

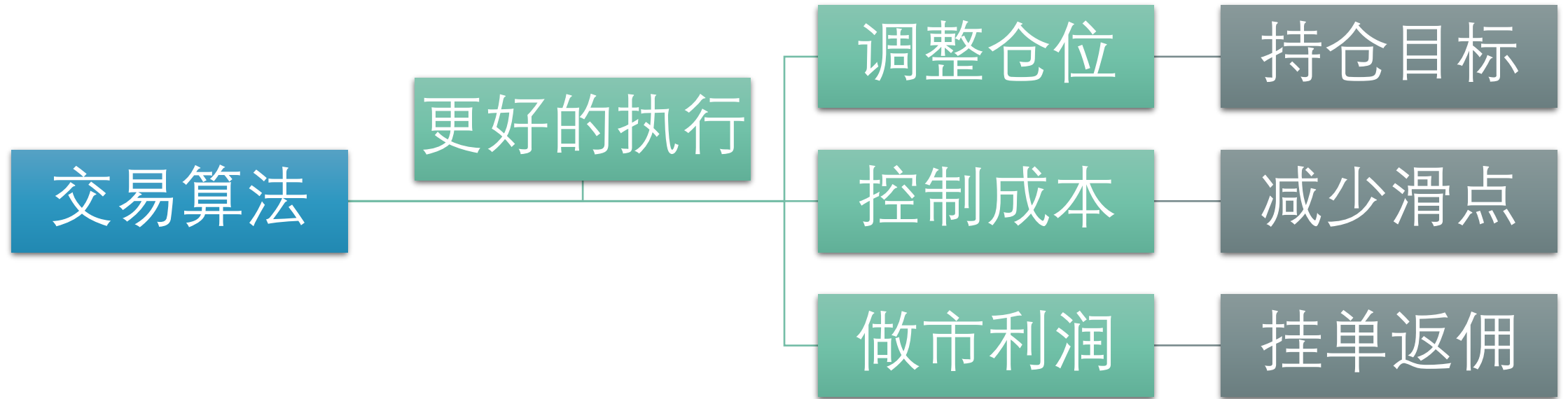
# CTA策略复杂交易算法实现

vn.py社区2020年第3次线下活动

By 陈晓优

2020-9-26

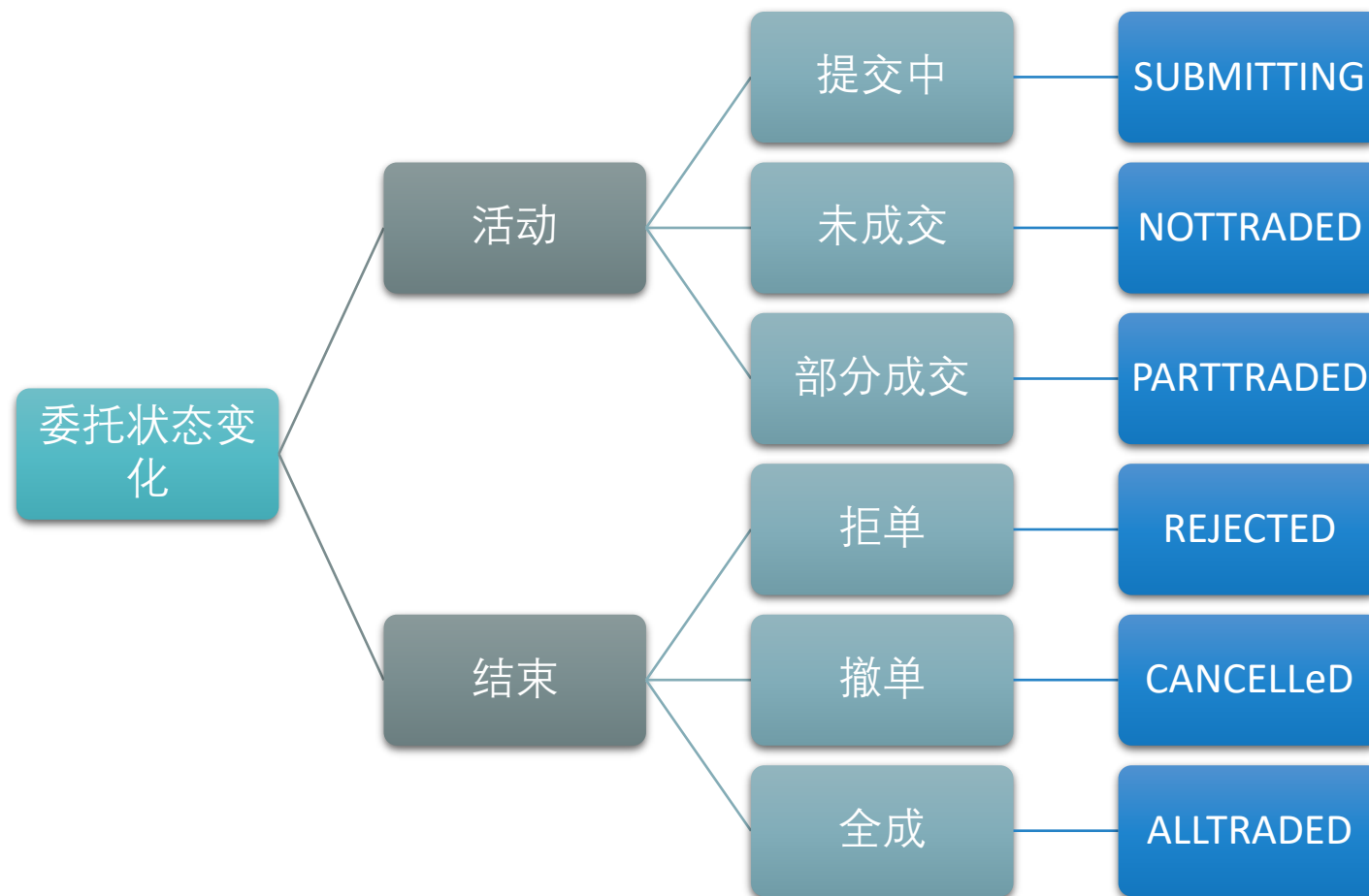
# 交易算法的作用



# on\_tick的K线合成



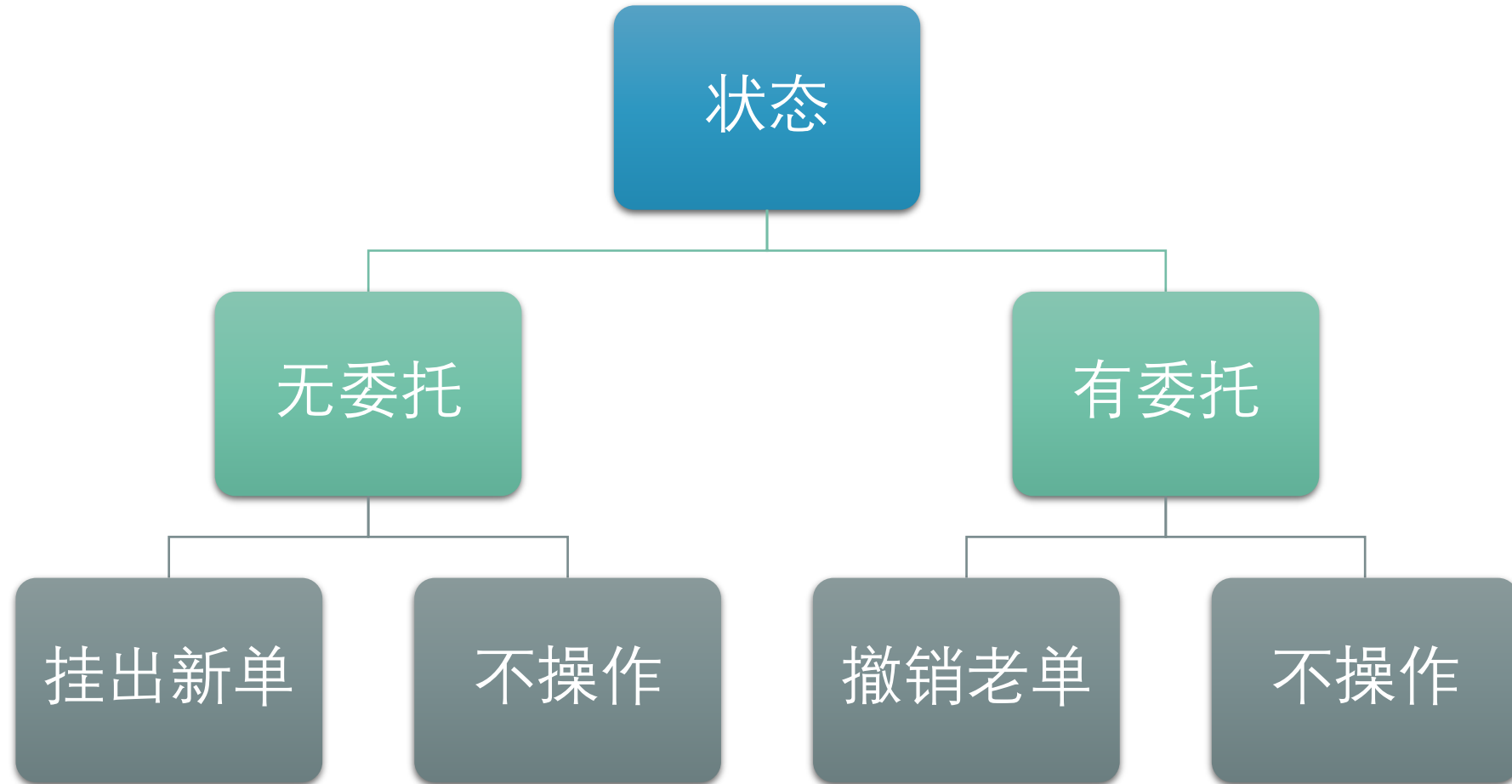
# on\_order的推送时机



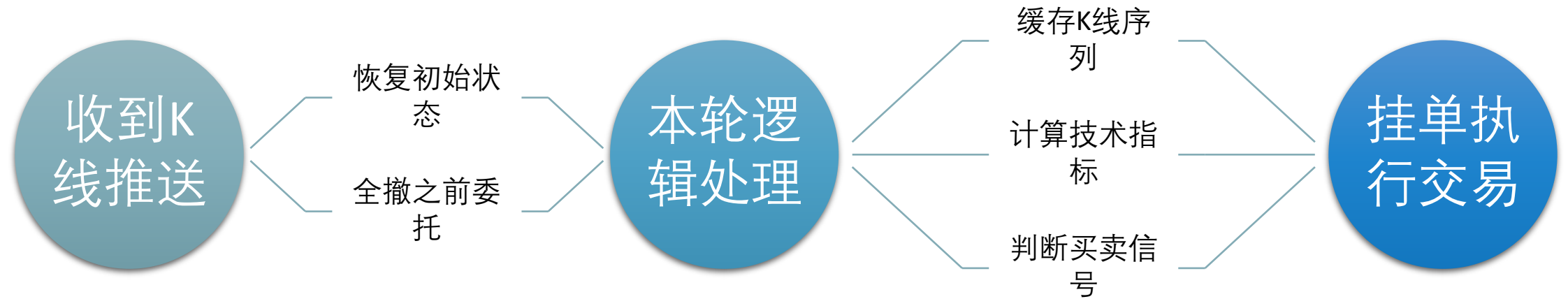
# on\_trade的持仓更新



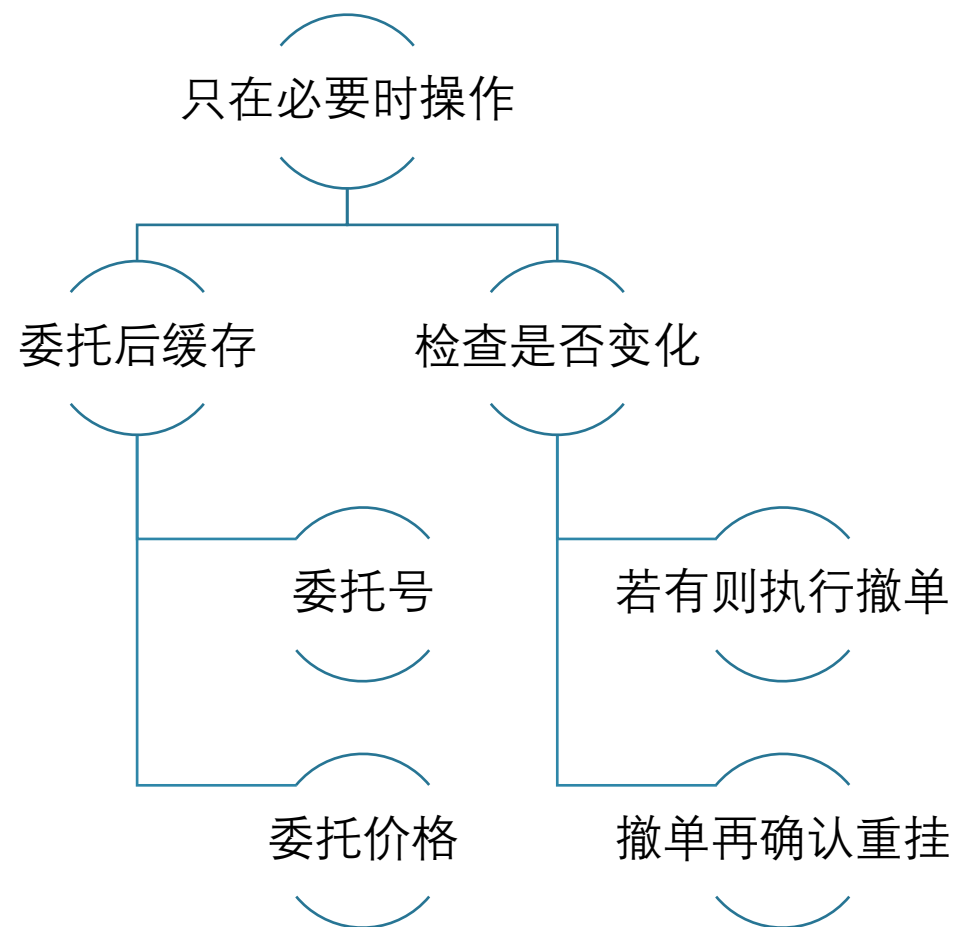
# CTA交易中的算法状态机



# 简单的cancel\_all模式

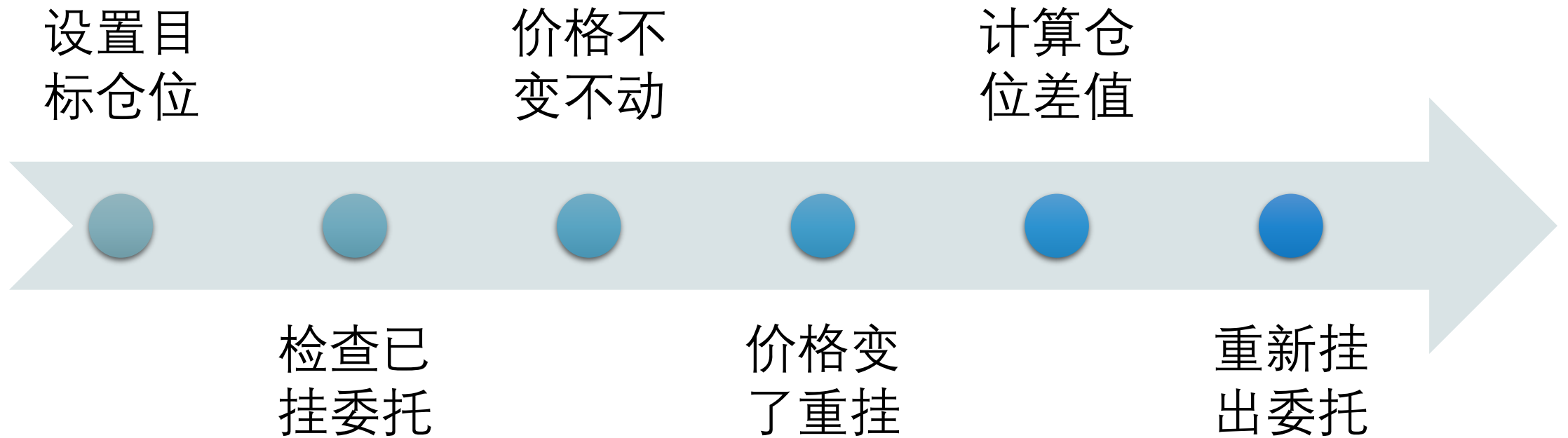


# 更加高效的方案

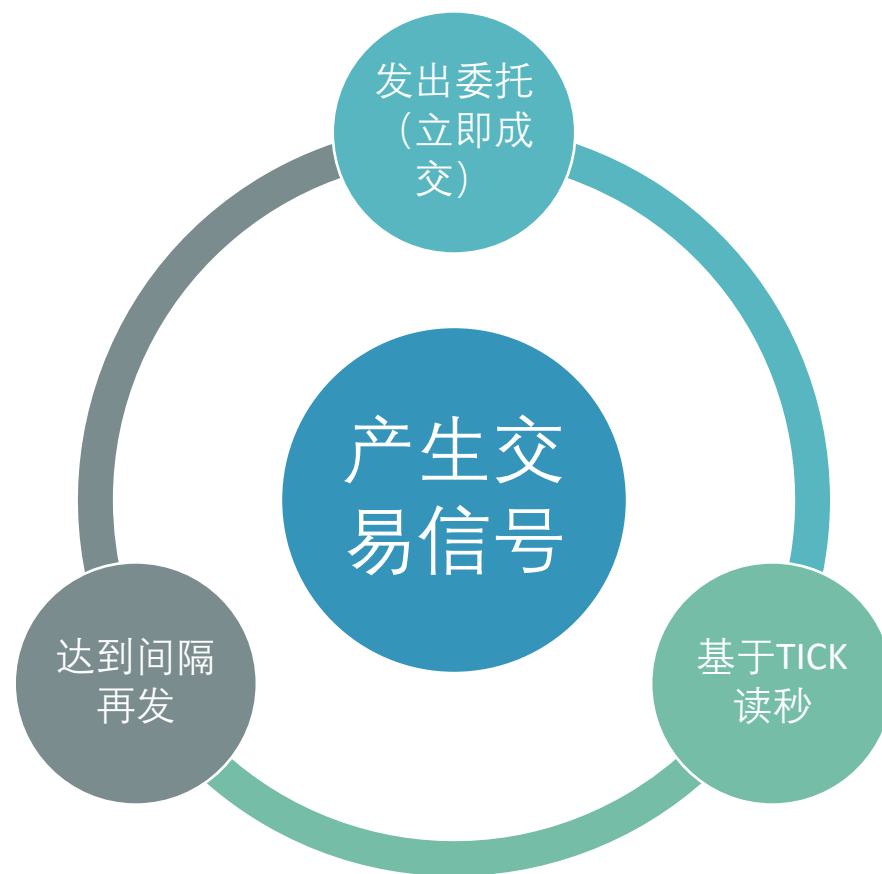




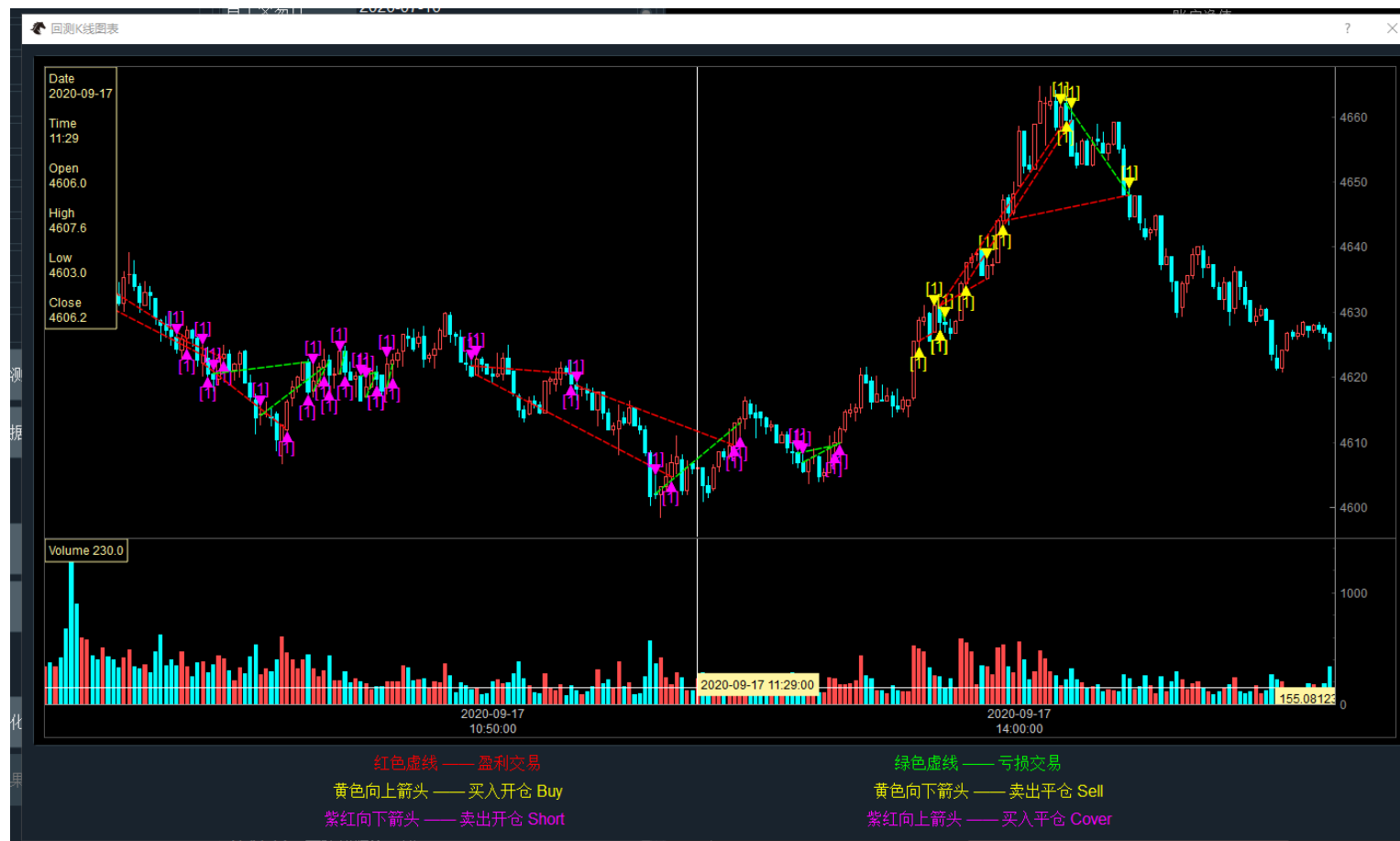
# 盘口连续挂单的交易执行逻辑



# 策略内的TWAP算法



# K线图表绘制买卖记录



# 成交的逐笔对冲统计

两个列表

买入成交

卖出成交

逐笔清算

先进先出

配对记录

交易配对

开平价格

开平时间

# vnpy.chart模块的图层开发

## 图形组件

- GraphicsObject

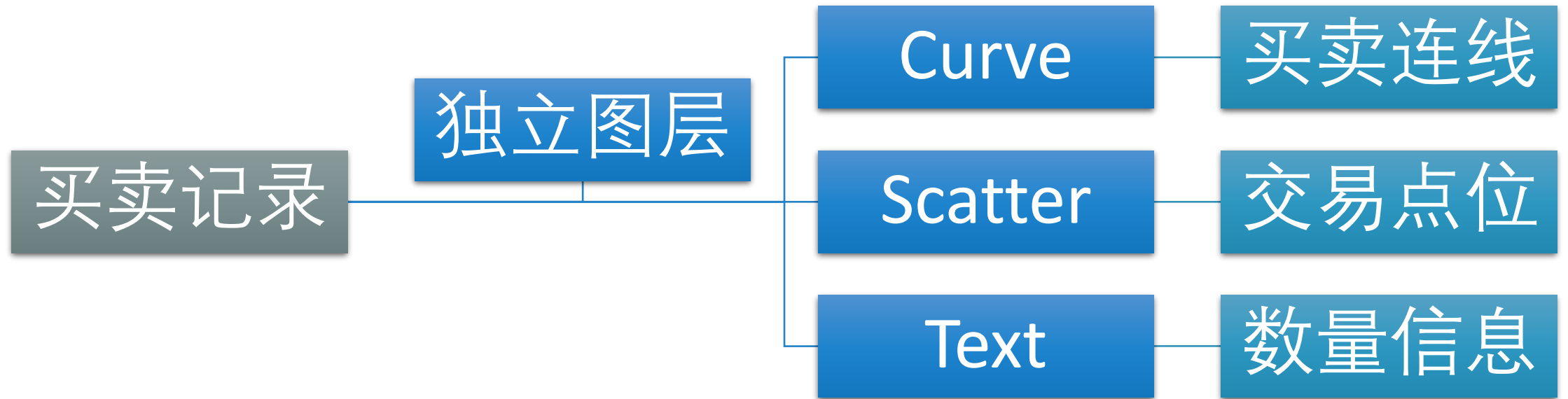
## 绘图区域

- PlotItem

## 绘图窗口

- PlotWidget

# 实现买卖记录连线图层





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