

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	2.0.0
	<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	2026/04/07

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
2026-04-07	2.0.0	根据新固定收益系统上线情况进行更新

1. 产品概述

固定收益行情从本所新固定收益系统获取行情数据,为市场参与者提供固定收益产品的非匹配成交行情数据。

2. 产品内容

固定收益行情主要提供盘前参考数据、快照数据和逐笔数据。

2.1 盘前参考数据

盘前参考数据包括证券产品基础信息、债券交易员信息、债券交易参与人信息。

证券产品基础信息主要包括证券代码、证券简称、前收盘价格、上市日期、最后交易日期、到期日期、计价方式、前非匹配成交参考价、前加权平均价格等。

债券交易员信息主要包括交易员姓名、所属证券机构代码、联系人电话号码、交易员类型等。

债券交易参与人信息主要包括证券机构代码、机构简称、机构名称、信用保护合约核心交易商标识等。

2.2 快照数据

快照数据主要包括证券代码、昨收盘、成交数量、成交笔数、成交金额、最新成交价、今开盘价、今收盘价、当日最高成交价、当日最低成交价、当日成交均价和昨日成交均价等。

2.3 逐笔数据

逐笔数据主要包括证券代码、委托时间或成交时间、类型、委托价格或成交价格、委托数据或成交数量、委托买卖方向、订单编号、成交金额、成交方式等。