

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)

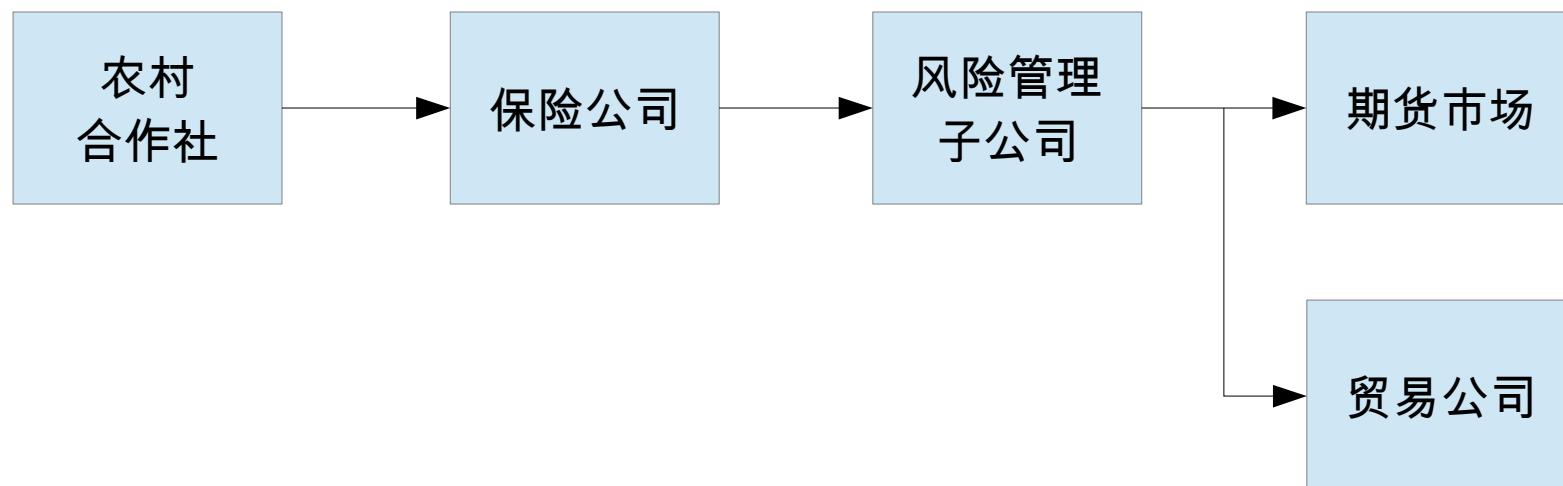


上海栈道信息科技有限公司

- 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

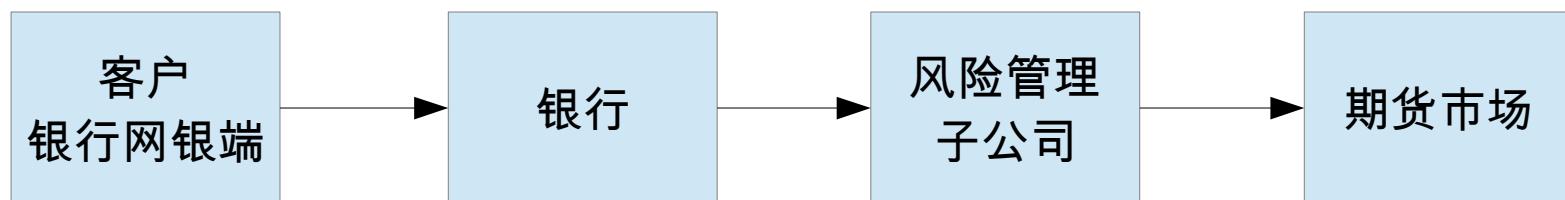
期权场内、场外软件产品的开发经历

- 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



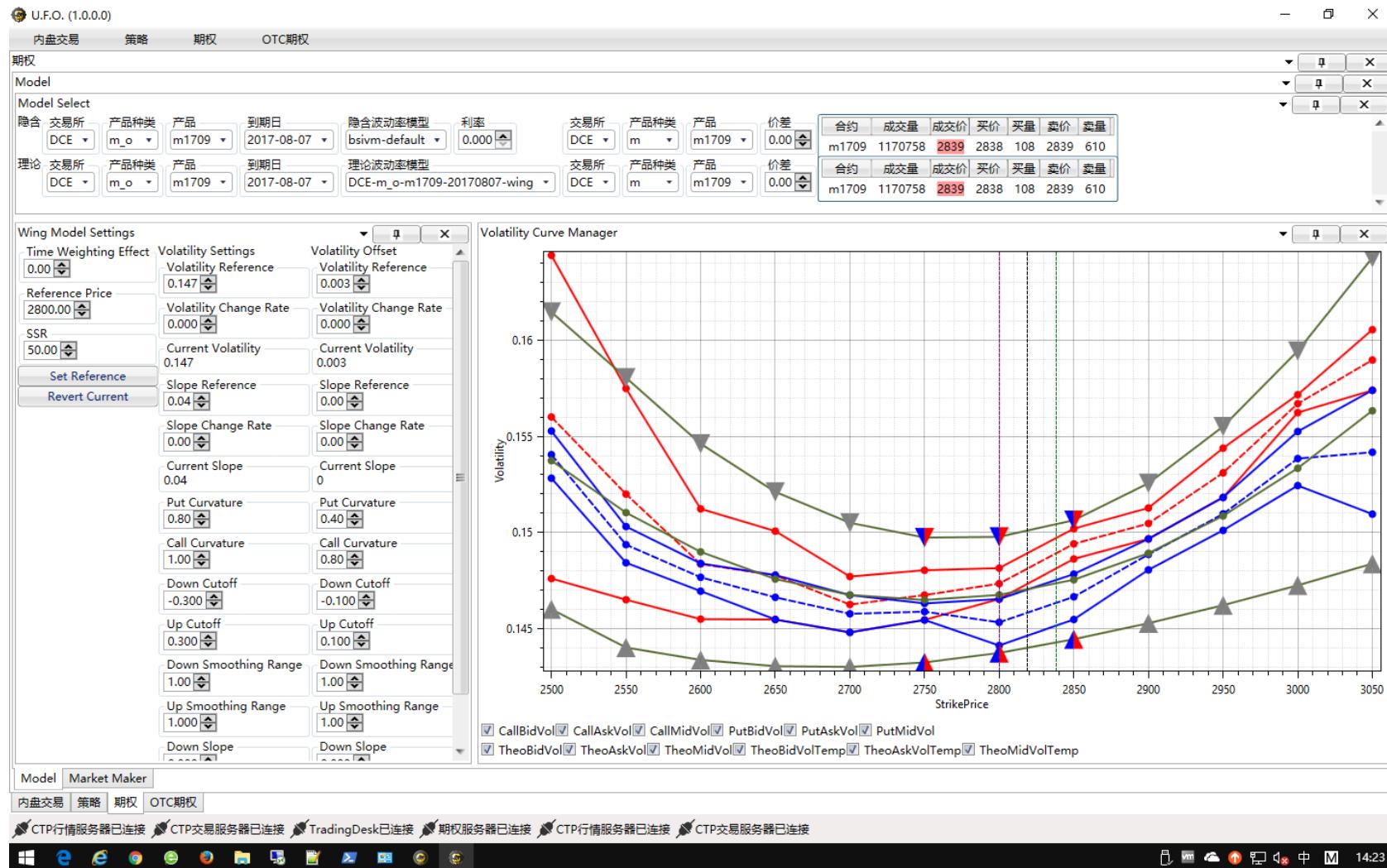
主要功能模块

	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)	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
	风险报告			x		x
第三方行情、 交易API	行情走势图表	x	x		x	
	CTP (国内)	x		x		x
	CTS (境外)					
	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				

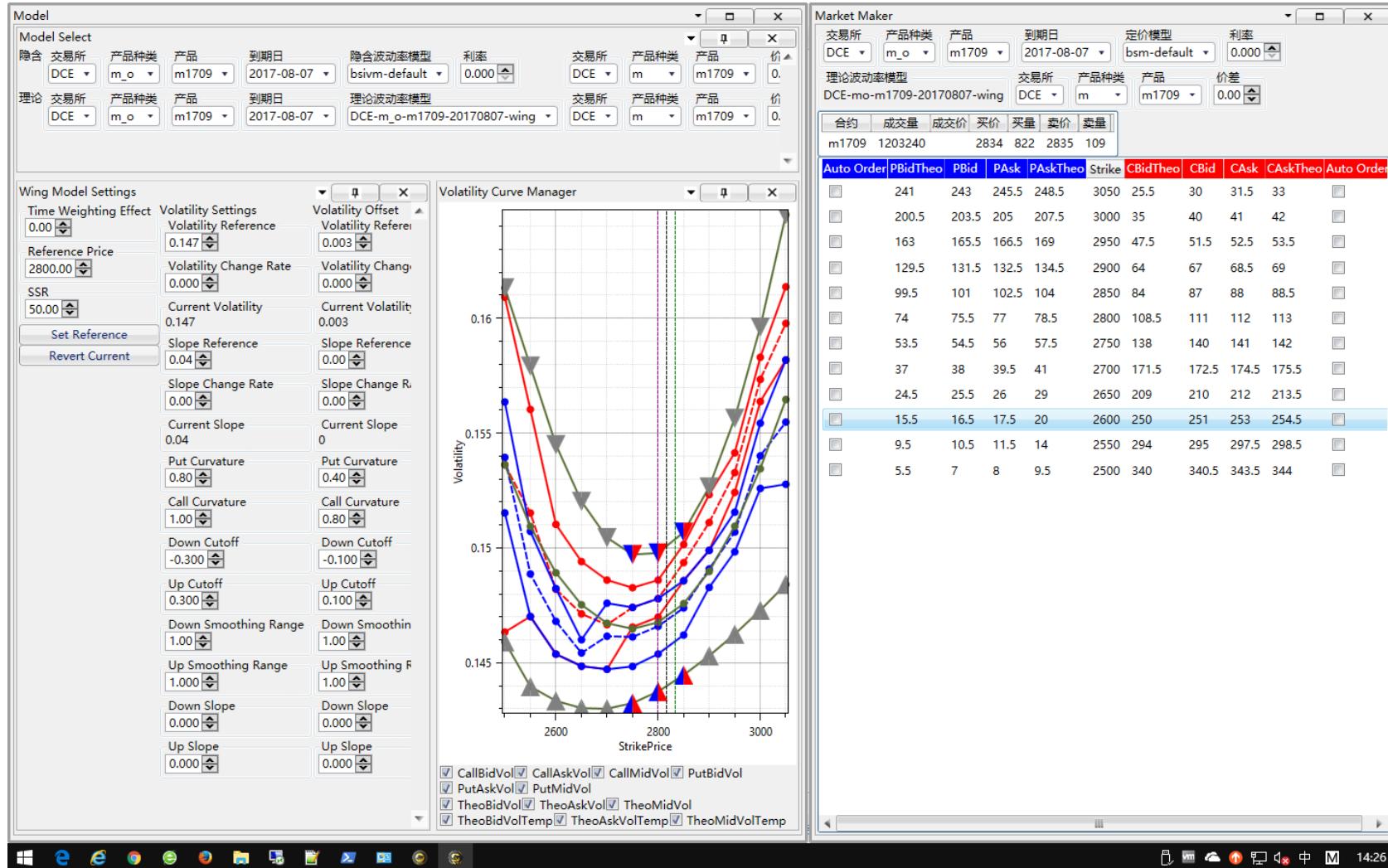
应用场景（1）- 交易所场内期权

- 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

铁矿期权 i1709 2017-08-31

期货:铁矿石1709

买量	买价	卖价	卖量	成交量
215	522.5	523	236	722974

看跌 141天 看涨

买价	卖价	执行价	买价	卖价
4.5	14.5	500	27.5	38
量:0	量:0	量:0	量:0	量:0
7	17.5	510	20	30.5
量:0	量:0	量:0	量:0	量:0
10.5	21	520	14	24.5
量:0	量:0	量:0	量:0	量:0
15.5	25.5	530	9	19
量:0	量:0	量:0	量:0	量:0
22	31.5	540	5.5	14.5
量:0	量:0	量:0	量:0	量:0
30	38	550	3	11.5
量:0	量:0	量:0	量:0	量:0
38	45.5	560	1.5	8.5
量:0	量:0	量:0	量:0	量:0
47.5	53.5	570	1	7
量:0	量:0	量:0	量:0	量:0
57	62	580	-	5.5
量:0	量:0	量:0	量:0	量:0
66.5	71	590	-	4.5
量:0	量:0	量:0	量:0	量:0
76.5	80	600	-	3.5
量:0	量:0	量:0	量:0	量:0

期权

Model

Model Select

隐含	交易所	产品种类	产品	到期日	隐含波动率模型	利率
理论	交易所	产品种类	产品	到期日	理论波动率模型	

交易所	产品种类	产品	价差
交易所	产品种类	产品	价差

合约	成交量	成交价	买价	买量	卖价
合约	成交量	成交价	买价	买量	卖价

Wing Model Settings

Time Weighting Effect

Volatility Settings

Volatility Offset

Volatility Reference

Volatility Change Rate

Volatility Reference

Volatility Change Rate

SSR

Set Reference

Revert Current

Current Volatility

Slope Reference

Slope Reference

Slope Change Rate

Slope Change Rate

Current Slope

Current Slope

Put Curvature

Put Curvature

Call Curvature

Call Curvature

Down Cutoff

Down Cutoff

Up Cutoff

Up Cutoff

Down Smoothing Range

Down Smoothing Range

Up Smoothing Range

Up Smoothing Range

Volatility Curve Manager

CallBidVol CallAskVol CallMidVol PutBidVol PutAskVol PutMidVol

TheoBidVol TheoAskVol TheoMidVol TheoBidVolTemp TheoAskVolTemp

TheoMidVolTemp

家
实时报价
我要交易
客户服务

内盘交易
策略
期权
OTC期权