

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

2.0 版



上海证券交易所

二〇二六年三月

## 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](mailto:tech_support@sse.com.cn)

技术服务微信公众号：SSE-TechService



## 一、概述

为提升基金净值估算（IOPV）行情的发布效率与系统可靠性，本所推出独立的 IOPV 行情发布通道。本项目将通过三个阶段，逐步以新增的外部源行情通道，替代现有竞价撮合系统行情中的 IOPV 数据。

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。

## 二、项目阶段总览

为提升市场效率，共做 三再 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 （行情流 SecurityType=14 及行情文件 mktde.txt），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，不应用作正式用途。

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 主用使用。原渠道（SecurityType=1 及 mktdt00.txt）中 IOPV 字段将保留至第三阶段开始前，但不再建议使用。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。~~

### （三）第三阶段

第二阶段开始 3 个月后，进入第三阶段，原渠道（SecurityType=1 及 mktdt00.txt）中 IOPV 字段将会标记为无意义。市场机构应确保所有系统已完全脱离对原渠道 IOPV 数据的依赖。

### 三、 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》

第一阶段： 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。

第二阶段：接口无变更。

第三阶段：下线竞价撮合系统行情（股票、基金、指数及债券分销）中 IOPV 行情，相关字段标记为“无意义”。

#### 《IS120\_上海证券交易所行情网关 STEP 数据接口规范》

第一阶段： 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。

第二阶段：接口无变更。

第三阶段：下线竞价撮合系统行情（股票、基金、指数及债券分销）中 IOPV 行情，相关字段标记为“无意义”。

#### 《IS124\_上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书》

第一阶段： 新增外部源行情文件 mktcte.txt。

第二阶段：接口无变更。

第三阶段：下线竞价撮合系统行情文件 mktcte00.txt 中 IOPV 行情，相关字段标记为“无意义”。

### 四、 市场参与者技术实施建议及注意事项

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 mktcte.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 mkttdt00.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)

##### 第一阶段：

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。

##### 第二阶段：接口无调整。

##### 第三阶段：

行情快照消息 (MsgType=M102/W) IOPV 行情 (MDStreamID=MDE01) 中，行情条目类别为 w 时，MDEntryPx 表示基金 T-1 日收盘时刻 IOPV，数据内容无意义此条目仅当 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 mkttdte.txt)

##### 第一阶段：

文件头、尾与 mkttdt00.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 `mktkte.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。

`mktkte.txt` 文件名采用固定文件名规则，而非动态命名规则<sup>1</sup>，文件名中不包含环境号。无论在测试环境还是生产环境，其文件名均保持不变。请各市场机构根据上述规则，在切换环境时注意区分。

注意：相对于竞价撮合系统行情（`mkttdt00.txt` 及 MDGW 实时流中 MDStreamID=MD004 数据）中 IOPV 字段，外部源行情（`mktkte.txt` 及 MDGW 实时流中 MDStreamID=MDE01 数据）中无基金 T-1 日收盘时刻 IOPV。

第二阶段：接口无调整。

第三阶段：

下线竞价撮合系统行情文件 `mkttdt00.txt` 中 IOPV 行情，PreCloseIOPV 基金 T-1 日收盘时刻 IOPV、IOPV 基金 IOPV 字段标记为无意义。

### （三）行情网关软件升级说明

市场参与者可通过升级行情网关版本（MDGW\_1.2.10 及以上），接收新增外部源行情数据。存量生产版本接收其他行情类数据不受影响，其中传输方式使用 Udp 高速地面和 Udp 卫星链路的用户，日志提示：`task marketDataTask unknown securityType 14`，为正常现象，请忽略。

### （四）其他项目关联关系说明

由 IOPV 外部源机构提供的 IOPV 行情数据，本所将统一通过独立 IOPV 行情渠道发布，不会通过现有渠道（SecurityType=1 及 `mkttdt00.txt`）发布。因此，为保障能接收完整的 IOPV 行情数据（含未来外部源数据），各市场机构必须在 IOPV 外部源业务上线前完成独立 IOPV 行情渠道的接入。

<sup>1</sup> 动态文件名规则：如撮合系统行情文件，文件名为 `mkttdt+[环境号].txt`，其中环境号会随部署环境变化。例如：在生产环境（00 环境）中文件名为 `mkttdt00.txt`，在测试环境（如 88 环境）中文件名为 `mkttdt88.txt`。

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。

## 五、 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 0.60 版\_20260327》

《IS120\_上海证券交易所行情网关 STEP 数据接口规范 0.60 版\_20260327》

《IS124\_上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书 3.20 版\_20260327》