风控计算示例

第一步：过滤交易员以及交易股票；

第二步：计算每一笔成交的交易费用；

第三步：创建交易员和股票对应关系的 defaultdict(CurrentResult)

第四步：读取新增加的交易记录(TradeRecord)

对于交易员(tcode, tname)当日某只股票(scode, sname)获取现有的CurrentResult，或者默认的初始化CurrentResult。

读入交易记录(TradeRecord)：(Price, Vol, TradeCost)，Vol为正为买入，为负为卖出。

对于计算的当下，有现价CurrentPrice。

计算结果(CurrentResult):

1 RemainTradeRecordList

2 PairedVol

2 LandProfit

3 TradeCostAmt

4 RemainAmt

5 RemainVol

6 FloatProfit

7 CurrentPrice

8 TotalBuy

9 TotalSell

FunctionDefine Calculate():

Input:

上一条记录的结果(CurrentResult)；

新增的交易记录(TradeRecord)；

当前价格(CurrentPrice)

OutPut:

增加本条记录后的结果(CurrentResult)

1. 计算得到未平仓的交易(**RemainTradeRecordList**) 、毛盈亏(**LandProfit** += 平仓的盈亏)、所有交易手续费 (**TradeCostAmt** += TradeCost)和成功平仓的交易数量(**PairedVol** += 本次平仓的交易数量)
2. 根据更新后的 RemainTradeRecordList 计算得到未平仓的成本金额(**RemainAmt**=重新计算)和未平仓数量(**RemainVol**=重新计算)
3. 结合RemainAmt, RemainVol 和输入的 CurrentPrice ，计算得到浮动盈亏 **FloatProfit** ；
4. 更新 **CurrentPrice**

第五步：计算需要的交易员汇总报表：

fn(tcode, scode) = CurrentResult

TraderSumList = Dict(tcode) = SumResult

风控需要的数据：

交易员总的毛盈亏、交易手续费、净盈亏、浮动盈亏、交易员风控预警线、风控预警标识。

以及总计行内容：毛盈亏、交易手续费、净盈亏、浮动盈亏。

交易员未平仓的股票记录的：

Long/short，交易员信息，股票信息，未平仓数量、浮动盈亏、浮动盈亏占总成本比例

服务端和客户端之间 json 协议定义

TraderInfo:

Tcode

Tname

Tloss

SecurityInfo

Scode

Sname

TraderSum

ProfitLand

Cost

ProfitFloat

TraderDetail