

vn.py策略应用模块

vn.py社区2020年第二次线上活动

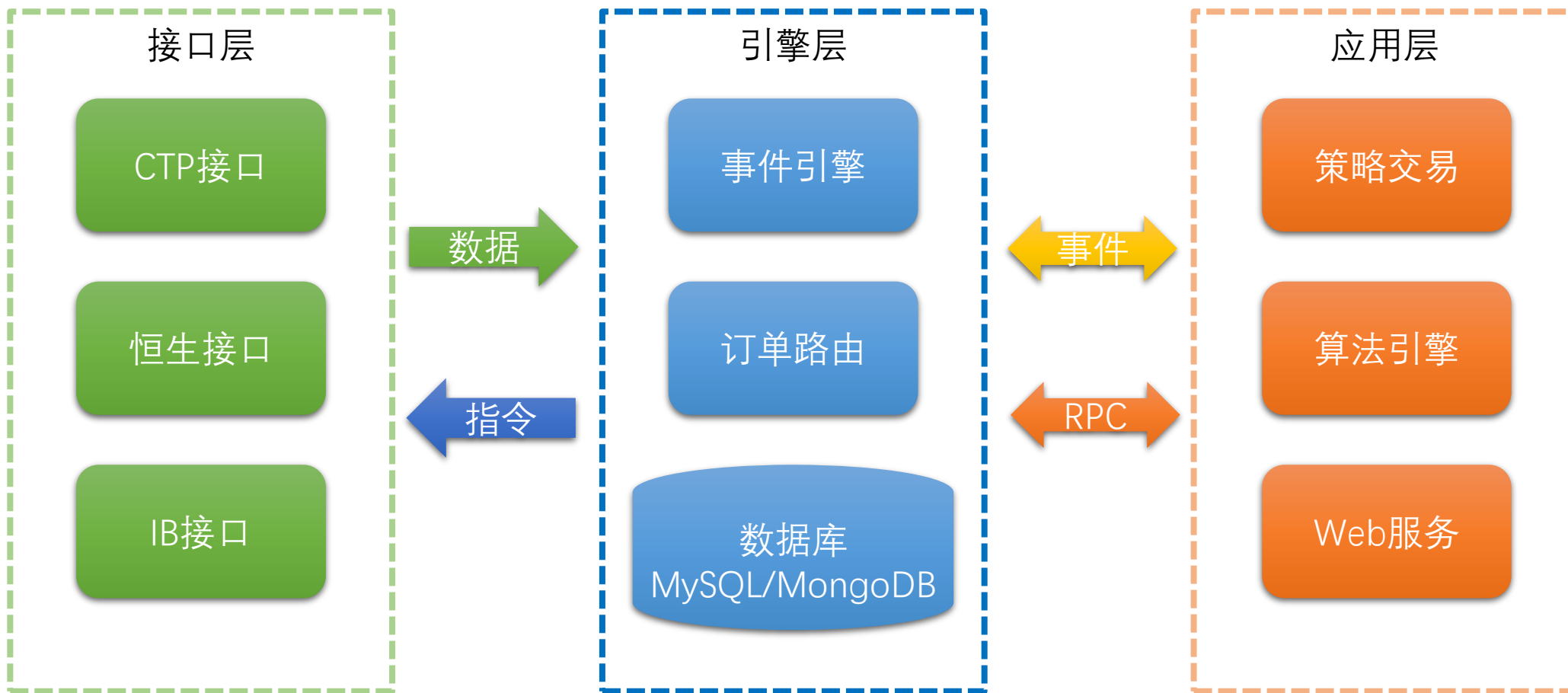
By 陈晓优 2020-3-28

今日分享文件下载



- https://vnpy-weixin.oss-cn-shanghai.aliyuncs.com/workshop/20200328_workshop.zip

三层架构



上层应用模块



cta_strategy



cta_backtester



spread_trading



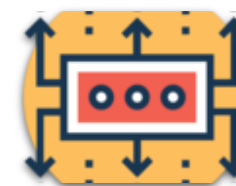
option_master



algo_trading



script_trader



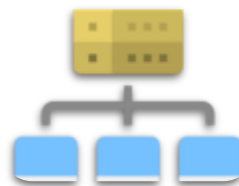
portfolio_strategy



chart_wizard



portfolio_manage
r



rpc_service



data_manger



csv_loader



data_recorder

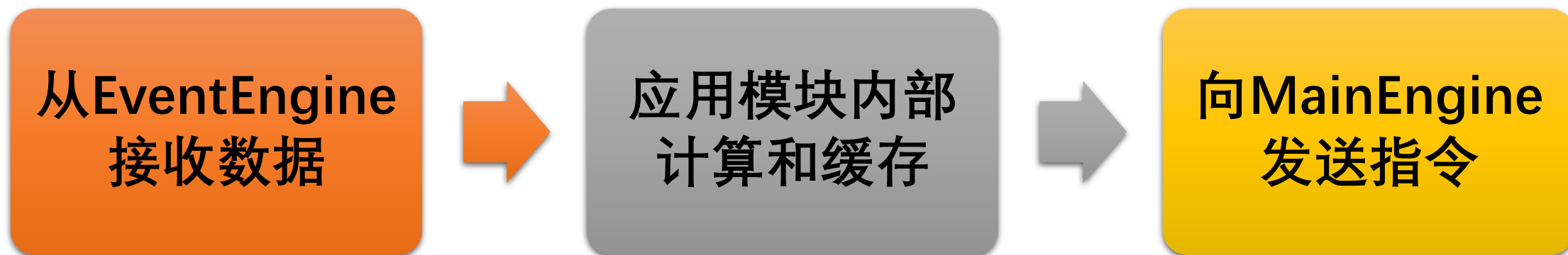


excel_rtd



risk_manager

驱动逻辑



策略 vs 算法

量化策略

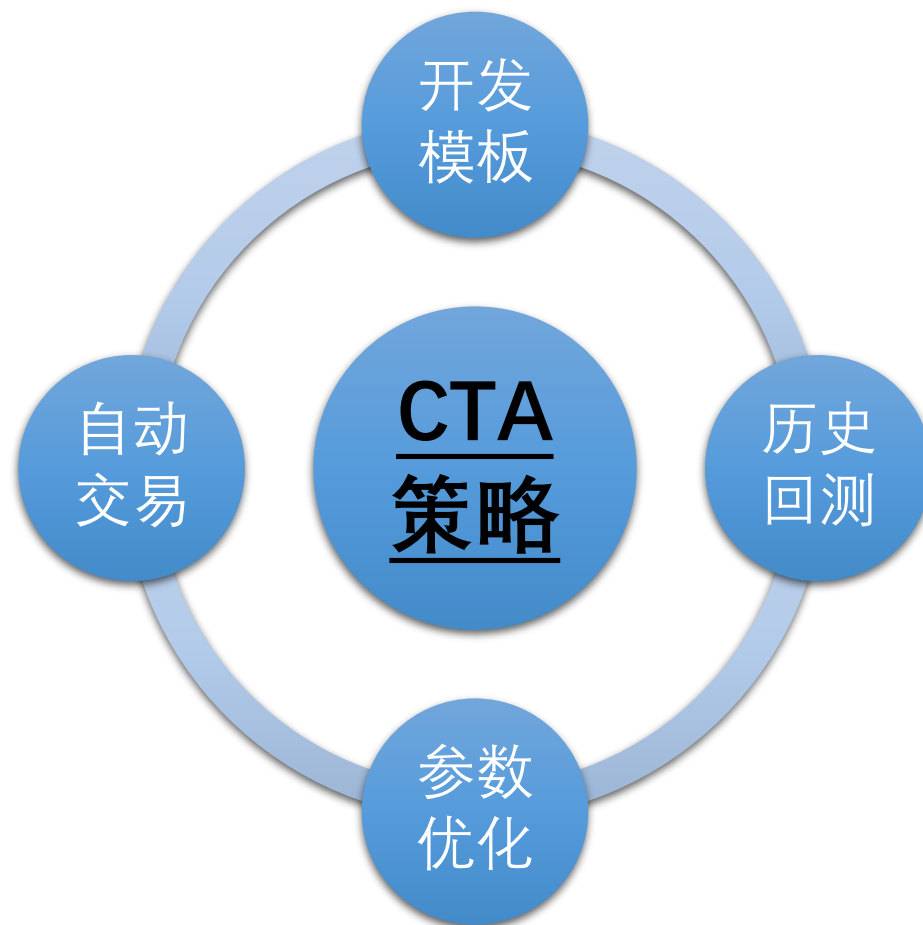
- 基金经理
- 发出买卖指令
- 也可以直接下单



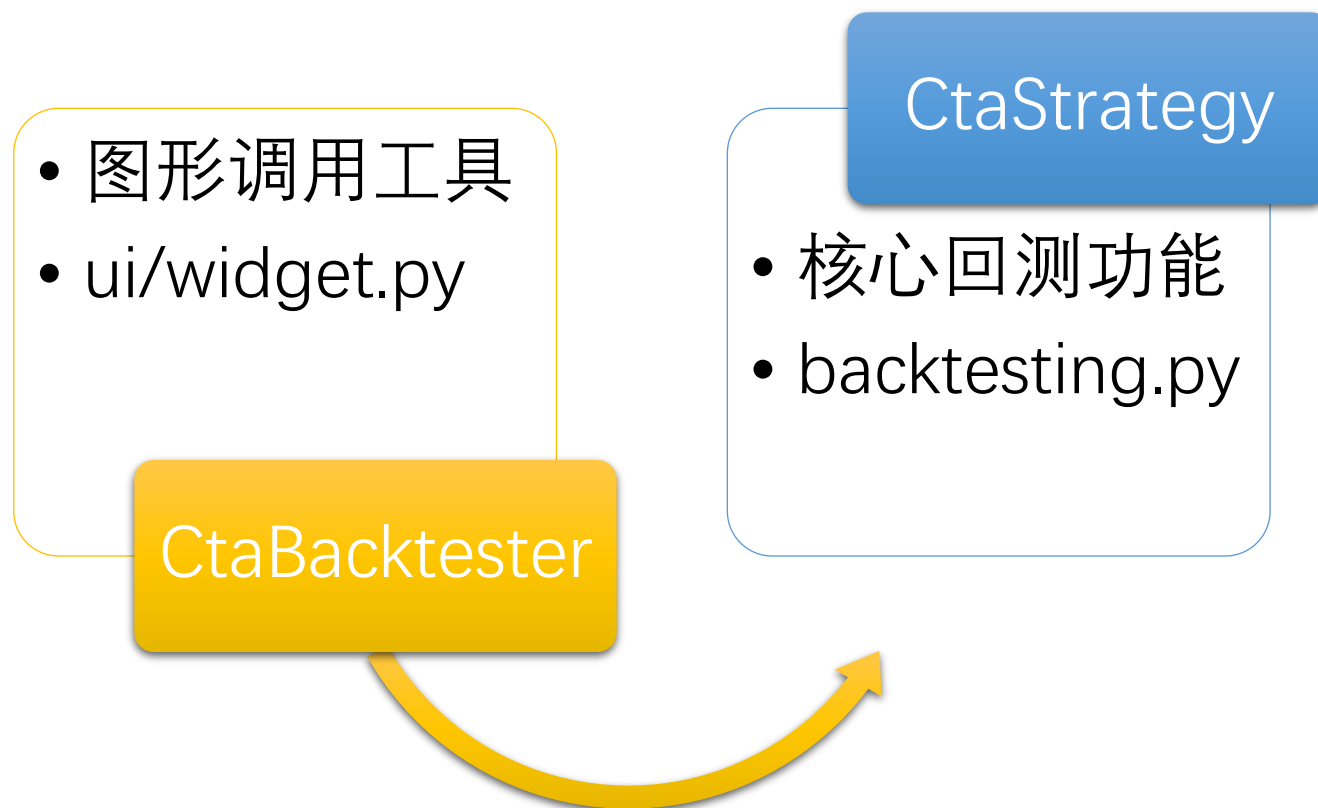
执行算法

- 下单员
- 执行买卖下单
- 反馈执行结果

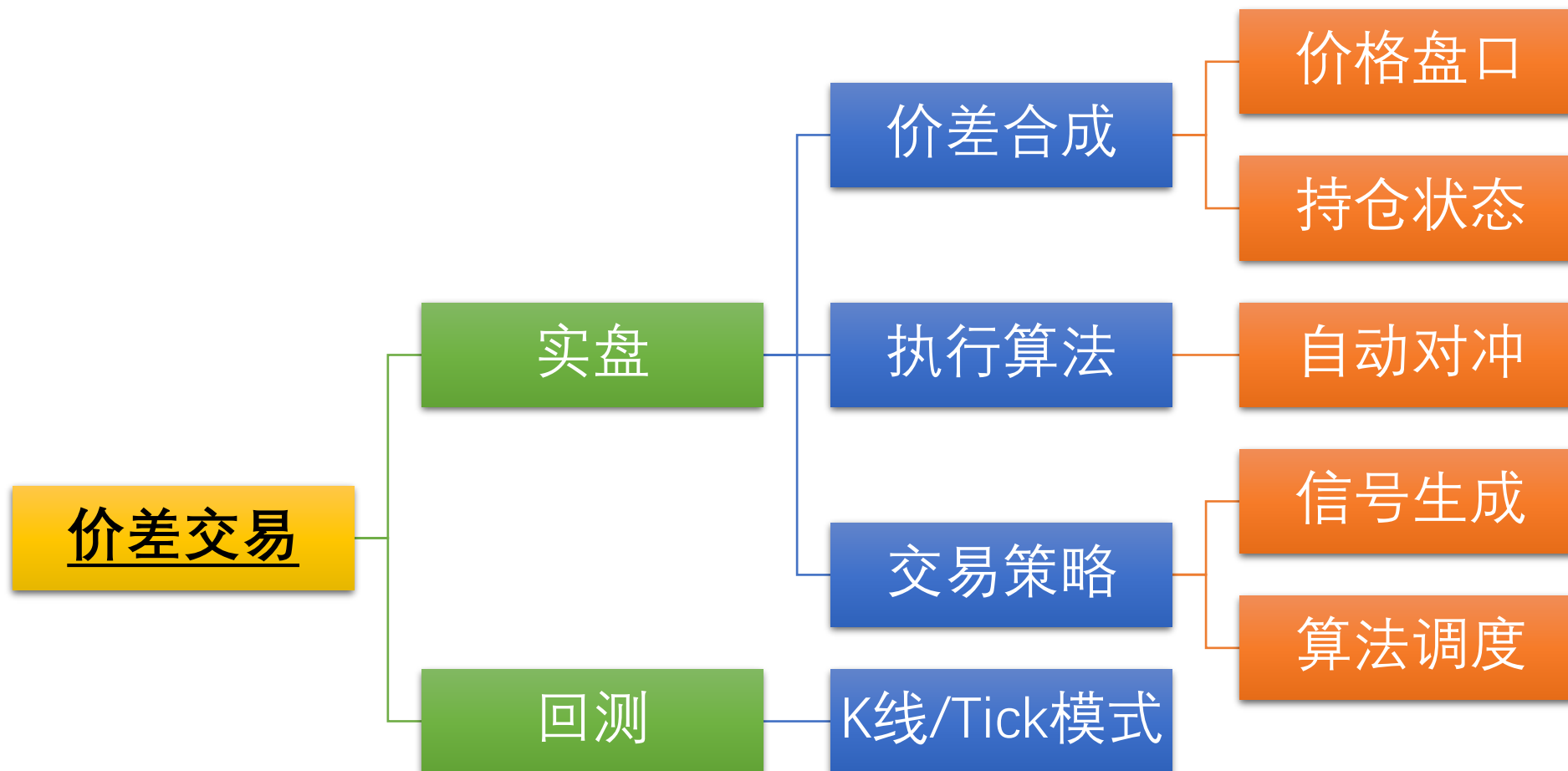
CtaStrategy



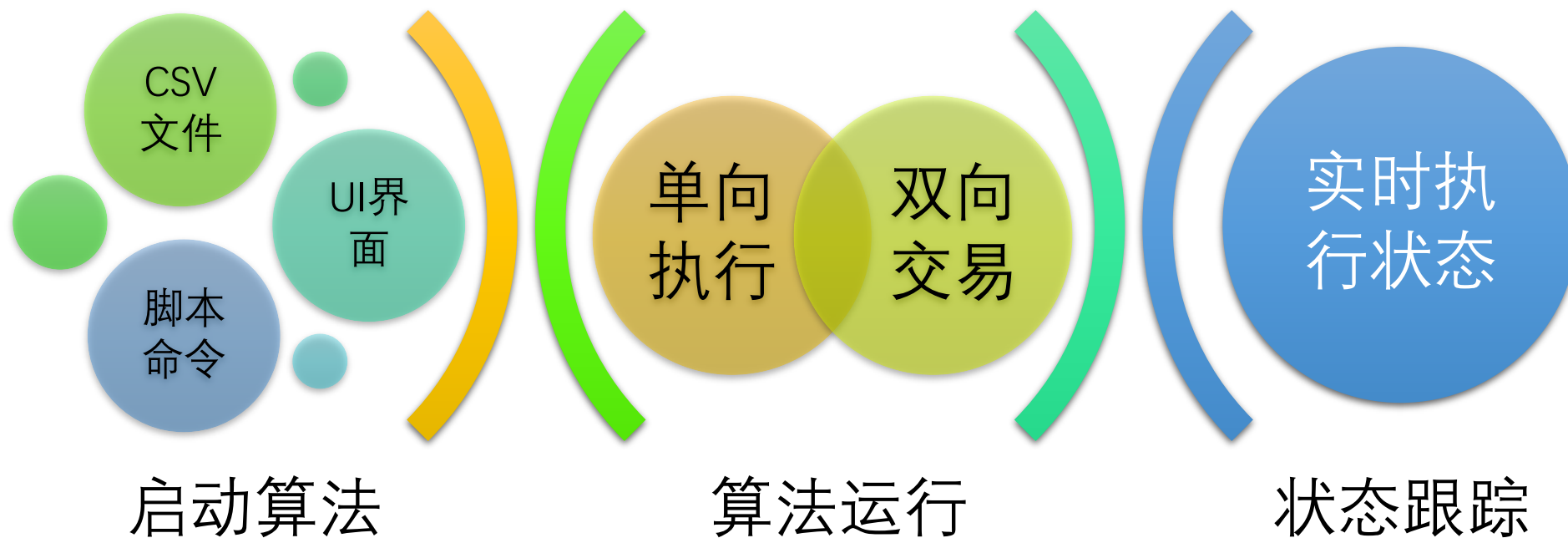
CtaBacktester



SpreadTrading



AlgoTrading



期权波动率交易

市场跟踪

交易执行

风险管理

T型报
价

波动率
曲线

手动下
单

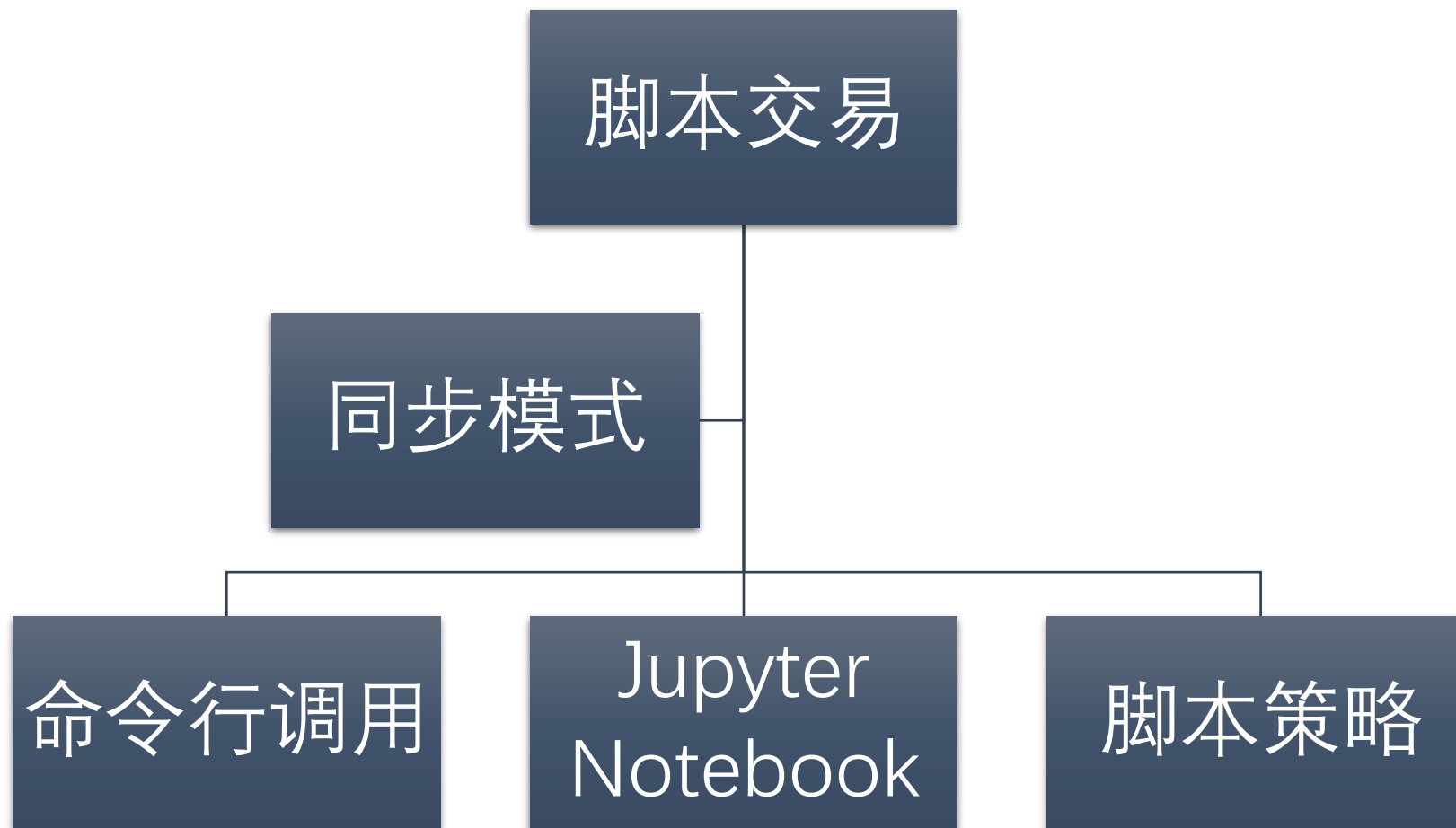
Delta
对冲

电子眼
算法

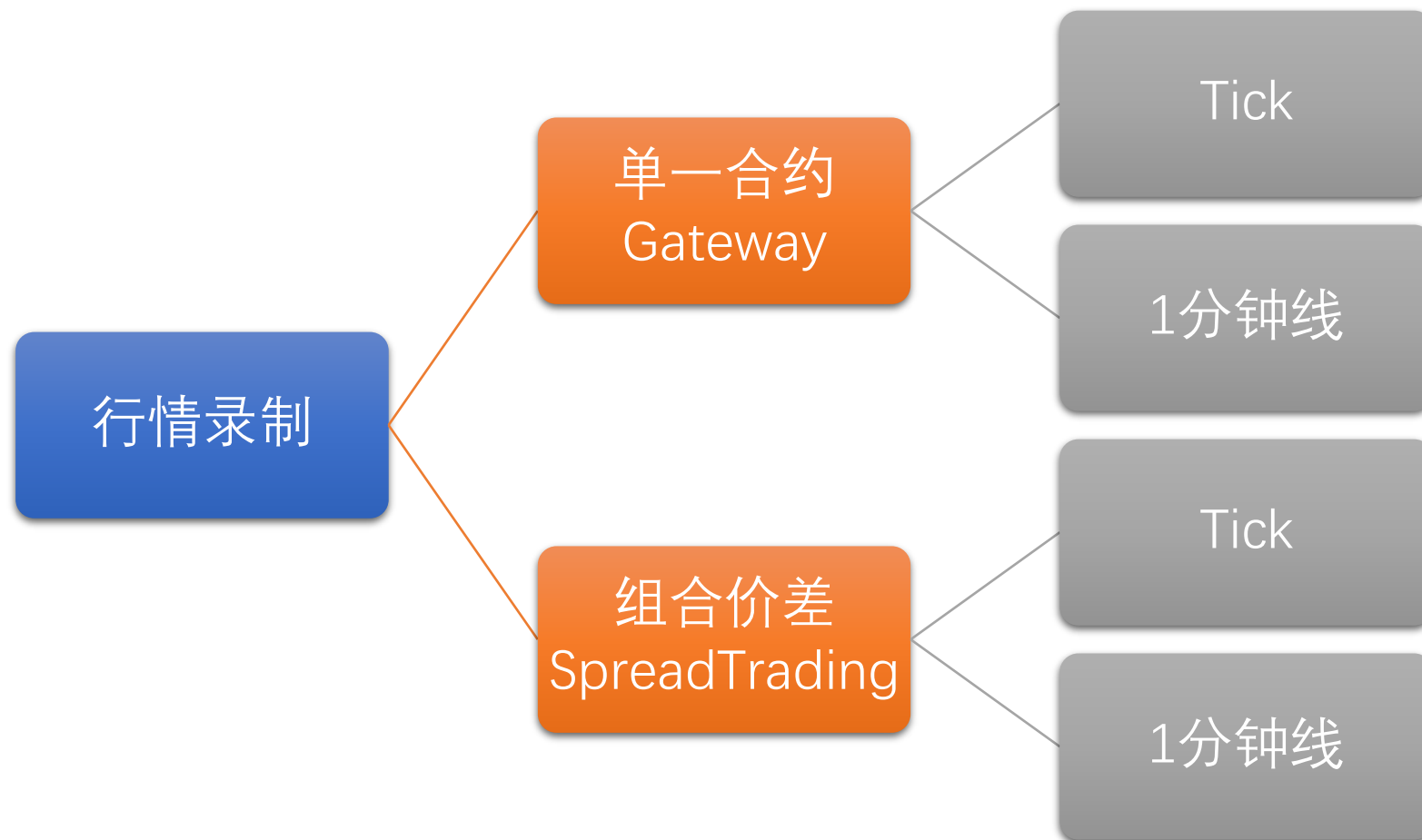
波动率
管理

希腊值
风控

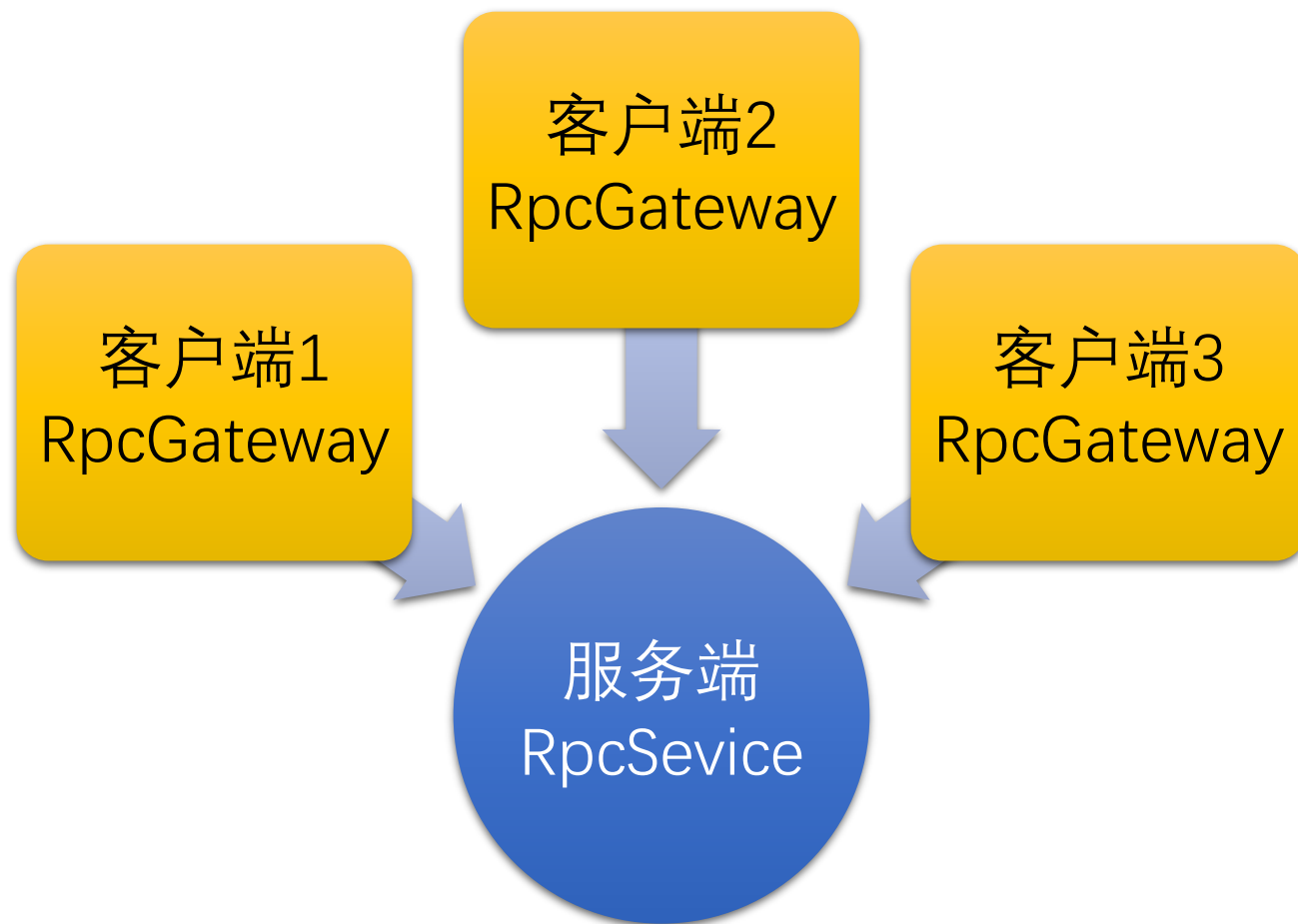
ScriptTrader



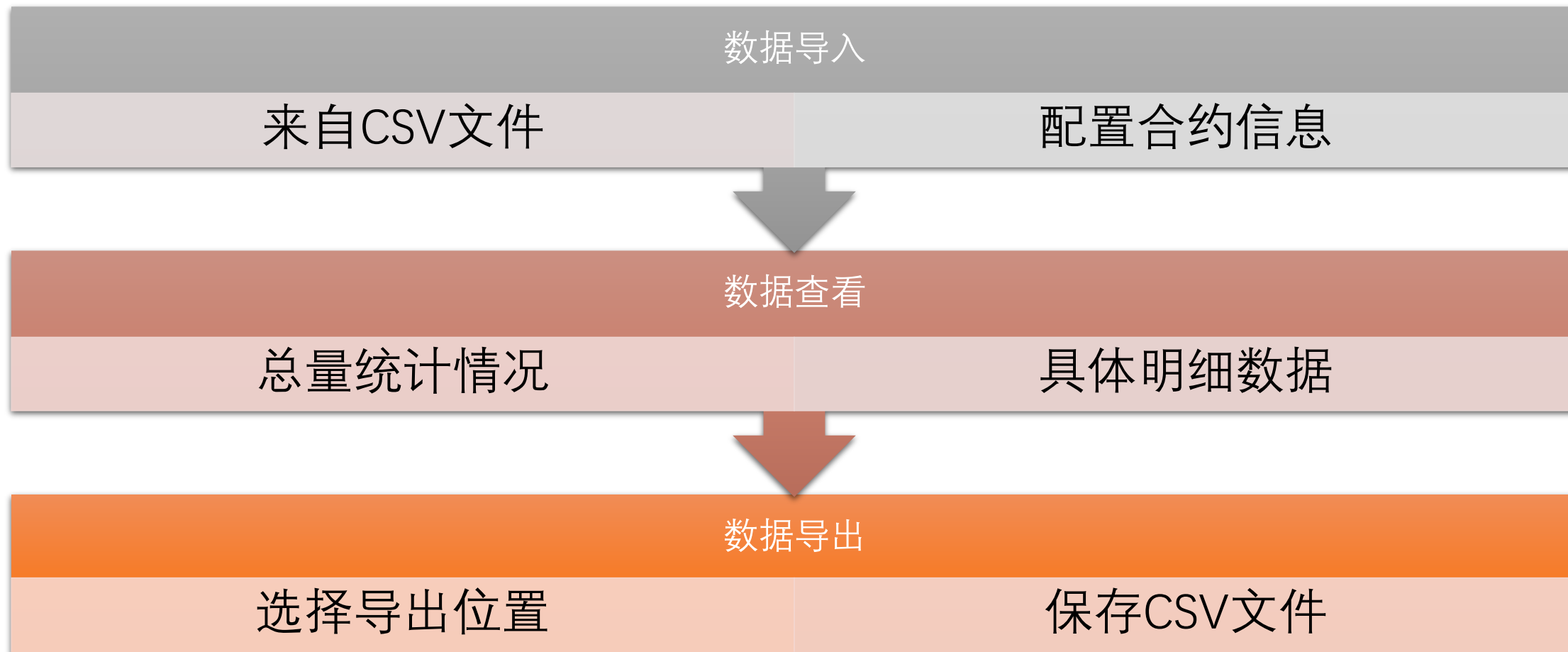
DataRecorder



RpcService



DataManager



CsvLoader

历史遗留

RiskManager

工作原理

- 动态补丁替换，类似gevent

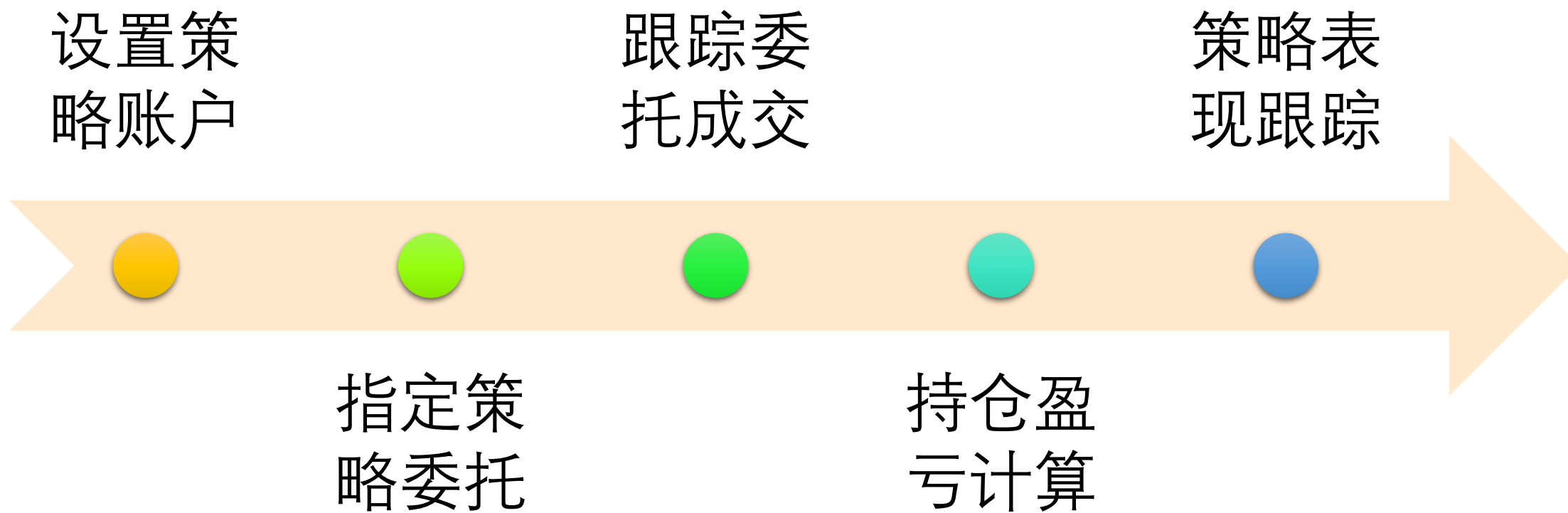
风控逻辑

- 流控，单位时间下单次数
- 每笔委托检查
- 总活动委托控制
- 撤单次数限制

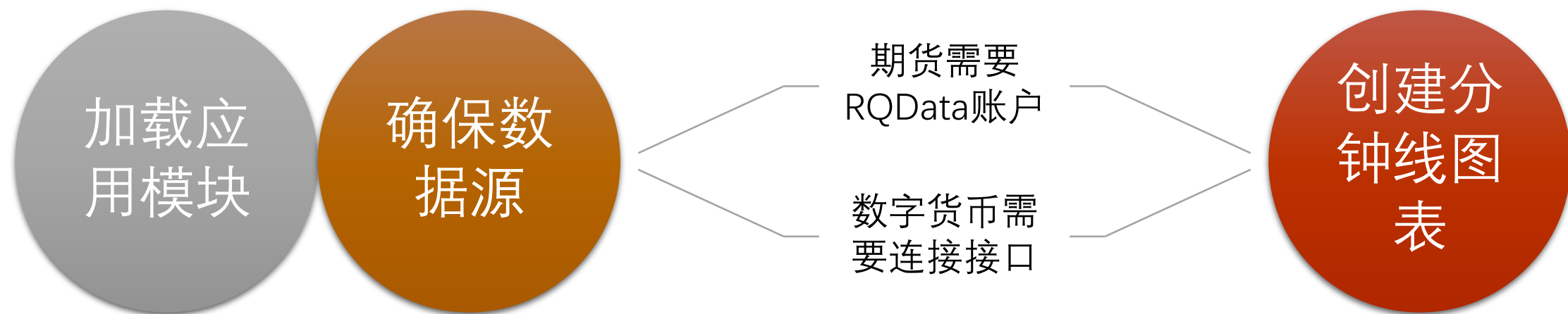
扩展增强

- 订阅事件、数据统计、下单拦截

PortfolioManager



ChartWizard



ExcelRtd



Excel表格



RTD
服务器



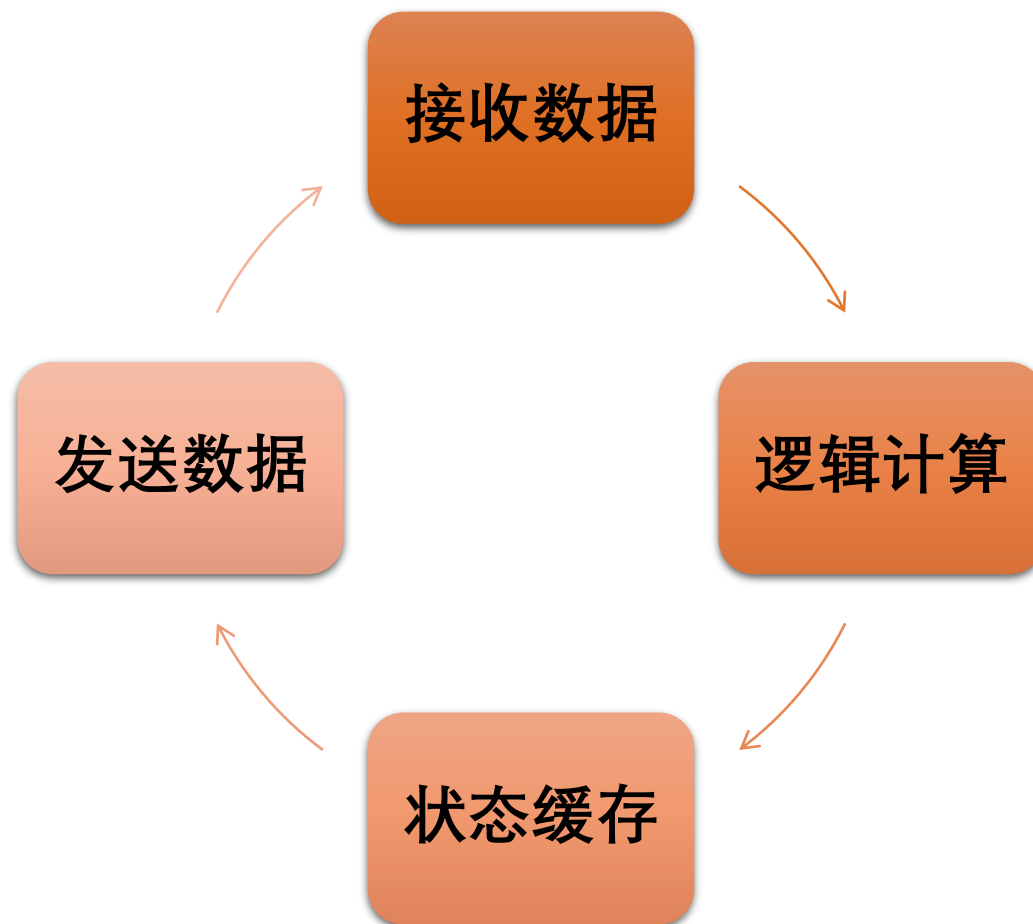
VN
Trader

rtd函数

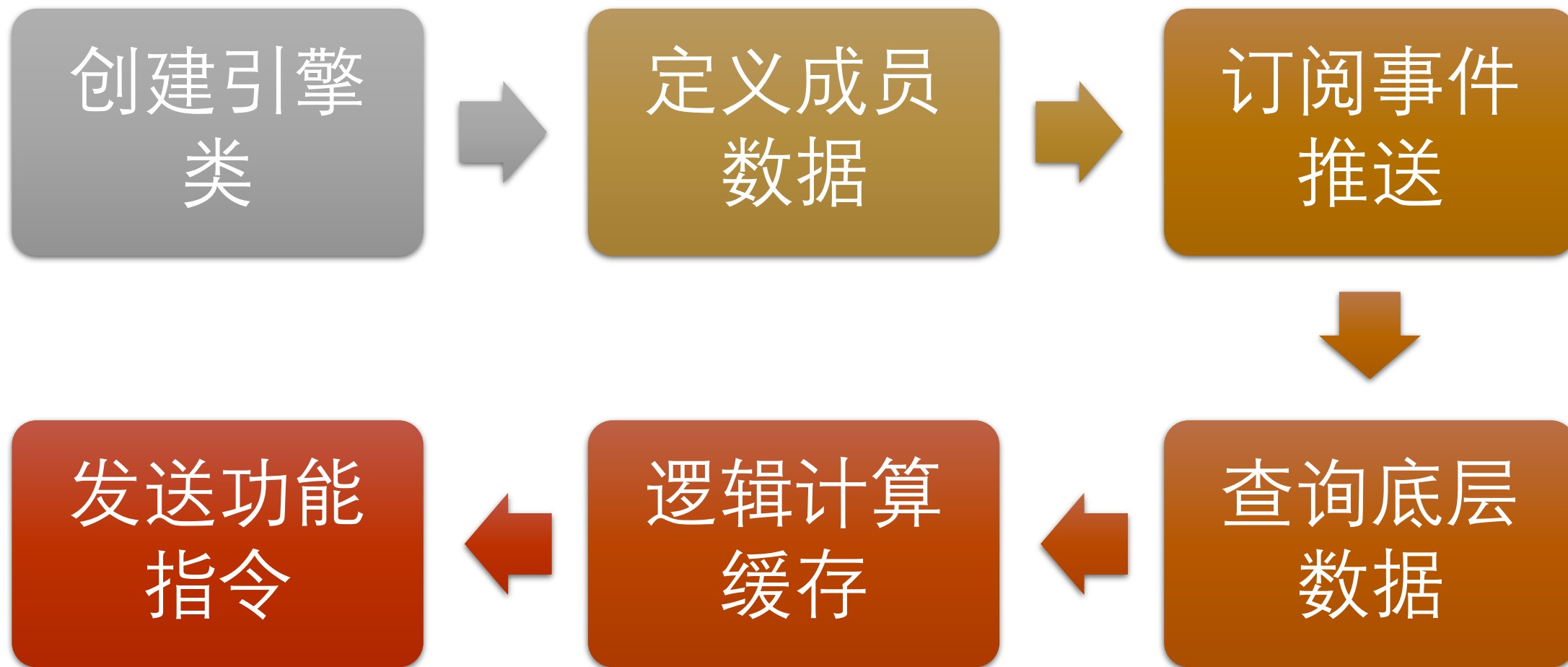
Pyxll模块

RPC服务

工作流程



开发一个应用



图形界面



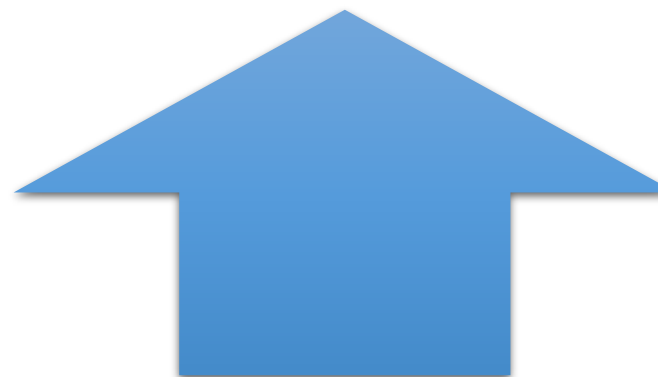
展示数据

- 订阅事件
- 刷新界面



调用功能

- 控制组件
- 绑定函数





vn.py社区公众号: [vnpy-community](#)

各种入门教程、进阶经验、公告发布等等