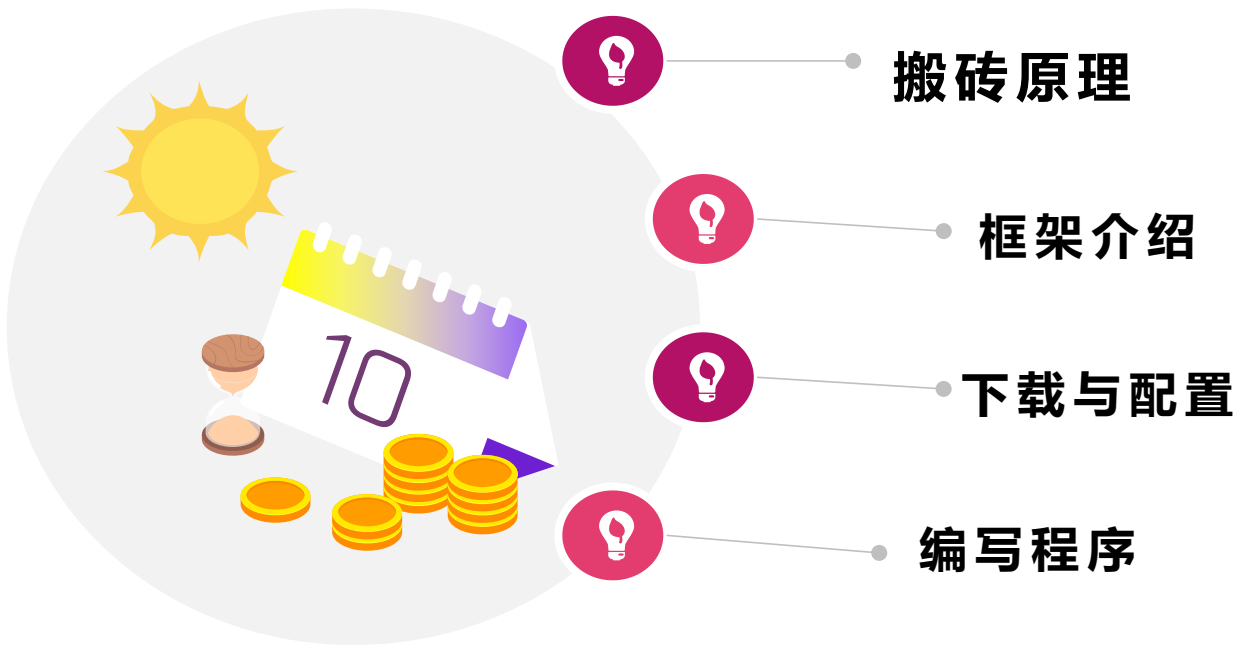


# 基于thenextquant 的搬砖套利演示

Paul-zhou  
2019-06-19

# 目录



# 1 搬砖介绍

指同一币种在不同交易所中价格存在一定差异，从价格低的平台买入、在价格高的平台卖出，跨平台来赚取其中的差价。  
(低买高卖)

举例：iPhone X，在不同的店价格就不一样，香港的店比北京的店卖得便宜，代购，在香港买个iPhoneX，然后转移到国内卖掉，赚取差价。

# 1 搬砖介绍

搬砖方式：

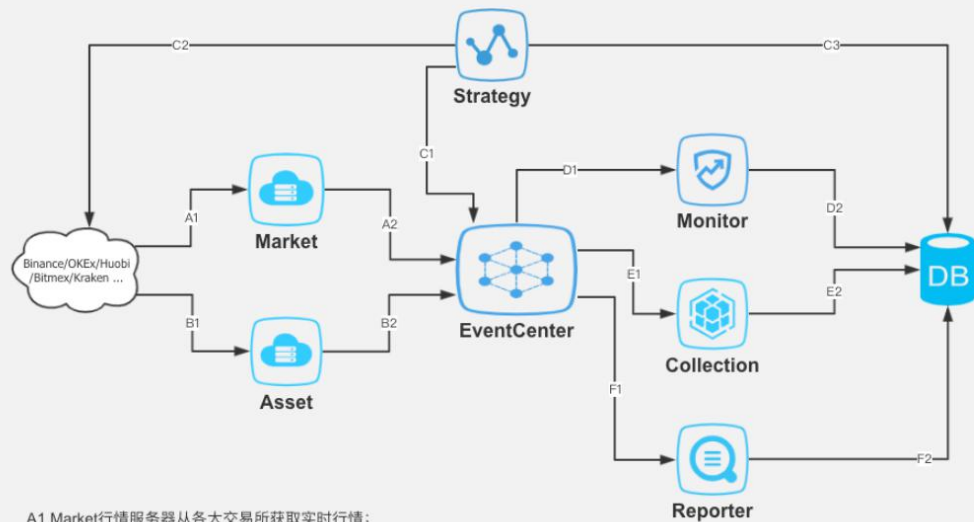
- (1) 跨平台搬砖：两腿套、三腿套
- (2) 平台内搬砖：三腿套
- (3) 场内-场外搬砖：OTC-场内

依赖条件：

- (1) 波动
- (2) 通道费用
- (3) 自动化

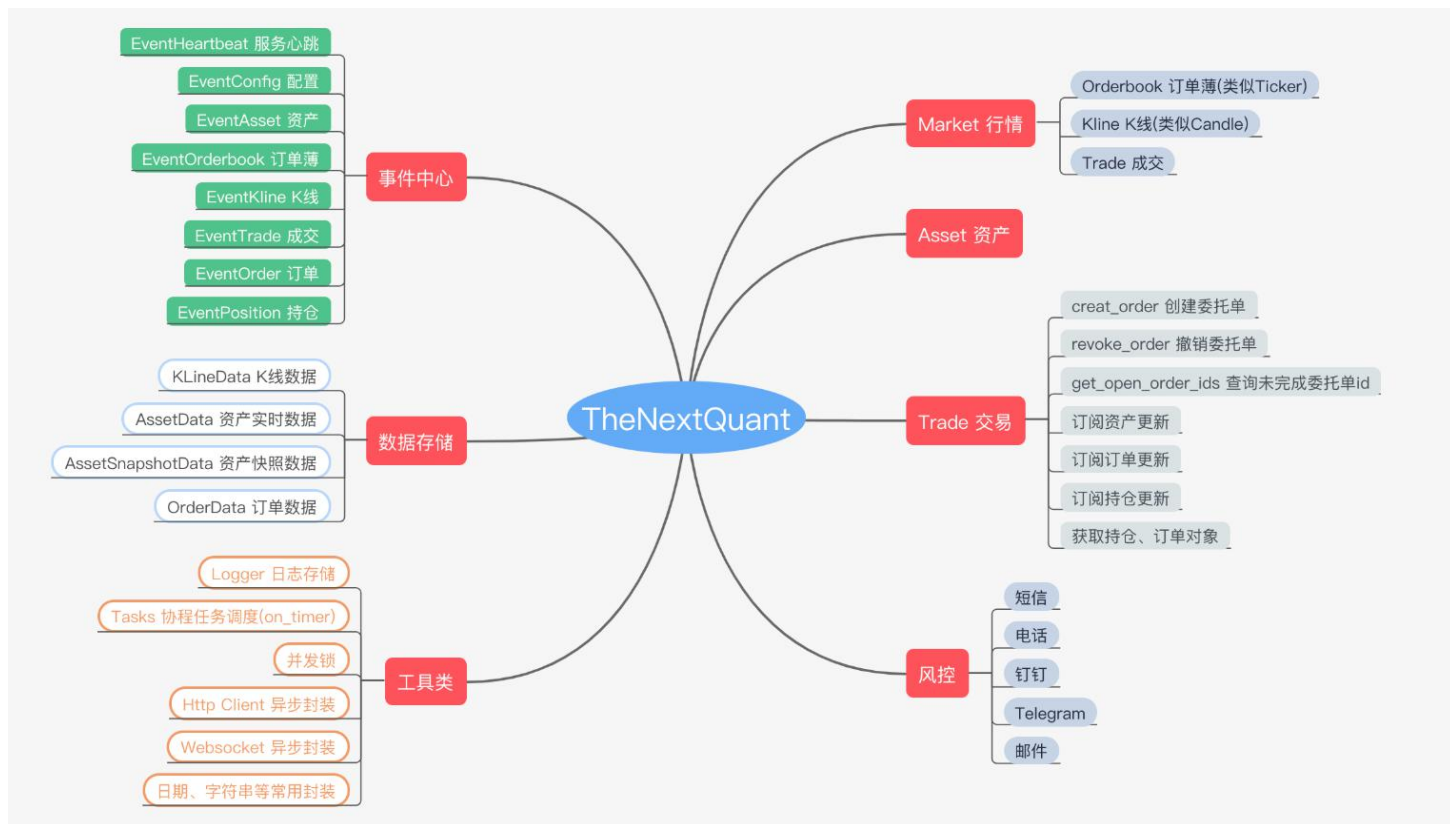
## 2 thenextquant框架简介

TheNextQuant交易系统架构图




- A1 Market行情服务器从各大交易所获取实时行情;
- A2 Market行情服务器将行情信息通过事件的形式发布至EventCenter事件中心;
- B1 Asset资产服务器从各大交易所同步实时资产数据;
- B2 Asset资产服务器将资产信息通过事件的形式发布至EventCenter事件中心;
- C1 Strategy策略服务器从EventCenter事件中心订阅实时行情、实时资产等信息,同时发布订单事件、持仓事件等至EventCenter事件中心;
- C2 Strategy策略服务器与各大交易所发起交易;
- C3 Strategy策略服务器存取数据至数据库;
- D1 Monitor风控服务器从EventCenter事件中心订阅行情、资产、订单、持仓等各种所需的事件,并实时计算监控规则和触发报警;
- D2 Monitor风控服务器将监控数据存储至数据库;
- E1 Collection服务器订阅行情、资产、订单、持仓等各种所需的事件,并经过整合收集处理;
- E2 Collection服务器将经过整合处理之后的数据,存储至数据库;
- F1 Reporter服务器订阅行情、资产、订单、持仓等各种所需的事件,并经过整合之后发出报表统计数据;
- F2 Reporter服务器将经过整合处理之后的报表统计数据,存储至数据库;

## 2 thenextquant框架简介



### 3 下载与配置

<https://github.com/TheNextQuant>



TheNextQuant

Follow

数港通 | DigitalRoadGroup

HongKong

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

Block or report user

Overview Repositories 3 Projects 0 Stars 6 Followers 0 Following 0

Popular repositories

**thenextquant**

事件驱动的量化交易/做市框架。

Python 28 9

**Market**

各大交易所的行情数据收集服务。

Python 2 1

**Asset**

资产服务器。

Python 1

Introducing activity overview

Now you can see an overview of a GitHub user's activity and filter activity by organization.

Nov Dec Jan Feb Mar Apr May Jun

2019

2018

## 5 程序编写

整体思路：

- (1) 行情：跟踪行情，捕获实时报价
- (2) 交易逻辑：动态挂撤单，“一挂一追”
- (3) 资产信息
- (4) 风控预警：钉钉、电话等



## 5 程序编写--写一个案例



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

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

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