

# 新时代、新理念、新发展 ——CTP 助力行业进步\*

上海期货信息技术有限公司总经理 邹文军

## 一、行业科技发展的机遇与挑战

中国期货衍生品市场发展的航母这几年逐浪前行，高速发展，目前有 90 个期货、期权产品，17518 个合约已经推向市场，还有诸多正在研发和推进过程中。期货与衍生品行业交易规模也在迅速发展，在此背景下，我们看到了行业科技发展面临的机遇与挑战。

2020 年 5 月 14 日，中共中央政治局常委会会议提出“深化供给侧结构性改革，充分发挥我国超大规模市场优势和内需潜力，构建国内国际双循环相互促进的新发展格局”。

在这一重大战略部署下，期货与衍生品行业也面临诸多挑战：

一是要加强实体经济发展，补短板，不断增强

自主创新能力，使其成为“十四五”经济发展的根基和主线。在此背景下，期货与衍生品行业应进一步凸显服务实体经济的作用。二是“一带一路”倡议在新发展背景下进一步巩固及创新，国际化参与也越来越深入。三是为应对气候变化，习总书记于 2020 年提出中国的“二氧化碳排放力争于 2030 年前达到峰值，努力争取 2060 年前实现碳中和”的目标承诺。我们认为“碳达峰”、“碳中和”对期货与衍生品交易品种的影响也将逐步显现。

在业务创新发展、交易量屡创新高、品种不断增加、国际化显著加快的背景下，行业科技发展既面临挑战，也充满机遇：

科技监管进一步向全面纵深发展，信息安全的重要性日益提升，系统松耦合、智能化等成为行业

\* 本文根据作者在第十八届上海衍生品市场论坛之上衍技术论坛上的演讲内容整理。

科技产品升级换代的重要目标；从行业科技运营管理创新来看，集团化管理、差异化服务、高效管理诉求日益凸显，统一结算、统一账户的管理诉求进一步迫切，数据互联、链接生态成为行业发展趋势，交易、风控、结算间的数据互联互通、数据平台化都是数字化转型的聚焦热点。

在机遇与挑战并存的情况下，我们认为未来期货行业数字化转型应主要考虑以下几点：

一要顺应服务实体经济这一主轴。科技要服务好行业，行业要为国家战略服务；二要落实数据平台化思路，进一步推动数据互联互通、系统间双向开放；三要把牢风险防范、合规运行这一底线；四要不断孵化创新科技、助力行业发展；五要进一步提升科技运营自动化、可视化能力，推动行业高质量、高效率发展；六要在信创的背景下推动信息安全、自主可控建设。

对于行业数字化转型的把握下，目前存在的问题及痛点主要有：

一是信息孤岛依然存在，系统间不能相互操作、历史数据利用率低、系统接口不完整不规范等问题依然存在；二是行业部分产品的技术栈<sup>1</sup>传统过时，对互联网时代新兴技术和手段的研究应用不足。金融科技的应用场景涉及少，同质化严重；三是部分系统产品的运行效率低，缺乏统一有效管理，对企业发展的快速适应能力较差；四是技术运维能力弱，运维操作不规范，应急处理能力不足，运维监控手段缺乏，运行风险高；五是网络安全和自主可靠与

当前行业治理要求不匹配，强调效率更多，强调安全较少，技术依存度高，自主程度低，风险大。

未来，行业科技发展的应对手段应着眼于以下几个方面：

一是建设并充分利用行业的 IT 基础设施，以平台化、组件化的思路来进行系统整合及优化建设；二是运用新科技赋能行业机构运营，在升级产品技术架构的同时，助力提升行业运营效率；三是学习和应用科技标准化成果，推动行业技术进步；四要进一步提升技术治理和数据治理水平、推动标准化、规范化发展；五是不断加大信创建设力度、确保网络安全和自主可控。

## 二、CTP——作为行业基础设施之应对

上期技术的 CTP<sup>2</sup> 产品自 2007 年上线生产以来，国内现阶段有 76 家期货公司使用 CTP 作为主用交易系统。CTP 专注于行业服务，不断夯实基础信息平台的服务能力；不断追求大容量、高稳定、高可靠、低延时，满足行业对服务质量及效率的要求；始终秉持开放理念，有所为有所不为，更好培育及发展衍生品科技生态；积极研究及应用各类创新技术、推动行业科技进步、服务发展新格局。

CTP 将本着架构开放、标准化的原则，聚焦主用系统，努力为客户提供稳定、好用的一站式业务管理平台。在目前用户广覆盖、业务全覆盖的基础上，逐步以新理念、新架构推动传统柜台系统向综合业务支撑系统转变，并以开放的思路不断提供更多接

<sup>1</sup> 技术栈：IT 术语，某项工作或某个职位需要掌握的一系列技能组合的统称。

<sup>2</sup> CTP：综合交易平台（Comprehensive Transaction Platform）的英文简称，是提供给期货经纪公司的主用、次用交易系统的成熟解决方案，根据国内金融、商品期货及衍生品和境内特定品种的交易、风控、结算等方面的业务细则，完备支持上期所、能源中心、中金所、大商所和郑商所等期货与期权业务。

口，推动支持多系统互联互通，助力行业生态健康发展。

在网络安全、信创建设上，上期技术也正在行动：在开放协议方面，近两年来，CTP 不断整合、升级各类开放数据接口，升级交易、风控类接口、重构账户类、结算类接口，不断推动行业接口标准化，为行业生态技术创新提供技术支持；在产品架构升级方面，以组件化、开放性为思路，进行客户平台、数据平台建设，不断规范及丰富各类 2C，2B 接口，助力更好的链接生态。

下面就现有 CTP 系列产品作简要介绍。

### （一）CTP 统一账户

CTP 统一账户系统是 CTP 新推出的服务期货公司全业务线，以客户为中心，拥有可扩展的客户流程及统一客户视图的管理平台。

统一账户覆盖期货、期权、资管、投资咨询、基金代销全业务线；以客户统一账号、以客户需求为导向；可实现客户账户、权限、资金、资产的统一视图；并对外提供标准接口，支持外部多方系统数据、流程互联互通。

### （二）CTP 新一代统一结算

CTP 结算服务面向境内外投资者，链接异构交易系统，服务全业务结算，加强技术创新，不断打造更加智能、更加便捷的统一结算平台。近两年上期技术做了大量的产品及技术创新，有的已上线发布，有的即将上线。

统一结算的宗旨在于互联互通，实现便捷、高效的结算服务，提供了异构次用系统交易标准化数据接口，满足交易系统数据互通所需，实现数据打通、接口标准化、功能按需使用的目标。

### （三）CTP 交易系统

CTP 交易系统本着支持行业未来发展，提升合规控制能力的思路。推进产品的性能、稳定性改造，力图实现更加开放、稳定、安全可靠、大容量、快速的目标。

### （四）CTP 新一代极笃运维平台

在助力运维智能化、可视化能力方面，CTP 推出了极笃运维平台产品。该产品融合上期技术数年的运维沉淀，综合考虑期货系统的运维特点，提供可靠、易用、可拓展的操作平台和应用场景，致力于提高运维安全性，降低运维风险，提高运维效率，为运维人员赋能。

同时该产品具有部署便捷、流程可定制、过程可审计、自动化、高并发支持等特点，目前已在多家期货公司应用使用。

### （五）CTP 新一代综合监控平台

针对期货运维行业的特点，CTP 也打造了一款覆盖运维监控、应用监控、主机监控和网络监控的全方位多维度综合监控平台，专门解决会员业务系统管理成本高、监控与业务脱离、故障定位难等问题，助力保障会员业务系统的健康性和可控性。

该综合监控平台具有一体化监控、多维度展示、可视化配置、灵活数据存取、精细化监控、可扩展性强等特点，帮助期货公司实现集中可视化、一体化、精细化监控的诉求。

### （六）极速交易系统

CTPmini 极速交易系统自 2018 年年底推出新一代以来，产品性能、功能、开放性均全面提升，目前已有 53 家会员客户，同时产品还针对新架构、高性能等问题进行进一步研发，以求不断创新。

### （七）股票期权

CTP 目前还提供服务于沪深两市股票期权及其股票现货业务的产品，产品根植于现有 CTP 期货交易系统，具备安全稳定、高速响应、高可靠性、大容量、可精确重演、灵活接入、快速清算、接口标准化等特点。

### （八）大数据支持

同时，CTP 还在规划进行大数据平台的设计及建设工作，实现数据的集中、标准化采集，为期货公司提供数据查询、分析、决策支持等服务。

未来，上期技术将继续秉持精益求精的精神、深耕聚焦主用系统、更好发挥 CTP 作为行业基础设施的作用：在技术升级方面，不断提升容量、性能和产品保障；在行业创新方面，继续积极响应与支持监管机构的创新业务，为用户提供安全稳定的系统，进一步推动 CTP 的全面开发，全面开放，更好服务会员的生态。

（责任编辑：黄颖蕴）