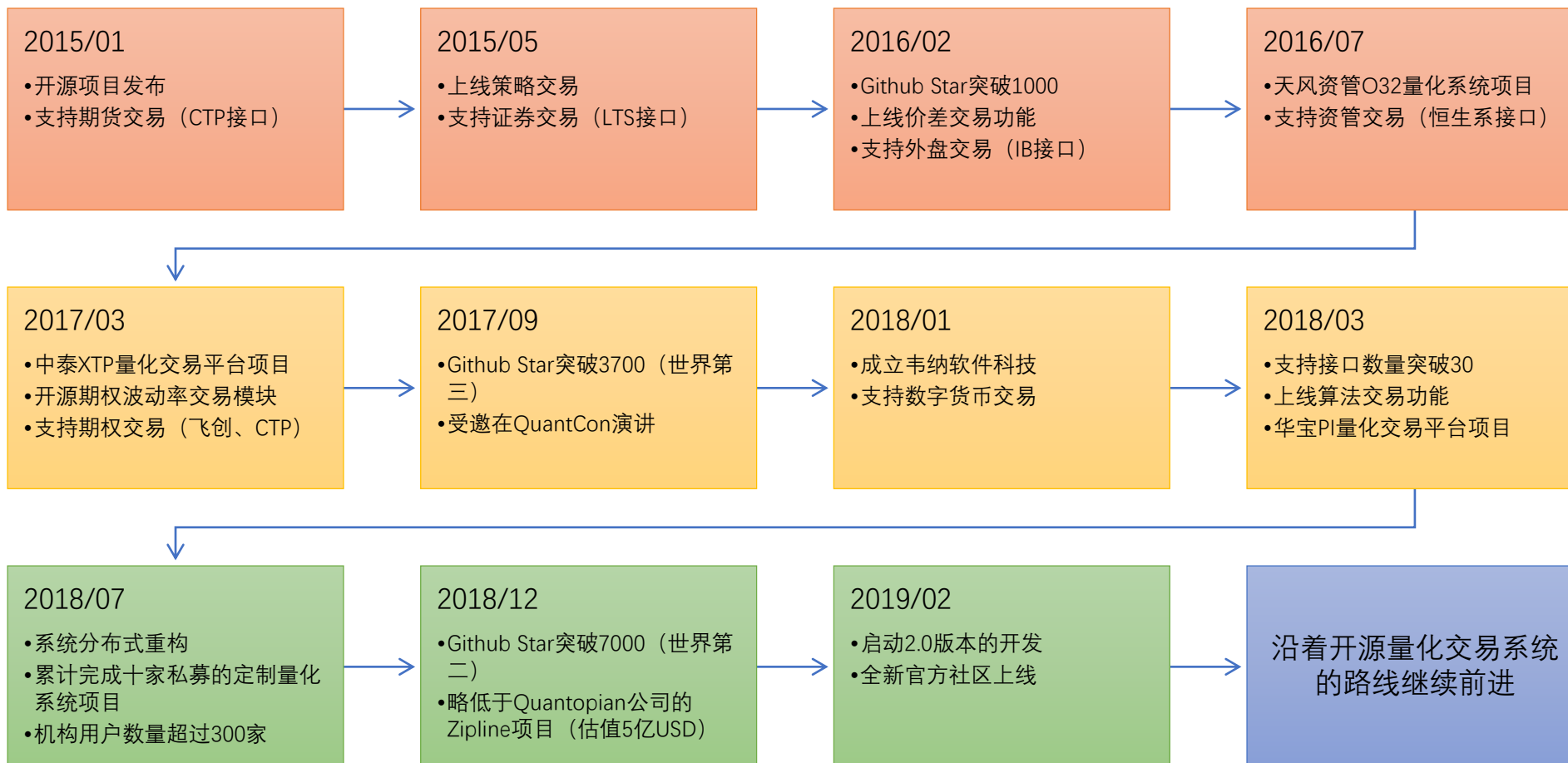


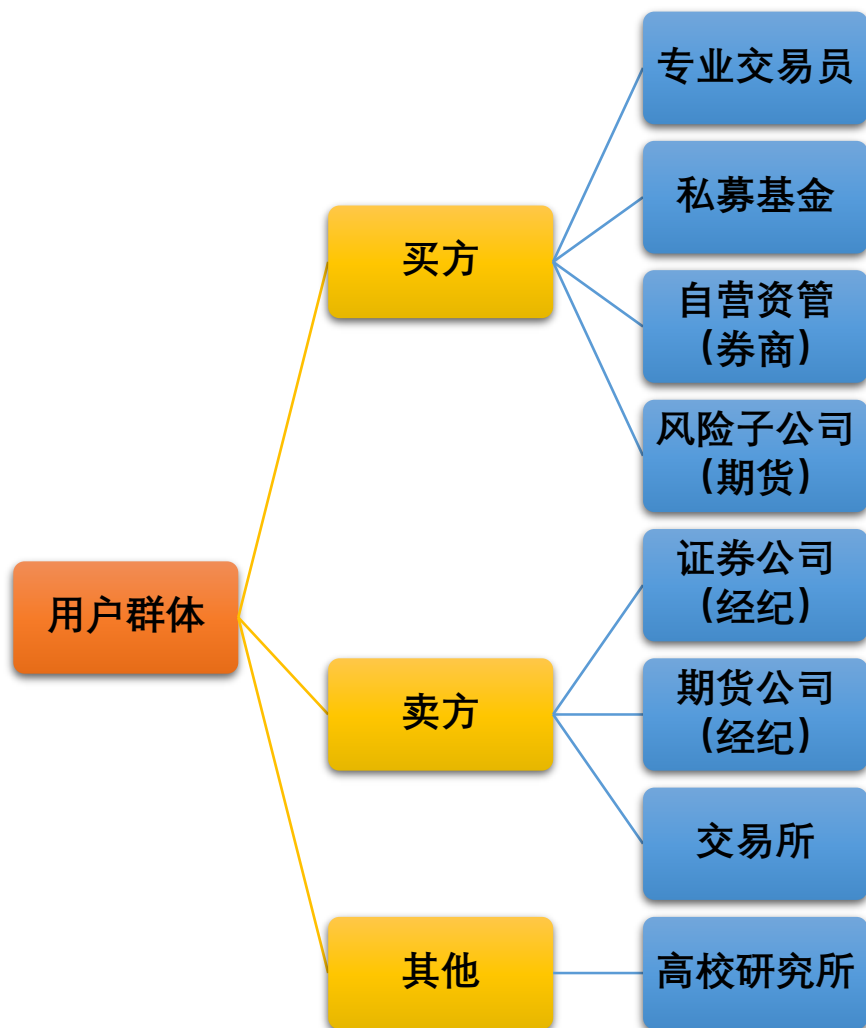
vn.py量化交易平台

By Traders, For Traders.

发展历史

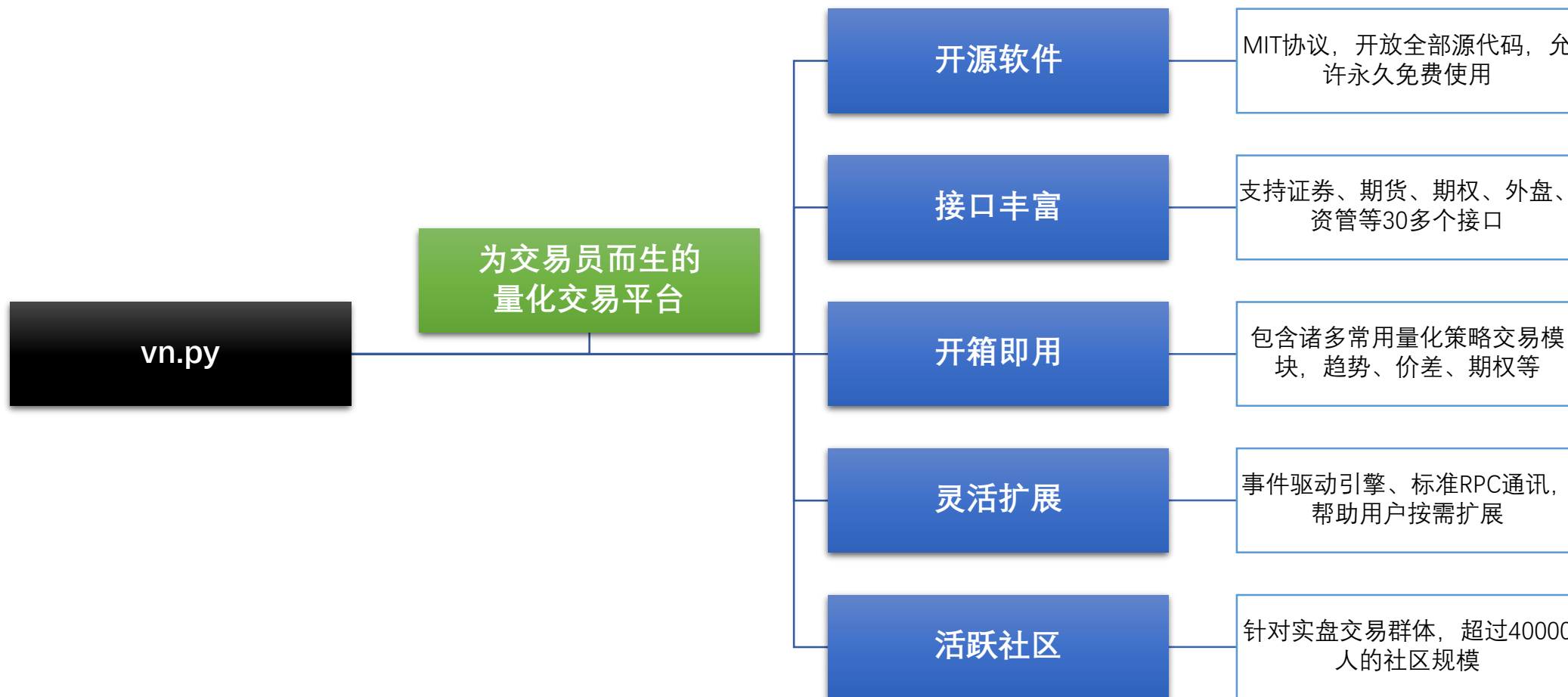


用户数据



- 社区用户群体**40000+**（基于Github Star数量统计推算）
- 机构用户数量超过450家，管理规模中位数超过3000万（基于社区论坛统计数据）
- 用户案例：
 - 中泰证券（XTP量化柜台）
 - 安信证券（资管量化）
 - 杰奥普鑫投资（期权高频）
 - 幻方投资（内外盘套利）
 - 上期所（商品指数仿真）
 - 厦门大学（数字货币研究）

平台特点



Python语言



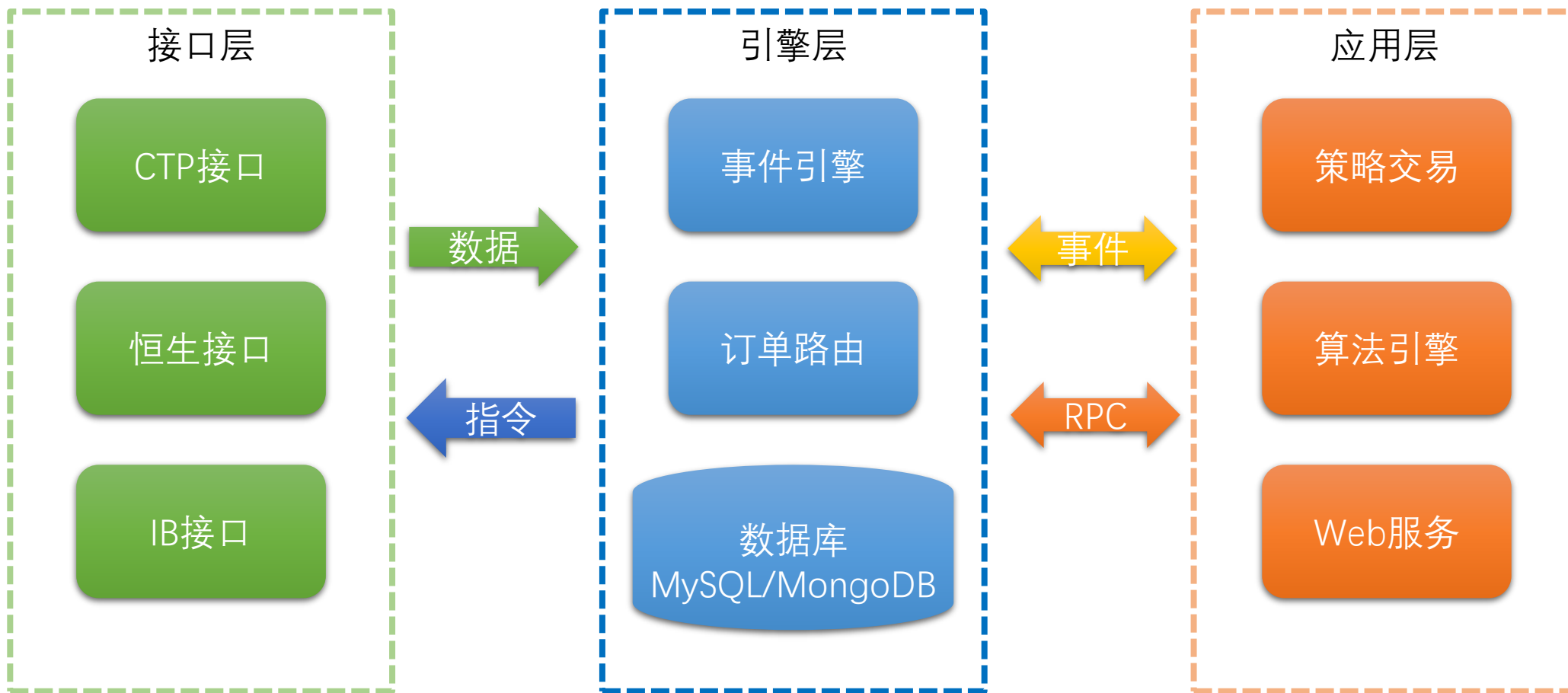
一种面向对象的解释型语言，语法简洁优雅易学易用（3天快速上手）

众多国内外金融机构在量化投资业务上的选择（JP Morgan、AQR、幻方投资）

在大数据和机器学习领域占据统治性地位：Pandas、TensorFlow、PyTorch

功能覆盖量化交易全业务：数据整理、建模分析、实盘交易、系统开发

开放架构

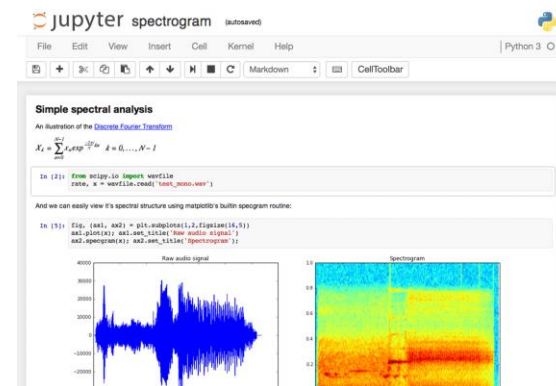
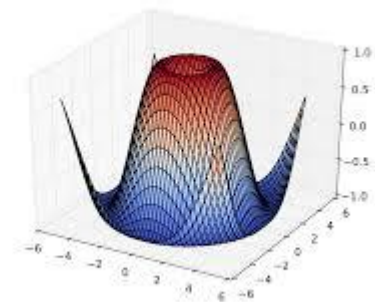
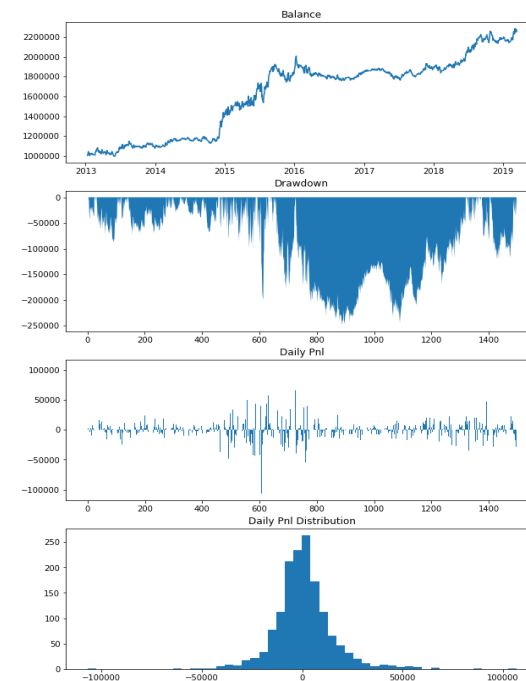


接口支持

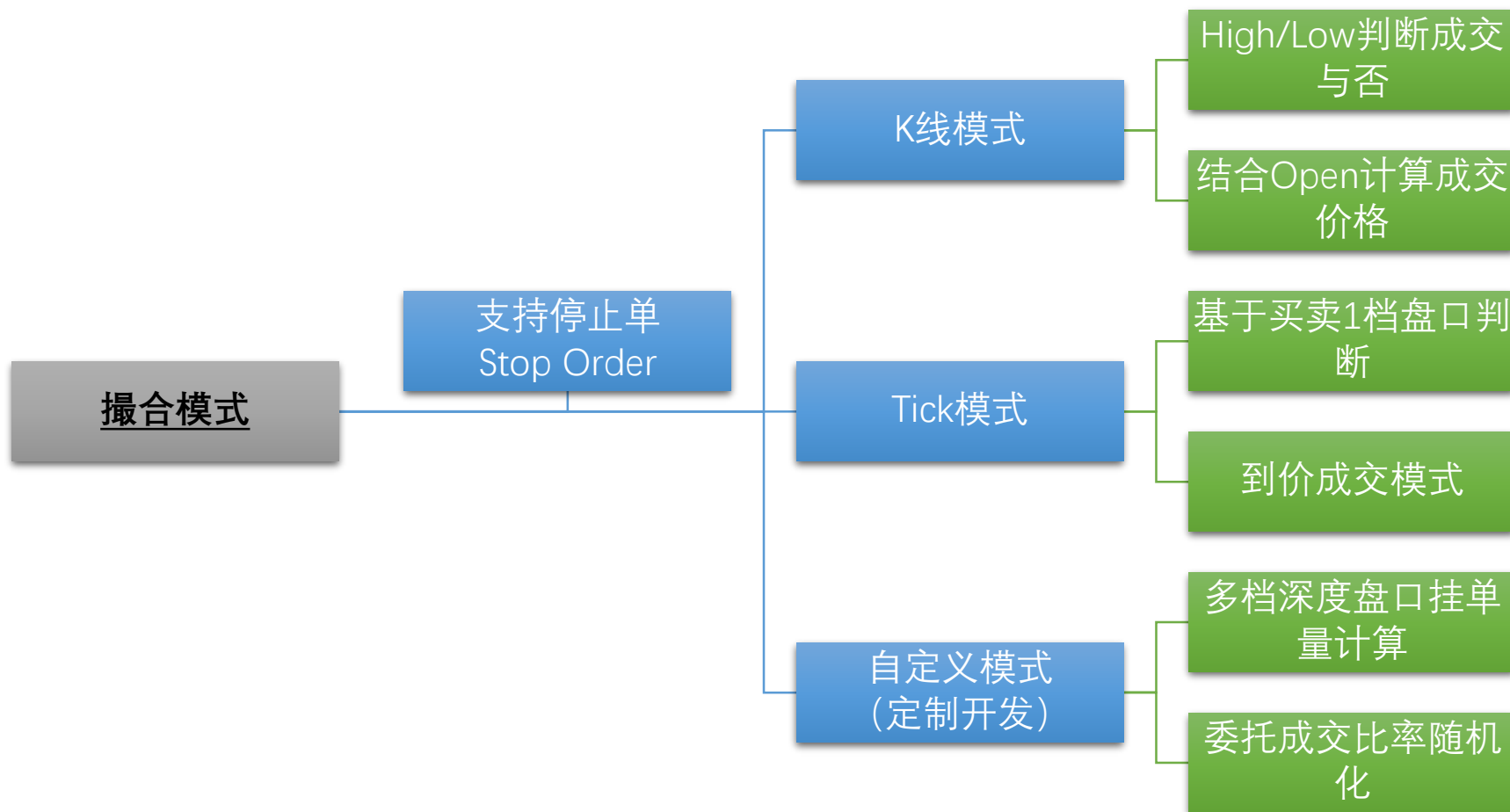
期货	CTP、飞创、飞马、量投、飞鼠、金仕达
证券	宽睿极速柜台、恒生PB、顶点集中
期权	CTP证券、飞创证券、顶点VIP、恒生UFT
资管	恒生O32、恒生PB、融航、鑫管家
外盘	盈透IB、直达期货、富途证券、老虎证券
数字货币	BitMEX、OKEX、火币、币安、Bitfinex

策略交易

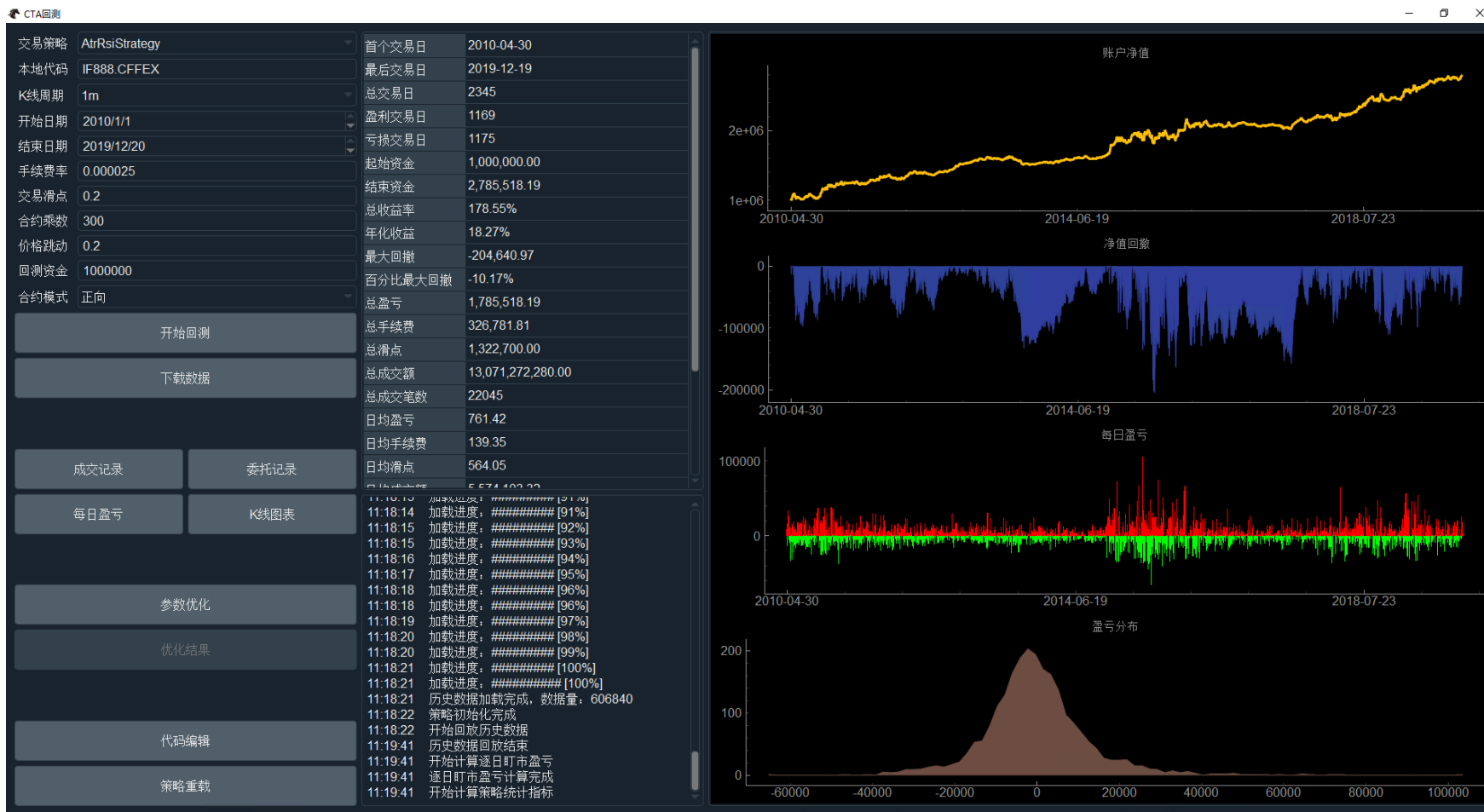
- 基于模板快速开发量化交易策略
- 允许修改任意细节的回测引擎：如撮合规则、统计字段等
- 结合Python的机器学习生态开发智能化交易策略



撮合原理



回测分析



- 详尽统计指标
 - 盈亏类
 - 成交类
 - Sharpe类
- 直观图表结果
 - 净值曲线
 - 净值回撤
 - 每日盈亏
 - 概率分布

逐笔记录



回测成交记录

成交号	委托号	代码	交易所	方向	开平	价格	数量	时间	
1	1	IF888	CFFEX	多	开	2302.3999...	1	2010-04-3...	B
2	2	IF888	CFFEX	空	平	2288.8	1	2010-04-3...	B
3	3	IF888	CFFEX	空	开	2286.3999...	1	2010-04-3...	B
4	4	IF888	CFFEX	多	平	2291.6	1	2010-04-3...	B
5	5	IF888	CFFEX	多	开	2292.1999...	1	2010-04-3...	B
6	6	IF888	CFFEX	空	平	2290.4	1	2010-04-3...	B
7	7	IF888	CFFEX	空	开	2288.5999...	1	2010-04-3...	B
8	8	IF888	CFFEX	多	平	2272.4	1	2010-04-3...	B
9	9	IF888	CFFEX	多	开	2275.9999...	1	2010-04-3...	B
10	10	IF888	CFFEX	空	平	2267.8	1	2010-04-3...	B
11	11	IF888	CFFEX	空	开	2262.3999...	1	2010-04-3...	B
12	12	IF888	CFFEX	多	平	2262.2	1	2010-04-3...	B
13	13	IF888	CFFEX	多	开	2263.7999...	1	2010-04-3...	B
14	14	IF888	CFFEX	空	平	2280.9999...	1	2010-05-0...	B
15	15	IF888	CFFEX	空	开	2283.5999...	1	2010-05-0...	B
16	16	IF888	CFFEX	多	平	2280.8	1	2010-05-0...	B
17	17	IF888	CFFEX	多	开	2292.1999...	1	2010-05-0...	B
18	18	IF888	CFFEX	空	平	2275.4	1	2010-05-0...	B
19	19	IF888	CFFEX	空	开	2276.3999...	1	2010-05-0...	B
20	20	IF888	CFFEX	多	平	2250.0	1	2010-05-0...	B
21	21	IF888	CFFEX	多	开	2251.5999...	1	2010-05-0...	B
22	22	IF888	CFFEX	空	平	2269.6	1	2010-05-0...	B
23	23	IF888	CFFEX	多	开	2273.7999...	1	2010-05-0...	B
24	24	IF888	CFFEX	空	平	2259.0	1	2010-05-0...	B
25	25	IF888	CFFEX	空	开	2256.9999...	1	2010-05-0...	B
26	26	IF888	CFFEX	多	平	2208.8	1	2010-05-0...	B
27	27	IF888	CFFEX	多	开	2209.7999...	1	2010-05-0...	B
28	28	IF888	CFFEX	空	平	2194.0	1	2010-05-0...	B
29	29	IF888	CFFEX	空	开	2195.1999...	1	2010-05-0...	B
30	30	IF888	CFFEX	多	平	2099.8	1	2010-05-0...	B
31	31	IF888	CFFEX	多	开	2105.5999...	1	2010-05-0...	B

参数优化



暴力穷举
Brutal-Force

- 充分榨干多核机器性能



遗传算法
Genetic-Algorithm

- 算法降维参数搜索空间



组合回测



策略加密



开发环境

- py文件（可读）
- 方便开发人员修改

生产环境

- pyd文件（加密）
- 保证策略机密安全

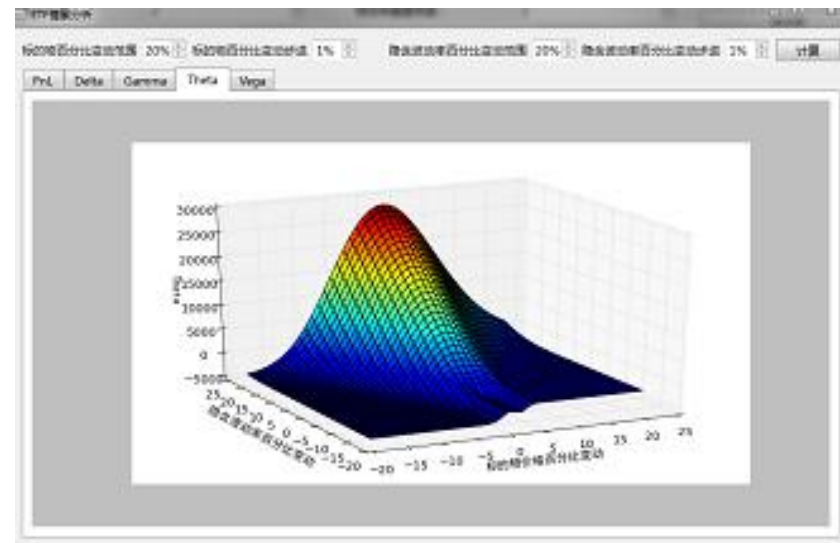
盘后跟踪





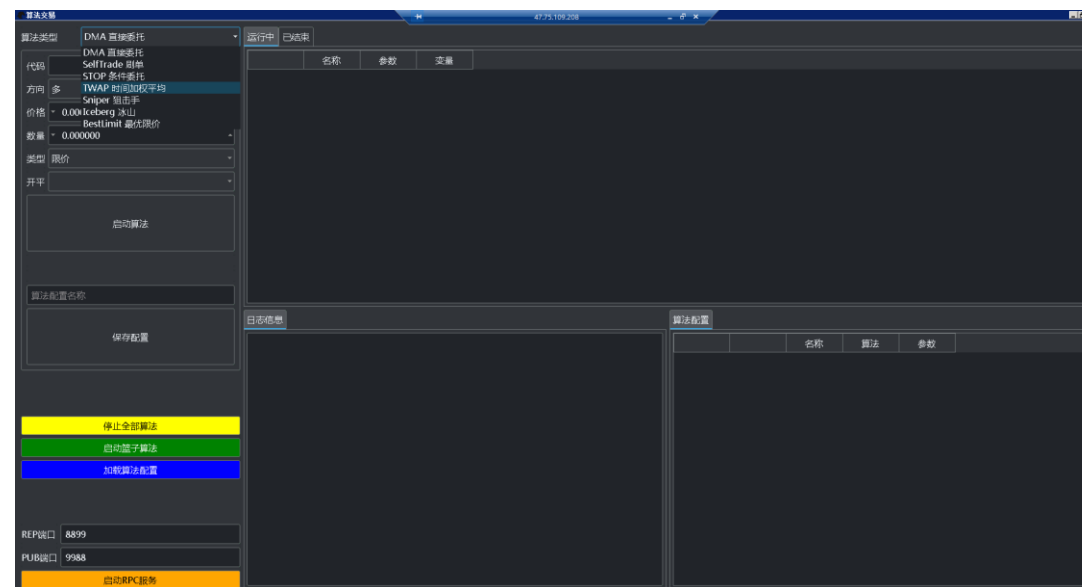
期权策略

- 面向期权做市商业业务开发的高频波动率交易系统
 - 波动率曲面跟踪
 - 希腊值自动对冲
 - 电子眼算法
 - 组合压力测试
- 使用C语言实现期权定价、波动率实时计算等性能延时敏感环节

[illegible]

算法交易

- 提供10种常用算法：
 - TWAP
 - VolumeInLine
 - BestLimit
 - Sniper
 - Iceberg
 -
- 支持通过GUI界面直接管理算法交易，或者通过RPC模式从外部调用（可扩展支持FIX）

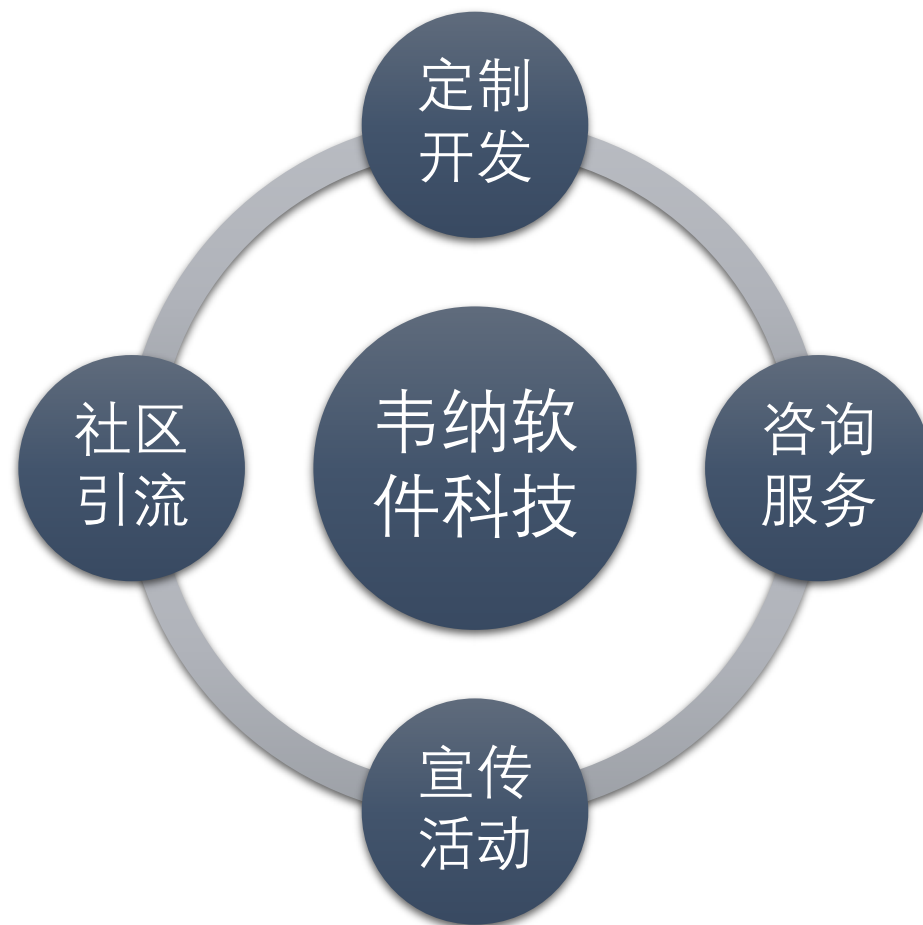


竞品对比



vn.py	优势
文华wh8 (策略交易)	更加灵活自由的策略开发体系，支持Python丰富的机器学习工具
咏春 (期权交易)	支持期权波动率算法交易、自动Delta对冲、合成期货定价等面向专业期权交易者的功能
功夫 (开源平台)	提供诸多开箱即用的量化交易应用模块，更加符合交易员习惯

服务体系



微信公众号

- [vnpy-community](#)

社区论坛

- www.vnpy.com/forum

开源仓库

- www.github.com/vnpy/vnpy