

上海证券交易所 固定收益产品说明书

文档 状态	<input type="checkbox"/> 初稿	文档标识	固定收益产品说明书
	<input type="checkbox"/> 评审通过	当前版本	1.0.1
	<input type="checkbox"/> 修改	作 者	市场数据部
	<input checked="" type="checkbox"/> 发布	发布者	上证所信息网络有限公司
	<input type="checkbox"/> 作废	完成日期	2019/11/11

文档变动说明

日期	版本	说明
2017-05-26	1.0.0	首次发布
2019-11-11	1.0.1	延长交易时间从 15:00 到 15:30

1. 接口方式

对外提供文件行情。

每个交易日 8:45—15:30 发送固定收益数据。

2. 产品内容

2.1 债券信息

债券信息文件 se015zqxxyyyymmdd001.txt 开盘前提供，包括固定收益证券综合电子平台可交易债券的基本信息，具体提供证券代码、交易产品、证券属性、证券状态、证券发行方式、证券面额、发行价格、利息类型、付息频率、实际发行总量、发行开始日期、发行结束日期、上市日期以及到期日期等信息。

更为详细的内容可参见《IS109 固定收益平台外部数据接口规范》中的债券信息记录格式。

2.2 确定报价信息

确定报价数据 se015qdbjyyymmdd001.txt 包括证券代码、证券简称、买卖价位深度数量、买卖价位前十档的价位、数量和笔数、买卖方价位第一档价位前五笔订单的数量、到期收益率和应计利率。

更为详细的内容可参见《IS109 固定收益平台外部数据接口规范》中的确定报价行情记录格式。

2.3 成交行情信息

成交行情数据 se015cjhqyyymmdd001.txt 包括证券代码、证券简称、前收盘价格、昨日加权均价、当日开盘价、最新成交价格、当日最高成交价格、当日最低成交价格、当日加权均价、当日总成交笔数、当日累计成交量、当日累计成交金额、昨日收盘收益率、昨日加权平均收益率、当日开盘收益率、当日最高

收益率、当日最低收益率、当日最新收益率、当日加权平均收益率。

更为详细的内容可参见《IS109 固定收益平台外部数据接口规范》中的成交价格记录格式。

2.4 成交明细信息

成交明细数据 se015cjmxyyyymmdd001.txt 包括证券代码、证券简称、成交序号、成交日期、成交时间、成交净价、应计利息、成交全价、到期收益率、成交数量、成交金额以及成交方式等。

更为详细的内容可参见《IS109 固定收益平台外部数据接口规范》中的成交明细记录格式。