



上海期货
信息技术有限公司

Shanghai Futures Information Technology Co.,Ltd.

综合交易平台(程序化交易)

实现方案说明书

文件状态:	文件标识:	
<input type="checkbox"/> 草稿	当前版本:	V4.01
<input checked="" type="checkbox"/> 正式发布	作 者:	综合交易平台产品组
<input type="checkbox"/> 正在修改	完成日期:	2009 年 5 月 13 日星期三

目 录

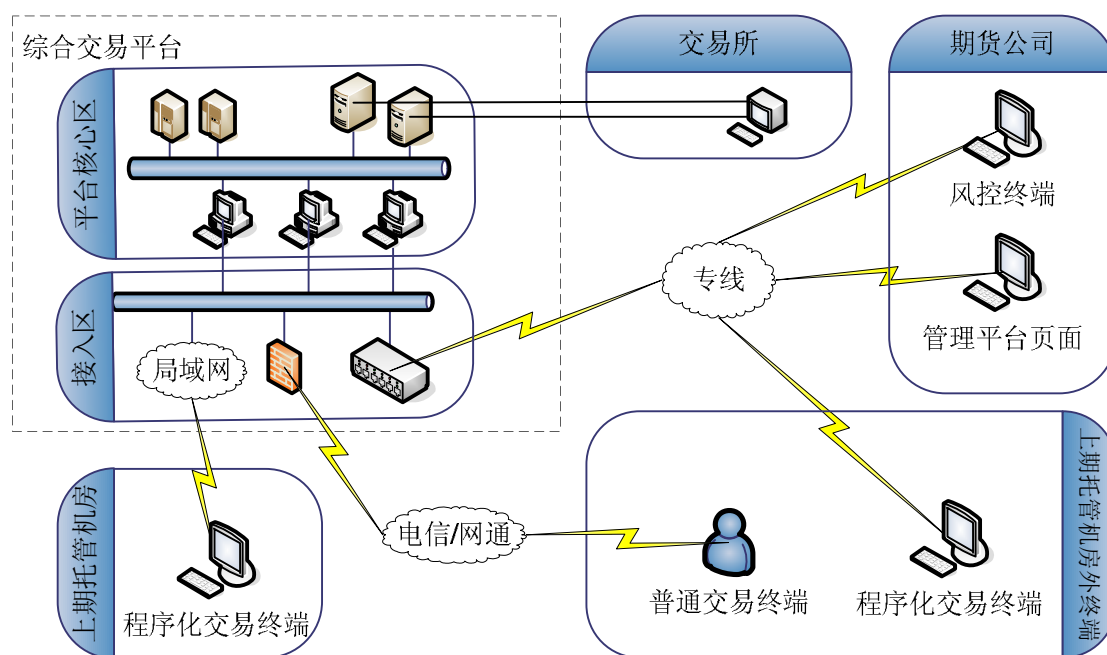
一、	方案简述	3
二、	方案优势	4
1.	开放的 API 接口	4
2.	高性能的交易后台	4
3.	高速的交易所通信线路.....	5
三、	成功案例	6

一、 方案简述

综合交易平台做为一个开放、快速、稳定、安全的期货交易、结算系统解决方案，随着接入期货公司的增多，其在期货界也获得了越来越普遍的认同。

国内期货界程序化交易热情的不断高涨，也为综合交易平台的蓬勃发展提供了契机。综合交易平台开放的接口、优异的性能、集中部署的创新模式以及经验丰富的技术背景都为程序化交易在国内的快速发展提供了最为优异的平台。综合交易平台现有的程序化交易客户对综合交易平台的解决方案给了很高的评价，其交易量也不断攀升。

下图是目前综合交易平台提供的程序化交易方案的部署图：



1. 期货公司在使用综合交易平台接入程序化交易前，需要首先成为综合交易平台主席（或二席）客户。
2. 综合交易平台提供开放的 API（基于 C++）及相关文档，并在客户进行程序化交易终端开发时提供技术帮助。
3. 为方便程序化交易终端的开发测试，综合交易平台免费提供其他成熟的交易终端供客户使用。在客户的程序化交易终端出现故障时，也可以使用该终端进行紧急处理。

4. 程序化交易终端可以使用专线接入综合交易平台，为进一步提高接入速度，客户也可以将程序化交易终端托管在上期技术机房。

二、 方案优势

1. 开放的 API 接口

综合交易平台从一开始就秉承“整合更多的技术资源为期货界提供最高端的解决方案”的宗旨，开放性的 API 接口是贯彻这一宗旨的必要前提。只有开放接口，综合交易平台才能在提供稳定高效的交易结算后台的同时满足期货交易客户的多样性、个性化的需求。

首先，开放性的接口给程序化交易者提供了直接接入交易后台的合法平台，程序化交易者再也不需要承受破解市面流行交易系统的私密接口进行非法接入的系统和商务风险，也不需要忍气吞声的使用交易系统厂商提供的、经过层层包裹而慢得要命的网关平台。

其次，程序化交易者可以使用开放的接口自行开发或是寻求可控的第三方技术帮助，这样程序化交易者既实现了交易的程序化，又能将自己的核心交易策略控制在自己手中。

另外，使用开放性的接口的程序化交易策略，在执行时采取的是编译后直接运行的模式，而不同于目前市面上提供的交易策略公式实现平台的解释执行模式，在瞬息万变的期货实时交易中，解释执行造成的时间延误往往会将一个成功的交易策略变成烧钱的机器。

2. 高性能的交易后台

综合交易平台 8000 笔/秒处理速度的交易引擎，整套系统在 0.5 毫秒以内处理完成报单、成交全过程的资金持仓计算的能力，以及无单点故障并实现负载均衡的交易系统体系架构树立了综合交易平台高性能的业界形象。

综合交易平台高性能的处理能力，对撤单率极高的程序化交易策略提供了最强大的支持，期货公司再也不需要在交易系统中关闭对程序化交易客户几十上百

万笔报单回报的收取，而使风险控制流于形式。

使用综合交易平台，期货公司在拥有高速交易能力的同时，也不用担心多上几个客户系统就会岌岌可危。综合交易平台目前的系统配置就拥有 2 万个客户同时在线的处理能力，还可以通过扩展前置机群进一步提升系统对更多客户在线的处理能力。

3. 高速的交易所通信线路

综合交易平台通过千兆局域网接入中金所和上期所交易系统，通过三所联网主干接入大商所和郑商所。

投资者在综合交易平台的报单直接进入综合交易平台的前置机，经过交易后台高速的资金持仓计算后再经局域网报到中金所和上期所，通过三所联网主干报到大商所和郑商所。行情服务器直连交易所并在同一个进程实现分发到行情前置，接收和分发完全在内存中完成，网络迟延也被压缩到了极点。

托管于上期技术的程序化交易终端，因为通过局域网接入综合交易平台，其报单和行情速度处于目前业内最快水平。

三、 成功案例

2008 年 8 月，上海金鹏期货经纪有限公司正式启用 CTS 作为主交易系统。

2008 年 9 月，宏源期货有限公司启用 CTS 作为二席交易系统。

2008 年 11 月，海南星海期货经纪有限公司正式启用 CTS 作为主交易系统。

2008 年 12 月，中期嘉合期货经纪有限公司正式启用 CTS 作为主交易系统。

2009 年 2 月，德邦期货经纪有限公司正式启用 CTS 作为二席交易系统。

2009 年 3 月，金海岸期货经纪有限公司正式启用 CTS 作为主交易系统。

2009 年 4 月，永大期货经纪有限公司正式启用 CTS 作为主交易系统。

2009 年 4 月，广发期货经纪有限公司正式启用 CTS 作为二席交易系统。

2009 年 4 月，华西期货经纪有限公司正式启用 CTS 作为二席交易系统。