算法交易系统需求分析

1. Exchange
2. Account

功能：计算账户余额，持仓数据。

1. 模块1

功能：发送价格数据。

1. 模块2

功能：接收仓位信息。

1. Server
2. Market Data:

功能：接收来自交易所的交易数据，统一格式，存储到内存和数据库。

1. CEP

功能：调用strategy类，处理数据，根据strategy给出仓位信号。

1. Order Manager
2. RMS

功能：设置仓位限制，检查信号是否符合规定。

1. Order

功能：类型，仓位数量，发送交易所。

1. Application
2. UI

功能：人为调整参数。

1. Order/Execution Monitor

功能：展示下单记录。

1. State Management

功能：PNL+position

1. RMS

功能：持仓比例，集中度，夏普，波动率，成本，如果发现异常则人为调整。