

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所 IOPV 外部源机构接入 市场参与者技术实施指南

1.1 版



上海证券交易所

二〇二六年七月

版本历史

版本号	调整内容
V1.0 20250815	1、创建说明
V1.1 20260724	1、新增独立接入IOPV要求。 2、相关技术文档中新增错误码表。 3、增加机构上传时间要求。

文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）IOPV 外部源机构接入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（以下简称“本所”）针对 IOPV 外部源机构接入业务，为指导市场参与者尽快完成技术准备工作，特制定本指南。

2 业务说明

实时参考净值（以下简称 IOPV）是 ETF 申赎清单中组合证券的实时市值，能为投资者的二级市场交易及申赎提供价格参考。为更好完善 ETF 市场机制，本所拟推动支持外部 IOPV 数据源接入并发布。

3 接口说明

《IS419_上海证券交易所互联网交易平台市场参与者接口规格说明书（IOPV 卷）》

获得 IOPV 上传资质的指定机构可以通过 HTTP 协议的 RESTful API 接口接入互联网交易平台并上传 IOPV 数据。

（1）通过交易行情网或 VSEP 网络与交易所进行网络对接；

（2）上交所接受当日实时参考基金净值上传时间不晚于当日 8:00 且不早于 16:30 结束，上传机构应在该时段内上传当日全量产品数据，如无数据应补 0；

（3）上传频率应不快 3 秒/幅（含 3 秒），若上传机构未上传最新基金净值，则下一次对外发布揭示净值时将保留上次发布揭示的净值不变。

《IS118_上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》

配合 IOPV 外部源机构接入，调整如下：

（1）ETF 定义文件接口，IOPV 发布标记字段新增字段取值 C，代表由第三方机构（非中证指数公司）计算 IOPV，经互联网交易平台转发，通过交易所行情发布；调整取值 B 含义为：由中证指数公司计算 IOPV，通过交易所行情发布。

（2）ETF 公告文件接口，对应 ETF 定义文件，调整 Publish（PublishIOPVFlag）字段描述。

4 市场参与者技术实施建议及注意事项

(1) 本所互联网交易平台提供双通道供上传机构发送 IOPV 数据，上传机构应通过双通道分别上传且保证双路数据的一致性。具体双路上传地址将另行明确，相关机构可先进行相关技术准备。

(2) 本所对于上传的行情信息会进行防重复、防回流处理，请上传机构依据市场接口中的相关要求完成相应技术处理。

(3) ETF 定义文件中 IOPV 发布标记字段 (2.1 版为 Publish IOPV Flag 字段/xml 版为 PublishIOPVFlag 字段) 新增通过互联网交易平台发布 IOPV 的取值 C，调整取值 B 为“由中证指数公司计算 IOPV，通过交易所行情发布”。所有通过互联网交易平台上传发送 IOPV 数据的 ETF 产品，基金管理人应在该 ETF 定义文件中 Publish IOPV Flag (2.1 版) 或 PublishIOPVFlag (xml 版) 字段填写为 C。

(4) 行情接收方面，由 IOPV 外部源机构提供的数据，本所将统一通过独立 IOPV 行情渠道发布，不会通过原竞价撮合系统行情 (行情网关 SecurityType=1 及 mkttdt00.txt) 转发。因此，为保障能接收完整的 IOPV 行情数据 (含未来外部源数据)，各市场机构必须完成独立 IOPV 行情渠道的接入。

(5) 上传机构应及时关注所申请电子证书的有效期限，如证书过期则其对应的请求将不会被本所接受及处理。

(6) 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。

5 相关技术文档

《IS419_上海证券交易所互联网交易平台市场参与者接口规格说明书 (IOPV 卷) 1.1 版_20260710》。

《IS118_上海证券交易所特定参与者接口规格说明书 (基金公司卷) 2.6 版_20260710》。

《IS111_上海证券交易所报盘软件错误代码表 3.29 版_20260319(固收迁移技术开发稿)》。