|  |
| --- |
| [键入公司名称] |
| Hybrid Trader |
| [键入文档副标题] |

|  |
| --- |
| 王瀛  2018-03-30 |

## 需求

1. 同时接收大商所和上期2个市场的一档行情。行情格式保持大商所和上期的对应的深度行情的定义，只是非一档行情部分内容都设为0
2. 策略需要读取多天策略日志，包括日盘和夜盘的数据
3. 最多保留50天的日志。日志采用滚动方式：达到50个文件，则新的文件覆盖最旧的日志文件
4. 多个历史文件名间需要加一个分隔符，用分号：";"

## 分析与设计

## 行情处理

## 主力合约管理

主力合约存放在一个文件中（与x-trader方式相同）。

由shell脚本分析当日的每个合约的行情数据文件大小生成推荐主力合约。主力合约存放为2个文件：当前主力合约和推荐主力合约。当前主力合约根据推荐主力合约由手动更新；推荐主力合约由shell脚本自动更新。

当前主力合约和推荐主力合约都按交易所分为2个文件：

* dce\_cur\_dominant\_contract.txt
* shfe\_cur\_dominant\_contract.txt
* dce\_new\_dominant\_contract.txt
* shfe\_new\_dominant\_contract.txt

## 收发行情

* Hybrid-trader使用当前主力合约文件的合约进行订阅
* 根据原始行情的exchange字段，生成对应的上期、大连的行情结构

## 信号及其委托单的处理

1. 暂定：策略so需要填充信号的exchange字段
2. 修改仓位管理，支持多个合约
3. 由信号转换为委托指令时要考虑 exchange字段处理

## Trader配置文件处理

## 配置文件的生成

1. 先按照x-trader方式生成x-trader.config
2. 然后根据dce\_cur\_dominant\_contract.txt，shfe\_cur\_dominant\_contract.txt更新exchange属性

## 策略so日志管理

1. 策略日志名

策略名\_yyyymmdd.txt，如st\_301rb\_20180324.txt

1. 日志文件数量滚动管理

最多保留最新的50个日志文件，包括日夜盘日志。通过shell script管理

1. 按时间降序顺序推送日志文件名给策略so
2. void st\_init\_(st\_config\_t \*config, int \*ret\_code, struct strat\_out\_log \*log, char history\_log[1500])