对于交易系统而言，我一般在数据结构中不考虑“用户”  
  
用户的ID最多只是其中一个属性

Strategy --> RM --> OMS --> MA 这是我做的最简单的分层了。贯穿这几层的是 PKE，提供当前的持仓状态信息

Strategy 是你的策略层，只关心策略本身的动作  
RM （RiskManage）是风控层，对策略产生的指令作风控过滤  
OM (OrderManage)是委托管理层，对交易指令的状态进行跟踪  
MA (Market Access)是市场接入层，只关心如何与不同的市场进行通讯

PKE(Position Keeping Engine) 是仓位记录，上面各层都会跟这层通讯，实时查询或更新仓位信息

把可视化的部分完全交给行情软件，其余的留给自动化交易系统

风控层最主要做的，一个是合规上的过滤，另外一个就是对自己风险预算的保障

策略层面的止损放在策略里

只有这样，才不会出现自动动化交易之后，加速了交易的同时，变成了加速亏损

请教一下,止损在哪层操作?

看是哪类止损  
Flying  頓 2018/4/12 8:52:25  
  
策略层面的止损放在策略里  
Flying  頓 2018/4/12 8:52:34  
  
风控层面的放在风控里

止损有两类止损  
Flying  頓 2018/4/12 9:05:31  
  
如果是策略设计上本身的值算，那我建议放在策略上，或者把策略本身再分成两个层  
Flying  頓 2018/4/12 9:06:31  
  
风控做的止损应该是自己整个portfolio的风险预算的止损  
Flying  頓 2018/4/12 9:06:38  
  
这两个是完全不同的概念