

System Specification

- System Specification
 - Strategy module
 - SRS_Strategy_001
 - SRS_Strategy_00101
 - SRS_Strategy_00102
 - SRS_Strategy_00103
 - SRS_Strategy_002
 - SRS_Strategy_00201
 - SRS_Strategy_003
 - SRS_Strategy_003001
 - SRS_Strategy_003002
 - SRS_Strategy_003003
 - SRS_Strategy_003004
 - SRS_Strategy_004
 - SRS_Strategy_005
 - SRS_Strategy_005001
 - SRS_Strategy_005002
 - SRS_Strategy_006
 - SRS_Strategy_006001
 - SRS_Strategy_006011
 - template table

Strategy module

SRS_Strategy_001

SRS_Strategy_001	
Description	<p>django_report模块基于Django3实现。它包含3个接口：</p> <ol style="list-style-type: none">1. 通过读取模板template_Report_001来实现策略的展示，该模板是一个html模板。2. 读取图像的IO接口。3. 策略的其它信息，通过json传递。
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	SRS_Strategy_00101,SRS_Strategy_00102,SRS_Strategy_00103

SRS_Strategy_00101

SRS_Strategy_00101	
Description	定义了SRS_Strategy_001中的模板，通过template_report_001实现。
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	template_Report_001

SRS_Strategy_00102

SRS_Strategy_00102	
Description	<p>描述SRS_Strategy_001中关于图像IO的要求。该接口以list方式实现。既可以接受基于base64的图像IO对象，也可以接受静态地址，或是上述的混合。</p>

SRS_Strategy_00102	
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	

SRS_Strategy_00103

SRS_Strategy_00103	
Description	描述SRS_Strategy_001中关于报告参数的要求，通过json传递。包括：报告类型、图片数量、关键参数描述(根据不同报告具有不同的参数)
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	

SRS_Strategy_002

SRS_Strategy_002	
Description	<p>规范image_engine具有根据需求输出图片的功能。</p> <p>可以设定输出到指定的url，或者输出为一个IO流。它具有3个接口：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 输出到的url 2.生成图片的内部模板参数 3. 图片所必须的数据，以json格式传入。
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	

SRS_Strategy_00201

SRS_Strategy_00201	
Description	非关键需求。在图片中增加水印
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	

SRS_Strategy_003

SRS_Strategy_003	
Description	针对账户的结算功能模块settle center的需求。根据给定的账户名称，读取历史净值数据，输出净值曲线数据和结算结果。
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	SRS_Strategy_003001

SRS_Strategy_003001

SRS_Strategy_003001	
Description	<p>对SRS_Strategy_003中净值结算的详细描述：</p> <ul style="list-style-type: none">1. 收益率profit;2. 年化收益率annualized return;3. 最大回撤max draw;4. sharpe ratio;5. sotino ratio;6. alpha系数;7. beta系数 <p>每一个数据分解为一个函数实现</p>

SRS_Strategy_003001	
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	

SRS_Strategy_003002

SRS_Strategy_003002	
Description	每一个settle都要有hash及属性，对于已经存在的settle，直接从本地读取。不存在的settle再从datahub中获取。settle通过redis进行管理。
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	

SRS_Strategy_003003

SRS_Strategy_003003	
Description	每次settle请求保存在redis数据库中1d的时间。
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	

SRS_Strategy_003004

SRS_Strategy_003004	
----------------------------	--

SRS_Strategy_003004	
Description	对于settle保存的数据结构进行定义。TBD
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	

SRS_Strategy_004

SRS_Strategy_004	
Description	order center从strategy engine接收买卖指令，并向risk manager发送请求。risk manager返回仓位建议。order center根据risk manager给出的仓位建议p%，对acc进行操作，核算所产生的下单量，并根据当前价格生成订单。
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	

SRS_Strategy_005

SRS_Strategy_005	
Description	risk manager是一个复杂系统，能根据市场环境给出仓位建议，包括总仓位建议和标的仓位建议。
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	

SRS_Strategy_005001

SRS_Strategy_005001	
Description	最简单的风险管理策略为定额仓位管理，即特定仓位比例。
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	

SRS_Strategy_005002

SRS_Strategy_005002	
Description	每个账户在risk manager里注册后，使用特定的仓位策略， 以及其参数。除非通过特定的流程修改， 该账户将一直使用这个仓位策略。
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	

SRS_Strategy_006

SRS_Strategy_006	
Description	strategy engine，关于strategy的基本需求：它是一个独立运行的app进程， 通过接收cmd来反馈策略信号，并且可以自由组合各种策略。其它TBD
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	

SRS_Strategy_006001

SRS_Strategy_006001	
Description	关于strategy的基本需求：它是一个独立运行的app进程，通过接收cmd来反馈策略信号，并且可以自由组合各种策略。其它TBD
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	

SRS_Strategy_006011

SRS_Strategy_006011	
Description	strategy engine的第一个策略，即根据K线形态来判断买入点和卖出点
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	

template table

Description	
Rationale	
Use Case	
Dependencies	
Supporting Material	