，保留两位小数。计算公式 = 融入资金数额 × (1 + 回购利率 × 实际占款天数/365)。”

上述修改内容自 2017 年 6 月 5 日起实施，2017 年 6 月 5 日前达成的质押式协议回购交易到期结算额仍按原公式计算。

特此通知。

(此页无正文，为盖章页)

中证机构间报价系统股份有限公司

二〇一七年六月六日

