



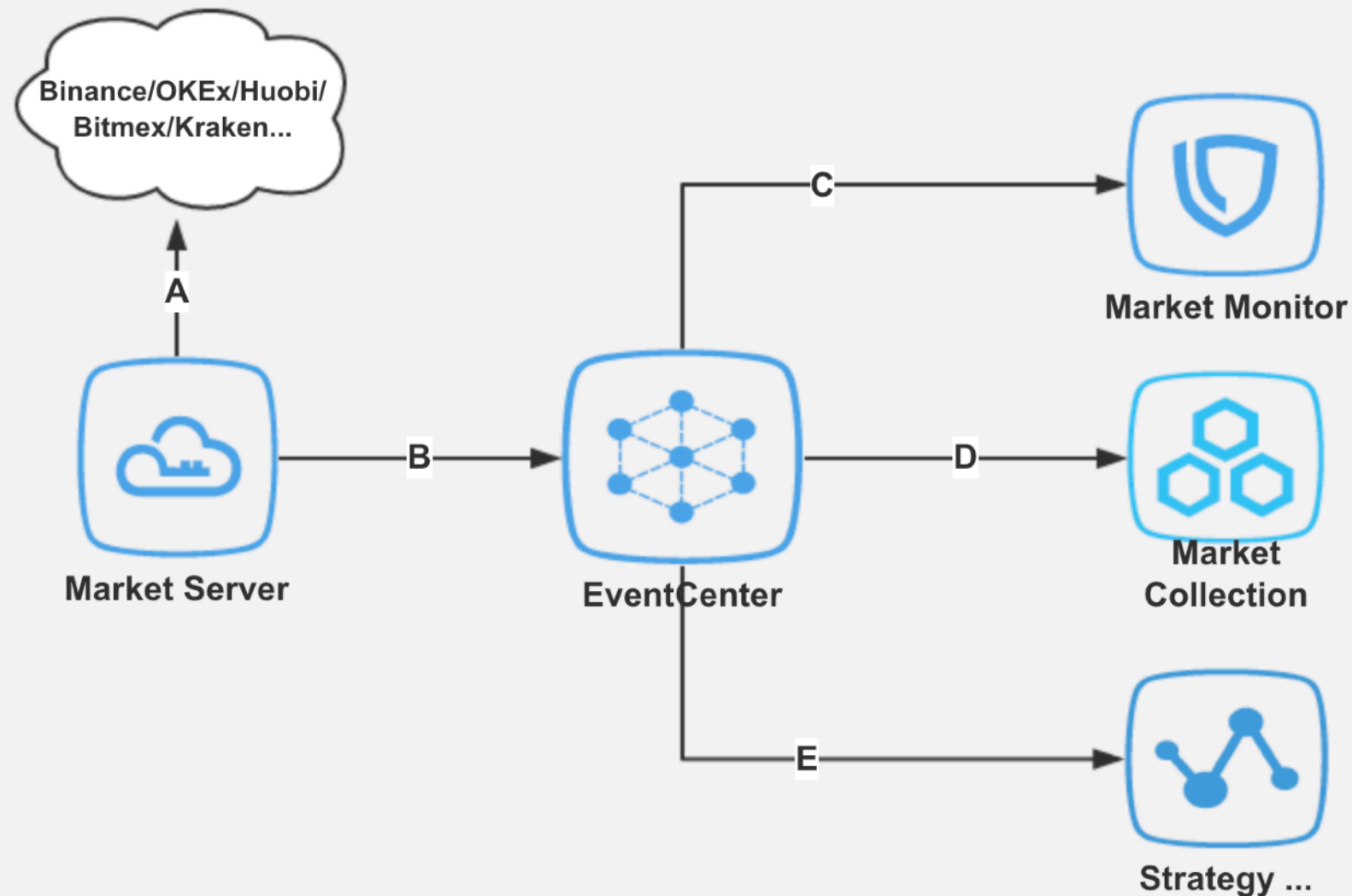
第五期

高效使用行情数据

—— Flavio Huang

Market System

Thenextquant Market System



- A. Market Server get Market data from Exchanges as soon as possible.
- B. Market Server publish MarketEvent to EventCenter.
- C. Market Monitor subscribe MarketEvent from EventCenter and implement supervision.
- D. Market Collection subscribe MarketEvent from EventCenter and restructure datas to database.
- E. Strategy subscribe MarketEvent, then they will determine whether send a trade instruction.

Market Server

行情服务根据各个交易所当前提供的不同方式，通过 REST API或Websocket方式实现了对各大交易所平台实时行情数据的获取及推送。

Github上 Market 项目有比较详细的 Market Server 的使用文档: <https://github.com/TheNextQuant/Market>

行情分类

当前 Market Server 搜集了部分常用的行情数据，他们包括：

- Orderbook 订单簿
- Kline K线
- Trade 成交

行情模块

thenextquant底层SDK提供了每种行情的数据结构对象封装。

- `from quant.market import Orderbook, Kline, Trade`

每种类型的行情，都包含了详细的信息，比如更新时间、成交价格、成交量等，我们可以通过行情对象直接访问使用。比如：

- `kline.open` 开盘价格
- `kline.close` 收盘价格
- ...

行情订阅

通过底层提供的订阅模块，可以方便订阅任意行情。我们首先导入订阅模块：

- `from quant.market import Market`

订阅行情需要指定4个参数，分别是：

- `market_type` 行情类型，由 `quant.const` 模块里定义
- `platform` 交易平台, e.g. bitmex、binance
- `symbol` 交易对, e.g. ETH/BTC
- `callback` 行情回调函数，必须是async异步函数



下次直播主题

主题: Asset资产系统介绍

时间: 2019年7月10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>