

# 关于在上海证券交易所上市的上证企债 30 交易所交易基金计入回购质押库的通知

(上证发〔2013〕12号)

各会员单位、结算参与机构:

为更好地满足投资者的投资交易需求,上海证券交易所(以下简称“上交所”)和中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)决定自2013年11月25日起,将上证企债30交易所交易基金(以下简称“上证企债30ETF”)比照国债ETF计入现有债券回购质押库。现就有关事项通知如下:

一、本通知中上证企债30ETF的交易代码为“511210”,其出入库申报代码为“105720”,出入库简称为“1020 基质”。

二、上证企债30ETF质押式回购相关登记结算业务根据中国结算《基金类产品质押式回购登记结算暂行办法》等业务规则办理。

三、上证企债30ETF的标准券折算值定义为每份份额折合的标准券价值。其标准券折算值按如下公式计算,并参照《标准券折算率管理办法》进行发布和管理。

标准券折算值=Min(上个交易日收盘价,上个交易日加权平均成交价)×(1-波动率)×折扣系数

其中，加权平均成交价以成交量为权重；波动率 = (上期最高收盘价-上期最低收盘价) ÷ [(上期最高收盘价+上期最低收盘价) ÷ 2]；上期指最近 5 个有交易的交易日(含当日)；折扣系数暂定为 0.81。中国结算可根据产品的运作及风险情况，定期或不定期调整其折扣系数取值，并向市场公布。

四、上证企债 30ETF 的回购交易、出入库管理、风险控制等事宜比照国债 ETF 进行管理。

特此通知。

上海证券交易所

中国证券登记结算有限责任公司

二〇一三年十一月十八日