

1. 行情数据包括 ask 和 bid, 深度数据
 2. 获取 okex 的 XAUTUSD 实时行情到 mt5, 跟 mt5 的 XAUUSD 叠加在同一图表, 图表有两个, 一个是 okex 的 ask 和 mt5 的 bid, 第二个是 okex 的 bid 和 mt5 的 ask, 画折线图, 图表上下排列
 3. 策略可以理解为网格策略, 策略参数, firstorder: 第一单的价差, nextorder: 跟上一单间的价差, maxordernum: 最大持仓单数, 止盈, okex 费率, mt5 费率, okex 下单数量, mt5 下单数量
 4. (1) 计算 okex 的 bid 和 mt5 的 ask 的差值, 当差值大于 firstorder 时市价下第一单, okex 开空, mt5 开多, 差值大于 firstorder+nextorder 时市价开第二单, 依次类推, 最大可持仓 maxordernum 单, okex 的空单用 ask 计算盈亏, mt5 的多单用 bid 计算盈亏, 当一组总盈亏大于止盈时, 市价平一组订单
(2) 计算 mt5 的 bid 和 okex 的 ask 的差值, 当差值大于 firstorder 时市价下第一单, mt5 开空, okex 开多, 差值大于 firstorder+nextorder 时市价开第二单, 依次类推, 最大可持仓 maxordernum 单, mt5 的空单用 ask 计算盈亏, okex 的多单用 bid 计算盈亏, 当一组总盈亏大于止盈时, 市价平一组订单
(3) 深度获取第一档, 第一档不够用新第一档补充, 计算出成交均价。
(4) 挂单改成实价单, 比如说就是固定的手数, 比如说下了一手或者说 1000 张, 那么就获取档一的这个深度。如果档一的深度这个不够的话, 比如说有只有 600 张, 那么剩下 400 张再取新的档一, 那么之前的档二不就又变成档一了吗? 就再获取新的档一, 然后再。去下剩余的单。
(5) 注意①盈亏计算都自己计算, 不用接口获取的盈亏 ②okex 同一个品种只会加在一起显示一个持仓, 要分成单个的订单进行持仓统计
 5. 所有设计代码模块化时留好位置, 方便后面增加 okex 的其他品种或者增加其他交易所
- 5、订单面板: (1) 不用系统的订单工具, 图表上做一个新的订单工具
- (2) okex 和 mt5 的订单每笔对应, 监控盈亏, 并计算, 如图

(3) 费用包括 成交手续费*2+持仓费+隔夜费

		Mt5					Okex						
		Mt5 累计总盈亏					Okex 累计总盈亏					累计总盈亏	
开仓时间	平仓时间	订单号	数量	成交价	费用	盈亏	订单号	数量	成交价	费用	盈亏	单笔盈亏	