

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所
独立 IOPV 行情
市场参与者技术实施指南

1.0 版



上海证券交易所

二〇二五年八月

文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）独立 IOPV 行情市场参与者技术实施指南。

特别申明

- 本指南为技术实施指南，所涉相关业务规定以本所业务规则为准。
- 本指南根据本所相关规则、业务方案、公告通知制定。
- 本所保留对本指南的解释与修改权。

联系方式

技术服务 QQ 群： 298643611

技术服务电话： 4008888400-2

电子邮件： tech_support@sse.com.cn

技术服务微信公众号：SSE-TechService



1 简介

本文档为上海证券交易所独立 IOPV 行情市场参与者技术实施指南，对市场参与者相关的技术实施提出建议。

2 市场接口调整说明

《IS120_上海证券交易所行情网关 BINARY 数据接口规范》

在市场状态消息 (MsgType=M101)、行情快照消息 (MsgType=M102) 中增加独立 IOPV 行情描述。

《IS120_上海证券交易所行情网关 STEP 数据接口规范》

在市场状态消息 (MsgType=h)、行情快照消息 (MsgType=W) 中增加独立 IOPV 行情描述。

《IS124_上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书》

新增外部源行情文件 mkt dte.txt。

3 市场参与者技术实施建议及注意事项

一、调整说明

为了提升证券行情发布的及时性，本所拟对行情发布架构进行优化，新增外部源行情通道，包含行情网关 MDGW 实时流(SecurityType=14)和行情文件 mktgte.txt 两部分。

上线初期仅包含 IOPV 行情 (MDStreamID=MDE01)，其产品范围与竞价撮合系统行情 (SecurityType=1 及 mktgt00.txt) 中 ETF 产品范围一致，对于不发布 IOPV 的 ETF，行情中填写默认值 0，代表无意义。

详细说明如下：

(一) 行情网关 MDGW 接口 (BINARY/STEP)

1. 市场状态消息 (MsgType=M101/h) 中增加 SecurityType=14 消息，旨在传递行情产品数目 (TotNoRelatedSym 字段)，对应市场状态 (TradingSessionID) 填空无意义。

2. 行情快照消息 (MsgType=M102/W) 中增加 IOPV 行情 (MDStreamID=MDE01)，其 PreClosePx 昨收盘、TotalVolumeTraded 成交数量、NumTrades 成交笔数、TotalValueTraded 成交金额字段取值为 0，TradingPhaseCode 实时阶段及标志取值为空。行情条目类别为 w 时，MDEntryPx 表示基金 T-1 日收盘时刻 IOPV，此条目仅当 MDStreamID= MD004 时有意义，当 MDStreamID= MDE01 时无意义，该字段取 0 时无意义；行情条目类别为 v 时，MDEntryPx 表示基金 IOPV，此条目仅当 MDStreamID= MD004 或 MDE01 时有意义，该字段取 0 时无意义。

(二) 文件接口 (外部源行情文件 mktgte.txt)

文件头、尾与 mktgt00.txt 类似。文件体目前仅有 MDStreamID= MDE01 一种，表示 IOPV 行情，包含：SecurityID 证券代码、Symbol 证券简称、IOPV、Timestamp 时间戳、Reserved 预留字段。

外部源行情文件 mktgte.txt 仅会通过行情网关 MDGW 进行下发。UT5 已计划下线，不会发布该文件。

二、切换方面

为提升市场效率，共做两阶段安排：

（一）第一阶段

本所向市场机构以试运行的形式发布外部源 IOPV 行情，各市场机构应保持以现有渠道（SecurityType=1 及 mktdt00.txt）接收 IOPV，外部源行情渠道的 IOPV 仅供参考，不应用做正式用途。

此阶段外部源 IOPV 行情与现有渠道保持一致。

市场机构可在此阶段逐步完成技术就绪，为后续正式切换外部源行情渠道做好准备。

（二）第二阶段

正式发布外部源 IOPV 行情，市场机构应切换外部源 IOPV 行情为生产使用。原渠道（SecurityType=1 及 mktdt00.txt）中 IOPV 行情将逐步减少转发直至不再通过此渠道发布，原渠道中 IOPV 相关字段会保留并填写为 0（表示无意义），以避免系统兼容性问题。

市场参与者应充分评估上述变更对行情、申赎、交易等相关技术系统的影响，做好相关技术系统维护、改造工作，根据本所要求利用本所提供的测试环境进行充分测试验证，同时保障现有上交所股票、债券、基金、融资融券、股票期权等各类业务正常运行。

4 相关技术文档

《IS120_上海证券交易所行情网关 BINARY 数据接口规范 0.58 版_20250801（独立 IOPV 行情 技术开发稿）》

《IS120_上海证券交易所行情网关 STEP 数据接口规范 0.58 版_20250801（独立 IOPV 行情 技术开发稿）》

《IS124_上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书 2.70 版_20250801（独立 IOPV 行情 技术开发稿）》