

上海证券交易所 股票期权产品说明书

文档 状态	<input type="checkbox"/> 初稿	文档标识	股票期权产品说明书
	<input type="checkbox"/> 评审通过	当前版本	1.1.0
	<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	1.1.0	新增期权组合策略信息

1. 接口方式

对外提供文件行情和流行情两种。

每个交易日 8:30—15:30 发送期权行情数据，期权收盘信息在 16:15 就绪。

2. 产品内容

2.1 期权基础信息

期权基础信息 reff03MMDD.txt 包括当前交易日可交易的期权合约的信息，具体提供合约编码、标的证券代码、标的证券类型、认购认沽、期权行权价、首个交易日、最后交易日、期权行权日、行权交割日、期权到期日、当前合约未平仓数、合约前收盘价和合约前结算价等信息。

更为详细的内容可参见《IS113 上海证券交易所股票期权市场参与者接口规格说明书》中的期权基础信息 reff03MMDD.txt。

2.2 期权行情信息

期权行情信息 mktdt03.txt 分为集合竞价时段和连续竞价时段。

集合竞价时段（盘前集合竞价、收盘前集合竞价、波动性中断）提供合约编码、昨日结算价、虚拟撮合价格、虚拟匹配量、虚拟未匹配量。

连续竞价时段提供合约编码、昨日结算价、总持仓量、最新成交价格、当日最高成交价格、当日最低成交价格、当日累计成交数量、当日累计成交金额、实时最高五个买入申报价格和数量、实时最低五个卖出申报价格和数量。

更为详细的内容可参见《IS113 上海证券交易所股票期权市场参与者接口规格说明书》中的期权行情文件接口 mktdt03.txt。

2.3 期权收盘信息

期权收盘信息 clpr03MMDD.txt 包括合约编码、期权收盘价和期权参考结算

价。

更为详细的内容可参见《IS113 上海证券交易所股票期权市场参与者接口规格说明书》中的期权收盘价格文件 clpr03MMDD.txt。

2.4 期权组合策略信息

期权组合策略信息 zhcl03MMDD.txt 包括组合策略名称、组合策略编码、成分合约个数以及合约信息等。

更为详细的内容可参见《IS113 上海证券交易所股票期权市场参与者接口规格说明书》中的期权组合策略文件 zhcl03MMDD.txt。