

上海证券交易所技术文档



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)
V1.0



上海证券交易所

二〇二五年八月

文档版本

日期	版本	状态	说明
2025.08.15	V1.0	开发稿	创建文档

目录

1. 实时报文格式约定	4
1.1. 报文通讯模式	4
1.2. 数据类型约定	4
1.3. 公共报文头定义	4
1.4. 请求和返回示例	5
2. 实时通讯类接口	5
2.1. IOPV 上传 (/upload/etf/netvalue)	5
3. 附录	6
3.1. 返回码列表	6
3.2. 拒绝原因码列表	7

1. 实时报文格式约定

1.1. 报文通讯模式

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,通过 POST+JSON 方式提交报文，报文采用 UTF-8 编码。

1.2. 数据类型约定

本规范使用的数据类型定义如下：

标识符	类型
C	字符型
N	数值型，并可参与数值计算
L	列表类型

数据处理规则：字符区分大小写。

Nx、Nx(y)：代表该字段内容为数值，NX 代表该字符串为整数，X 为该整数的最大长度；NX(Y)代表该字符串为浮点数，X 代表该字符串的最大长度，Y 代表小数位数，小数部分最多不超过 Y 位。

1.3. 公共报文头定义

请求参数：

字段名称	变量名	类型	长度	必填	备注
API 版本	version	C	10	Y	"1.0"
消息内容	msg	C	1024	Y	base64（原始业务报文 json 字符串，具体见第三章请求参数）
业务编码	bizId	C	3	Y	001:IOPV 更新
发送日期	sendDate	C	8	Y	yyyyMMdd，当前交易日
发送时间	sendTime	C	9	Y	HHmmSSsss
请求流水号	seqNo	C	64	Y	请求流水号每个机构下需不重复

机构代码	mctCode	C	5	Y	机构代码,由交易所分配
------	---------	---	---	---	-------------

响应参数:

通讯返回码	code	C	6	Y	参考返回码列表 4.1
通讯返回错误描述	message	C	24	Y	系统未知异常,其他各种可能的错误
响应结果	data			N	详见第三章响应参数
响应时间	respTime	C	17	Y	yyyyMMddHHmmSSsss

1.4. 请求和返回示例

请求示例:

```
{"msg":"base64xxxxxx","mctCode":"000000001","seqNo":"1243443d5d33s44444....","sendDate":"20210502","bizId":"001","sign":"rasXXXXX","mctCode":"XXXXX","version":"1.0","sendTime":"102020"}
```

响应示例:

```
{"message":"成功","code":"200"}
```

```
{"message":"请求失败","code":"200","data":{"marketId":"1002022022221021021","orderRejReason":"XXXXXX"}}
```

2. 实时通讯类接口

2.1. IOPV 上传 (/upload/etf/netvalue)

功能描述: 交易日 7:30-16:30, 指数机构申报实时参考净值

接口路径: /upload/etf/netvalue

数据格式:

请求方: 指数机构

字段名称	变量名	类型	长度	必填	备注
请求参数					
业务时间	businessTime	C	17	Y	yyyyMMddHHmmSSsss

					据此计算交易日
IOPV 数据	fundList	L		N	list 开始
行情 ID	marketId	N	19	Y	每日自 1 起递增，左侧无需补 0
证券代码	fundCode	C	6	Y	证券代码
每份基金实时参考净值	price	N	13(5)	Y	IOPV 值，需为非负数
IOPV 数据	fundList	L		N	list 结束
备注	Text	C	12	N	

响应参数					
行情 ID	marketId	N	19	N	
拒绝原因	orderRejReason	N	6	N	参考拒绝原因代码 4.2
备注	Text	C	24	N	

说明：

1. 每次上传请求中包含的产品数最大不超过 100 条，即行情 ID 不超过 100 个。
2. 行情 ID 字段在同一交易日内不可重复，不支持回溯，在同一个请求 List 中需增序排列，可跳号。
3. 只有当请求参数 list 内所有 IOPV 行情都被接受后，响应参数中通讯返回码 code 才会返回 200 表示更新成功。其他情况下，响应参数中的 data 将返回第一个处理失败的行情 ID 以及拒绝原因。

3. 附录

3.1. 返回码列表

代码	说明
200	操作成功
300	登录认证失败
400	未授权禁止访问
501	请求频繁请稍后重试
10000	内部错误，请联系上交所
19434	系统繁忙请重试
625006	重复请求

19042	参数校验失败
19334	验签失败

3.2. 拒绝原因码列表

代码	说明
625002	证券代码非法
625004	产品数量超过最大限制
625008	禁止行情回流