

# 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	1.1.0
	<input type="checkbox"/> 修改	作者	行情业务部
	<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	2025/06/12

## 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
2025-06-12	1.1.0	根据最新产品内容进行更新

## 1. 产品概述

固定收益行情从本所固定收益证券综合电子平台获取行情数据, 为市场参与者提供债券非匹配成交行情数据。

## 2. 产品内容

固定收益行情提供债券参考数据、确定报价数据、成交行情数据、成交明细数据和待定报价数据。

### 2.1 债券参考数据

债券参考数据包括证券代码、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。

### 2.2 确定报价数据

确定报价数据包括证券代码、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五十笔订单的数量、到期收益率和应计利率等。

### 2.3 成交行情数据

成交行情数据包括证券代码、证券简称、前收盘价格、昨日加权平均价、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、当日加权平均价、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等。

## 2.4 成交明细数据

成交明细数据包括证券代码、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。

## 2.5 待定报价数据

待定报价数据包括证券代码、证券简称、买入订单编号、买入报价时间、买入报价方、买入价（净价）、买入数量、买入全价、买入到期收益率、卖出订单编号、卖出报价时间、卖出报价方、卖出价（净价）、卖出数量、卖出全价、卖出到期收益率、应计利息等。