

上海栈道信息科技有限公司

期权场内、场外交易平台设计思路

Universal Futures and Options (UFO)

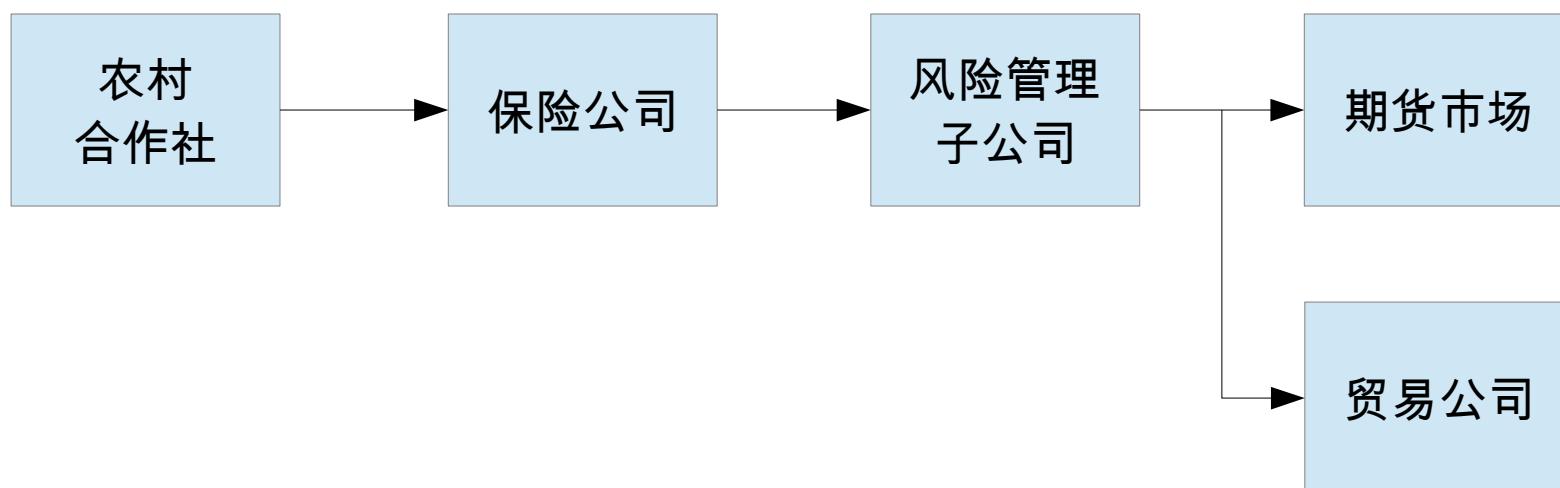


上海栈道信息科技有限公司

- 成立于 2014 年
- 由期权交易员研发的期权交易软件平台
- 开发思路：
 - 独立功能模块开发
 - 寻找企业应用场景
 - 组合功能模块满足企业需求

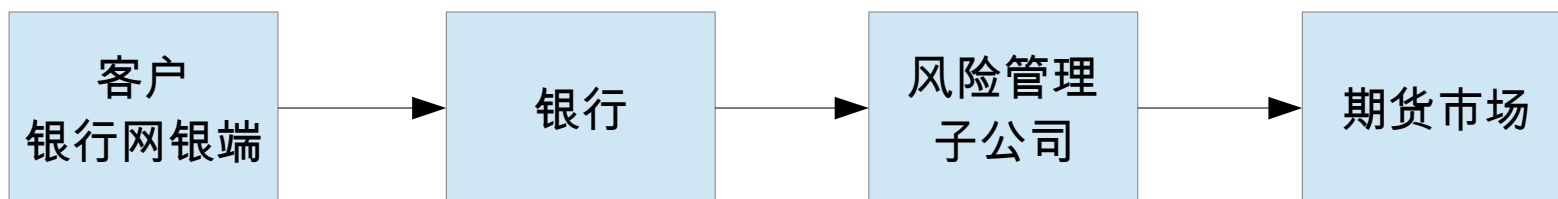
期权场内、场外软件产品的开发经历

- 2013 年全程参与了新湖瑞丰的锦州玉米‘二次点价 + 复制期权’的项目
 - 产品设计，“期货 + 保险”概念
 - 风险管理



期权场内、场外软件产品的开发经历

- 2015 年参与了某五大行的纸原油项目
 - 平台建设
 - 合规



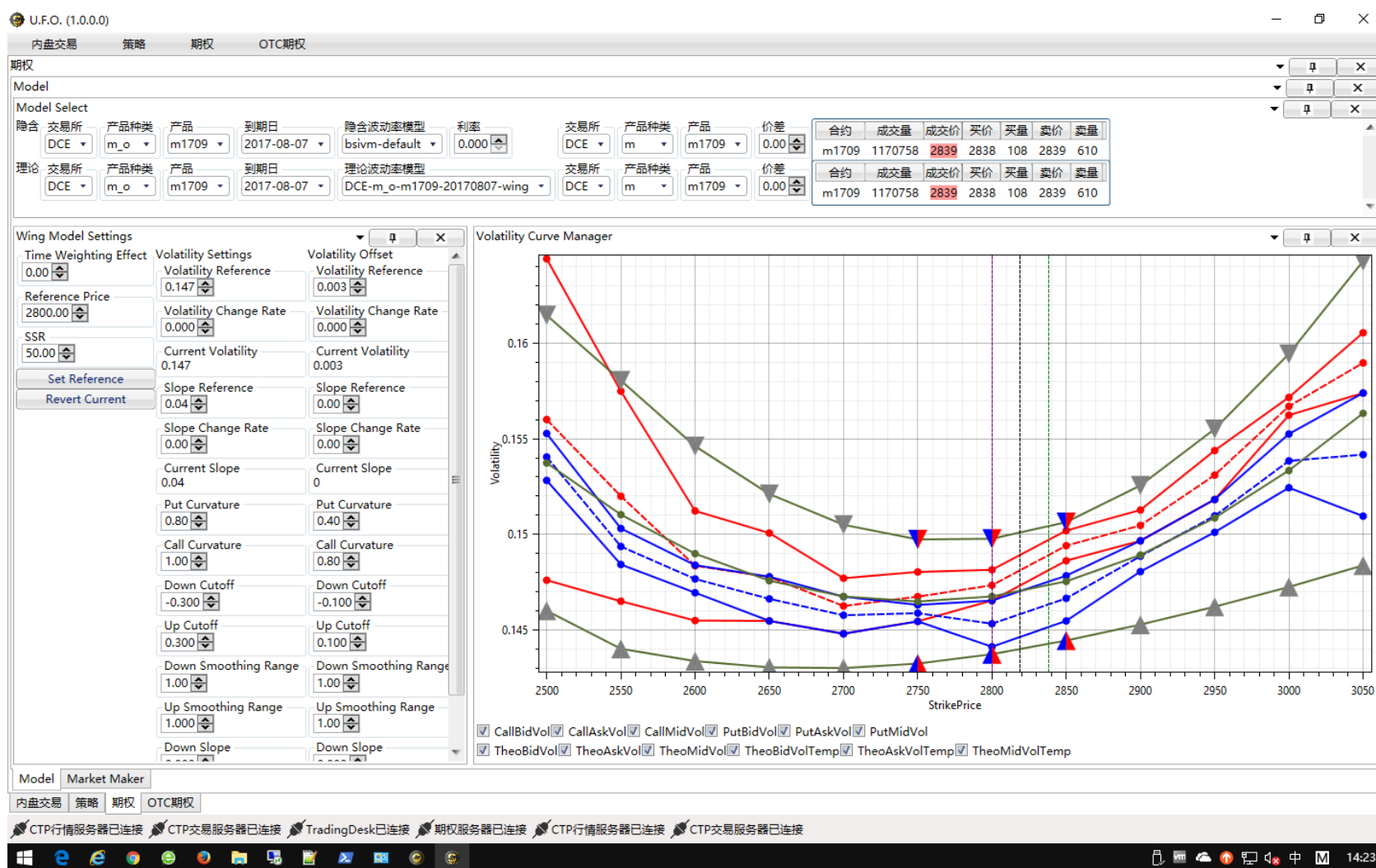
主要功能模块

| | 功能模块 | OnlineFutures | 分账户 (客户端) | 分账户 (管理后台) | OTC (客户端) | OTC (管理后台) |
|-----------------|----------------------|---------------|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 基本功能 (网页版) | 期货行情 (实时) | X | X | | X | |
| | 期权行情 (实时) | X | X | | X | |
| | 下单面板 | X | X | | X | |
| | 订单 | X | X | | X | |
| | 成交 | X | X | | X | |
| | 持仓 | X | X | | X | |
| | 账户 | X | X | | X | |
| | 风险报告 | X | X | | X | |
| 基本功能 (本地版) | 行情走势图表 | X | X | | X | |
| | 期货行情 (实时) | | | X | | X |
| | 期权行情 (实时) | | | X | | X |
| | 下单面板 | | | X | | X |
| | 订单 | | | X | | X |
| | 成交 | | | X | | X |
| | 持仓 | | | X | | X |
| | 账户和持仓组合 | | | X | | X |
| 第三方行情、 交易API | 风险报告 | | | X | | X |
| | 行情走势图表 | | | | | |
| | CTP (国内) | X | | X | | X |
| | CTS (境外) | | | | | |
| 第三方UI | SP (境外) | | | | | |
| | FIX | | | | | |
| 第三方UI | MetaTrader 4 | | | | | |
| 分账户系统、 风控 | 交易前风控 (Pre-trade) | | | X | | X |
| | 交易后风控 (Post-trade) | | | X | | X |
| | 分账户系统 | | | X | | X |
| | 持仓组合 (Portfolio) | | | | | X |
| 程序化交易 | 高级策略 | | | | | X |
| | 自动对冲 | | | | | X |
| 定价 | 指数定价 | | | | | X |
| | 期权定价 | | | | | X |
| 行情数据 (历史) | 日内 | X | | | | |
| | 日终 | X | | | | |
| | 其他时间周期 | | | | | |
| 数据中心 | 前端服务器集群 | | | | | |
| | 后端服务器集群 | | | | | |
| | 域名访问 | | | | | |
| | 云订单 | X | X | X | X | X |
| 推广 | 微信账号登陆 | | X | | X | |
| | 微信朋友圈 | X | X | | X | |
| | 微信公众号 | X | X | X | X | X |
| 支付 | 微信支付 | | X | X | X | X |
| | PayPal支付 | | X | X | X | X |
| | 银期转账 | X | | X | | X |
| 多语言 | 中文版 | X | | | | |
| | 英文版 | X | | | | |

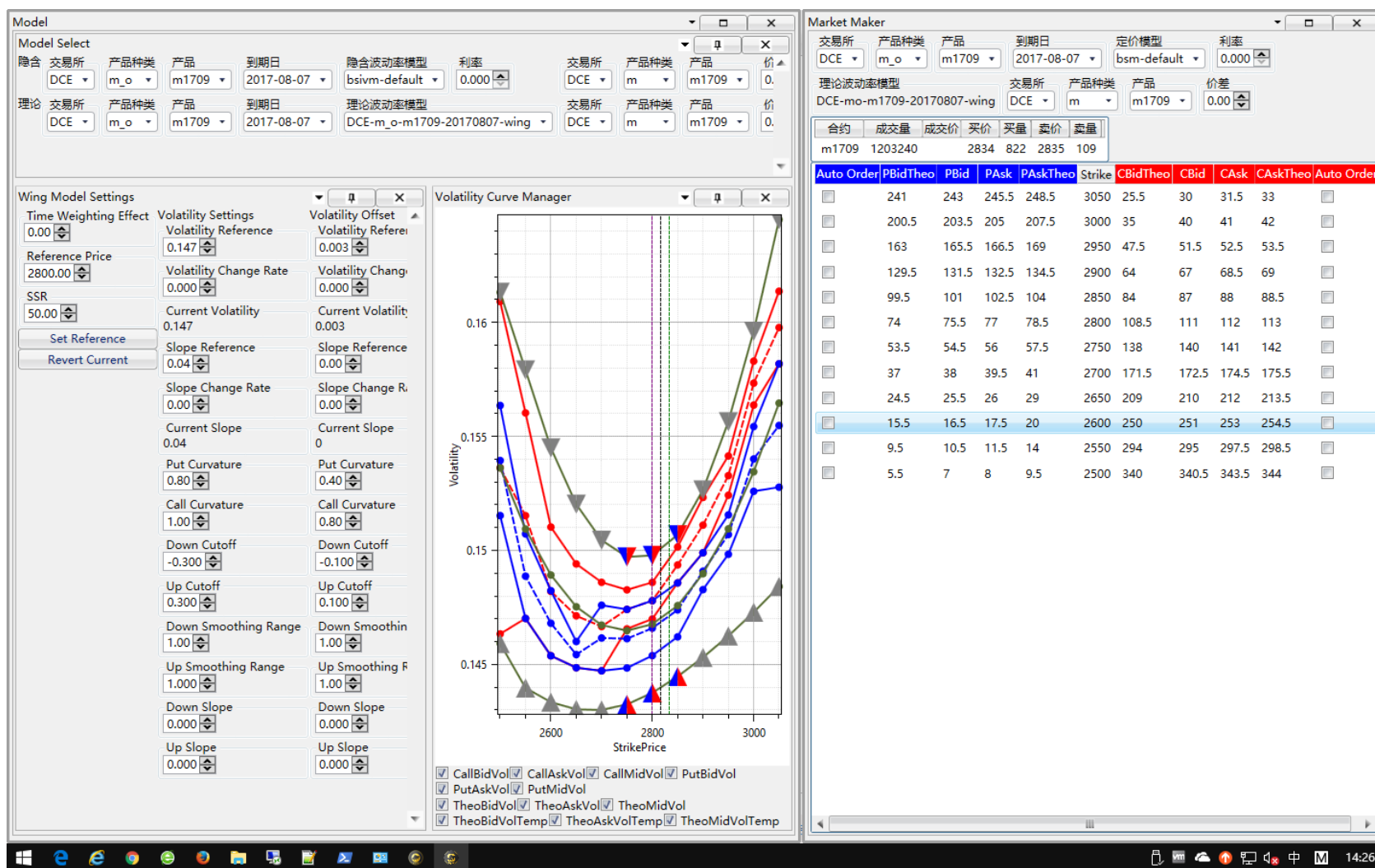
应用场景（ 1 ） - 交易所场内期权

- 适用群体
 - 期权做市商
 - 投资公司
- 功能模块
 - PC 版基本功能
 - 定价
 - 程序化交易
 - 账户系统、风控

应用场景（1）- 交易所场内期权



应用场景 (2) - 场外期权



应用场景（ 2 ） - 场外期权

- 适用群体
 - 风险管理子公司
- 功能模块
 - PC 版基本功能
 - 定价
 - 程序化交易
 - 账户系统、风控
 - 网页版基本功能
 - 微信推广

应用场景 (2) - 场外期权

