



数字货币交易框架

thenextquant

—— Flavio Huang

公司介绍

Thenextquant是数港通集团旗下的子公司，主要是维护开源项目thenextquant，以及提供量化交易相关的技术服务。

DigitalRoadGroup是一家数字资产技术券商，注册地在香港，公司主要提供数字货币流动性服务、量化交易以及技术服务。在流动性方面，我们为全球数字资产市场提供流动性服务，包括传统二级市场、数字货币市场。量化交易上，我们为客户提供基于内部技术开发的阿尔法策略，帮助自有资产/客户资产增值。我们有深厚的技术功底，我们为大/机构客户提供底层技术服务，方便其更好管理数字资产。

为什么要开源？

- 群策群力，框架可以更加强大
- 帮助技术实力相对较弱的公司或团队
- 提升Thenextquant知名度，寻找合作机会

为什么不使用现存的开源框架？

一开始我们也考虑过使用现存的开源框架，比如vnpy、fmz等，但我们在使用过程中发现这些框架不能满足我们自身发展的需求，具体表现在如下几方面：

- 安全性、稳定性
- 开发效率、运行效率
- 支撑一整套交易系统的底层架构
- 底层事件驱动、业务事件驱动
- 系统管理、策略管理、风险控制
- 数据存储、数据分析

我们的开发历程

thenextquant这一整套底层框架，我们陆续探索了接近2年的时间，在这接近2年的时间里，我们是拿着真金白银，实实在在的在币圈磕碰过来的，我们遇到了相当多的问题，但几乎都一一解决了，比如：

- 如何统一所有交易所的交易接口？
- 如何高效使用任意交易所的任意行情？
- 如何高效存储亿级别的交易数据？
- 如何高效部署管理上万个策略程序？
- 如何快速感知系统风险并快速解决？
- 如何管理几百上千个交易账户，以及巨量资产？
-

thenextquant和现存的开源框架的区别

thenextquant在开发过程中，也参考了现存的比较知名的开源框架，我们吸收了他们的优点，并致力于打造一个能够支撑一整套交易系统的底层框架，我们和这些开源框架的主要区别有如下几点：

- 基于 Python Asyncio 原生异步事件循环，处理更简洁，效率更高；
- 任意交易所的交易方式（现货、合约）统一，相同策略只需要区别不同配置，即可无缝切换任意交易所；
- 任意交易所的行情统一，并通过事件订阅的形式，回调触发策略执行不同指令；
- 支持任意多个策略协同运行；
- 支持任意多个策略分布式运行；
- 所有延迟都是毫秒级（10毫秒内，一般瓶颈在网络延迟）；
- 提供任务、监控、存储、事件发布等一系列高级功能；

未来我们将会做什么？

在未来，我们将会不断优化thenextquant开源框架，欢迎对量化交易感兴趣的同学多提出建设性的意见，共同优化框架。

同时，我们将定期把我们自己的系统架构分享出来，帮助更多的公司、团队搭建自己的交易系统。

当然，我们也会分享交易策略、风险控制相关的实践经验，和业内的同学们共同探讨。

我们也热切希望和内业的朋友们有深入的合作。



下次直播主题

主题: 框架使用入门

时间: 2019年6月12日(周三)

主讲: Flavio Huang

DigitalRoadGroup官网: <https://www.digitalroadgroup.com/>

TheNextQuant官网: <https://thenextquant.com/>

thenextquant开源项目: <https://github.com/TheNextQuant/thenextquant>