**回购计算逻辑**

1. 回购方向：正回购 或 逆回购
2. 质押式回购
3. 期限：
4. 银行间：1天到365天，交易系统按1天、7天、14天、21天、1个月、2个月、3个月、4个月、6个月、9个月、1年共11个品种统计公布质押式回购的成交量和成交价。用R或DR表示。
5. 交易所：交易所只有9大类，1天，2天，3天，4天，7天，14天，28天，91天，182天
6. 到期结算价 = 首次结算价 + 回购利息 = 首次结算价 \* （1 + 回购利率 \* 资金占用天数 / 年天数）
7. 回购利息 = 首次结算全价 \* 回购利率 \* 资金占用天数 / 年天数
8. 资金占款天数 = 到期交收日 – 首次交收日 （算上头不算尾）
9. 银行间默认T0交割，交易所T0清算，T+1交收。如遇节假日顺延。
10. 当日盈亏 = 当日利息，融资为负，融券为正。
11. 浮动盈亏= 累计回购利息，融资为负，融券为正
12. 买断式回购
13. 期限： 1天到365天，交易系统按1天、7天、14天、21天、1个月、2个月、3个月、4个月、6个月、9个月、1年共11个品种统计公布买断式回购的成交量和成交价。
14. 到期结算价格（到期交易全价） = 首次交易全价 \*（ 1 +回购利率 \* 资产占用天数 / 年天数）- 期间利息收入 \* 100 / 回购券面额
15. 回购利率 = （到期交易全价 – 首次交易全价 + 抵押券期间利息收入 \* 100 / 回购券面额）\* 年天数 / （首次交易全价 \* 资金占用天数）
16. 对于多券来说：

到期交易全价

首次交易全价 =

抵押券期间利息收入 =

回购券面额 =

1. 交易流水
2. 加权平均利率
3. 市场融资加权平均利率、市场融券加权平均利率通过市场行情获得
4. 到期日期为到期清算日，为首次清算日的（T+N）日，N为名义天数
5. 到期天数：到期交收日与首次交收日之间的天数
6. 每日利润即应收应付利息，累计利润即利息汇总
7. 手续费：中债登、上清所均为X \* 0.00005%。X指债券质押的数量
8. 结算费

（只针对银行间的质押式回购交易费用计算，交易所质押式回购的交易费用为0。X是指债券质押的数量）

1. 中债登
   1. 一天质押式回购：若X属于0~1（包含0和1），则结算费=120元；若X属于1~200（不包含1，包含200），则结算费=200元，
   2. 多天质押式回购 [2-365]: 若X属于0~1（包含0和1），则结算费=120元；若X属于1~200（不包含1，包含200），则结算费=200元
2. 上清所
   1. 一天质押式回购：若X属于0~1（包含0和1），则结算费=120元；若X属于1~200（不包含1，包含200），则结算费=200元
   2. 多天质押式回购 [2-365]: 若X属于0~1（包含0和1），则结算费=120元；若X属于1~200（不包含1，包含200），则结算费=200元
3. 费后利率 待定，不同公司计算不一致。折算率及各类费用影响