




**SUCCESS IS NOT FINAL,
FAILURE IS NOT FATAL:
IT IS THE COURAGE TO CONTINUE THAT
COUNTS.**

Sir W. S. Churchill



感谢你，以及「们」
汉云的小伙伴们



Talk is cheap.

Show me the code.



Write Bugs, and Fix Code.



Write Code, and Fix Bugs.



Set your status
Give us feedback

William Fang
williamfang

Quant developer.

HiCloud
Xiamen, China
william.lian.fang@gmail.com

Edit

Organizations



Overview | Repositories 76 | Stars 4 | Followers 53 | Following 6

Pinned repositories

Customize your pinned repositories

blog

HTML

williamfang.github.io

HTML

753 contributions in the last year

Contribution settings

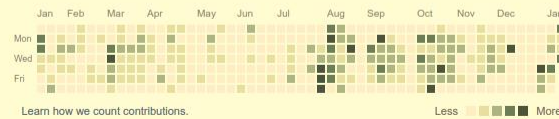
2019



Longest streak
12 days
Oct 15 — Oct 26

Current streak
4 days
Jan 13 — Jan 16

Hide normal chart





我的内心既是欣喜的，又是羞愧的！

咪豆：妈咪，那个每月回来一两天，在咱们家睡个觉又走的“叔叔”到底是谁呀？

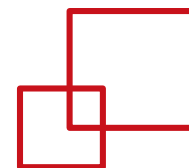
老婆：孩子……那是你爸！

Seize Good And
Chase Better.

2018年度工作汇报

方蓬
2019年1月





目录

CONTENTS



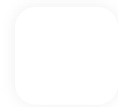
Chap. 01 汉云量化系统



Chap. 02 升级



Chap. 03 星辰与大海



汉云量化系统

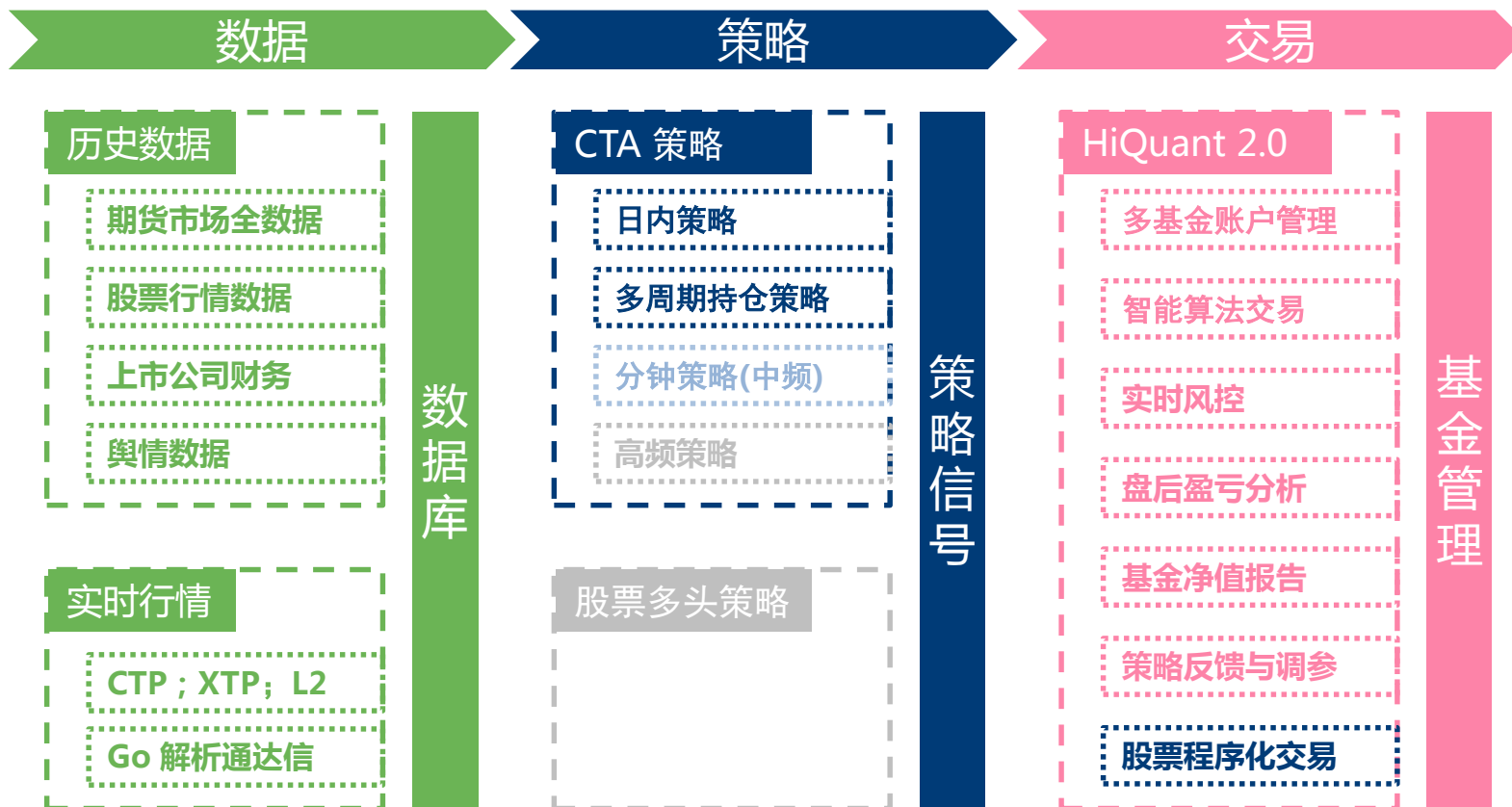
依靠科学算法与大数据资源，运用现代统计方法实现从海量数据中挖掘价值，构建能够带来高收益的CTA/股票多头投资策略，并通过自主研发的智能程序化系统进行投资交易。





「官宣」
HiQuant 2.0

汉云量化投资



CTP

完全程序化运行

自动化、智能化、流程化、标准化
杜绝人工操作失误

中频策略+高频算法

采用智能算法、增加实时盘口判断
极大降低市场冲击，跟踪误差小

追求极致高性能

底层引擎优化、定制操作系统运行环境
单主线程支持 10 亿级别 (X多核运算)

XTP

直接调用券商API

服务器机房托管，领先大部分 PB 通道
便捷的函数调用，扩展自主算法模块

借力先进技术

极速行情推送
深度定制 Level2+ 行情

more...

支持融资融券交易
支持 50ETF

使用 c 重新改写核心交易算法代码，实现性能的显著提升(2~50X)

搭建**可拓展高性能**的研究与交易架构，实现顶层函数与底层引擎分离

汉云投资

系统 功能 帮助

交易

合约代码 000001 时间 10:28:51.0

名称 平安银行 委五 10.28 239100

方向 空 委四 10.27 73400

开平 平仓 委三 10.26 55800

价格 0.000 委二 10.25 129900

成交量 0 委一 10.24 37000

价格类型 限价 最新 10.24 -2.29%

交易所

货币 CNY 委一 10.23 191700

产品类型 期货 委二 10.22 217400

接口 all 委三 10.21 241800

基金 all 委四 10.2 529600

账户 委五 10.19 489100

发单

全撤 全启 全停 全平

接口	基金名称	用户代码	合约代码	名称	方向	总持仓量	昨持仓	冻结量	成本	合约价值	持仓%	平仓盈亏	持仓盈亏	手续费
CTP	贝贝专享	zhonghang	p1905	棕榈油1905	多	11			4,614.2	507,560.0	5.39		-2,220.0	5.2
CTP	贝贝专享	zhonghang	RM905	菜粕5月	空	5	5		2,092.0	104,600.0	1.11		-1,050.0	
CTP	贝贝专享	zhonghang	CF905	棉花5月	多	5			15,049.0	376,225.0	4.00		4,525.0	4.4
CTP	贝贝专享	zhonghang	b1905	豆二1905	空	7	7		2,875.0	201,250.0	2.14		70.0	
CTP	贝贝专享	zhonghang	MA905	甲醇5月	空	4			2,508.0	100,320.0	1.07		-200.0	8.2
CTP	贝贝专享	hongyuan	ZC905	煤5月	空	23			583.4	1,341,799.3	17.21		3,200.0	93.5
CTP	贝贝专享	zhonghang	eg1906	乙二醇1906	空	10	10		5,216.0	521,600.0	5.54		3,700.0	
CTP	贝贝专享	zhonghang	cu1903	cu1903	空	2	2		47,160.0	471,600.0	5.01		-2,000.0	
CTP	贝贝专享	zhonghang	cs1905	玉米淀粉1905	空	14			2,265.8	317,210.0	3.37		-450.0	7.7
CTP	贝贝专享	zhonghang	bu1906	bu1906	多	10	10		2,858.0	287,800.0	3.06		2,000.0	
CTP	贝贝专享	zhonghang	m1905	豆粕1905	多	12	12		2,545.0	305,400.0	3.24		120.0	
CTP	贝贝专享	zhonghang	FG905	玻璃5月	多	20	20		1,316.0	526,400.0	5.59		-2,400.0	
CTP	贝贝专享	zhonghang	a1905	豆一1905	多	12	12		3,356.0	402,720.0	4.28		-120.0	
CTP	贝贝专享	hongyuan	y1905	豆油1905	空	15			5,545.2	831,780.0	10.67		2,580.0	38.5
CTP	贝贝专享	hongyuan	zn1903	zn1903	多	8			20,860.6	834,425.0	10.70		-2,425.0	24.8
CTP	贝贝专享	zhonghang	rb1905	rb1905	多	12	9		3,529.4	423,530.0	4.50		2,950.0	10.8
CTP	贝贝专享	hongyuan	RM905	菜粕5月	空	33			2,099.6	692,879.9	8.89		-4,410.0	50.7

委托 成交 可撤 持仓 基金 日志 错误

合约代码	名称	最新价	昨收盘	成交量	持仓量	开盘价	最高价	最低价	买一价	买一量	卖一价	卖一量	涨停价	跌停价	时间	接口
000001	平安银行	10.24	10.48	40724200		10.54	10.57	10.19	10.23	191700	10.24	37000	11.53	9.43	10:28:51.0	XTP
000002	万科A	25.07	25.42	7845100		25.5	25.5	25.02	25.07	4800	25.09	1700	27.96	22.88	10:28:51.0	XTP
159901	深100ETF	3.457	3.475	12917400		3.477	3.477	3.451	3.457	415000	3.459	100000	3.823	3.128	10:28:51.0	XTP
159930	能源ETF	0.666	0.663	68700		0.665	0.666	0.662	0.663	27000	0.666	5300	0.729	0.597	10:28:51.0	XTP
300001	特锐德	16.74	16.9	1837600		16.85	16.93	16.57	16.74	400	16.75	10800	18.59	15.21	10:28:51.0	XTP
300030	阳普医疗	5.55	5.55	397000		5.57	5.59	5.52	5.55	13700	5.56	5000	6.11	5.0	10:28:51.0	XTP
510010	治理ETF	0.97	0.97	8900		0.97	0.97	0.97	0.969	100	0.977	4700	1.067	0.873	10:02:21.7	XTP
510510	广发500	1.222	1.228	9356000		1.23	1.23	1.22	1.221	984800	1.222	253700	1.351	1.105	10:27:55.6	XTP
600036	招商银行	26.56	26.85	11009387		26.85	26.85	26.43	26.56	32400	26.57	2400	29.54	24.17	10:28:11.4	XTP
bu1906	bu1906	2878.0	2880.0	343192	509922.0	2864.0	2898.0	2856.0	2878.0	518	2880.0	181	3058.0	2656.0	10:15:00.500	CTP

行情 账户

汉云投资-基金运行-状态监控

全部启动 全部停止 全部撤销 全部平仓 全部显示/隐藏 CTA 全部启动/停止 checkcta killcta monitorPos

基金：甜蜜2号:TianMi2

启动 停止 全撤 全平 显示 CTA Trading...

接口	基金代码	基金名称	用户帐号	用户代码	期货公司	入金	出金	资产	可用	合约价值	保证金	杠杆率	手续费	平仓盈亏	持仓盈亏	收益波动(%)	单位净值	运行
CTP	TianMi2	甜蜜2号	902700098	hongyuan	宏源期货			4,494,944.9	3,353,154.7	14,581,342.0	1,140,324.2	1.79	1,502.5		16,260.0	0.18	1.1422	运行

基金：甜蜜3号:TianMi3

启动 停止 全撤 全平 显示 CTA Trading...

接口	基金代码	基金名称	用户帐号	用户代码	期货公司	入金	出金	资产	可用	合约价值	保证金	杠杆率	手续费	平仓盈亏	持仓盈亏	收益波动(%)	单位净值	运行
CTP	TianMi3	甜蜜3号	15100950	nanhua	南华期货			2,088,694.7	1,425,253.2	8,661,599.0	651,458.6	4.15	748.9		11,240.0	0.50	1.1095	运行

基金：甜蜜4号:TianMi4

启动 停止 全撤 全平 显示 CTA Trading...

接口	基金代码	基金名称	用户帐号	用户代码	期货公司	入金	出金	资产	可用	合约价值	保证金	杠杆率	手续费	平仓盈亏	持仓盈亏	收益波动(%)	单位净值	运行
CTP	TianMi4	甜蜜4号	777078	huishang	徽商期货			3,107,869.2	2,206,004.0	7,795,670.0	897,874.0	1.30	689.4		3,310.0	0.04	0.9976	运行

基金：云扬1号:YunYang1

启动 停止 全撤 全平 显示 CTA Trading...

接口	基金代码	基金名称	用户帐号	用户代码	期货公司	入金	出金	资产	可用	合约价值	保证金	杠杆率	手续费	平仓盈亏	持仓盈亏	收益波动(%)	单位净值	运行
CTP	YunYang1	云扬1号	10270391	zhonghang	中航期货			10,381,967.4	9,108,725.1	14,732,789.0	1,271,938.1	1.42	1,321.3		5,325.0	0.04	1.4638	运行

基金：云扬2号:YunYang2

启动 停止 全撤 全平 显示 CTA Trading...

接口	基金代码	基金名称	用户帐号	用户代码	期货公司	入金	出金	资产	可用	合约价值	保证金	杠杆率	手续费	平仓盈亏	持仓盈亏	收益波动(%)	单位净值	运行状态
CTP	YunYang2	云扬2号	10080080	dayue	大越期货			11,733,376.2	9,717,207.4	16,662,877.0	2,009,369.4	1.42	1,169.7		5,625.0	-0.08	1.0409	运行

基金：云扬3号:YunYang3

启动 停止 全撤 全平 显示 CTA Trading...

10:34:55 AM 甜蜜2号:TianMi2 没有 [5日] 策略需要执行
 10:34:56 AM 甜蜜3号:TianMi3 没有 [5日] 策略需要执行
 10:34:56 AM 甜蜜4号:TianMi4 没有 [5日] 策略需要执行
 10:34:56 AM 云扬1号:YunYang1 没有 [5日] 策略需要执行
 10:34:56 AM 云扬2号:YunYang2 没有 [5日] 策略需要执行
 10:34:57 AM 云扬3号:YunYang3 没有 [5日] 策略需要执行
 10:34:57 AM 云集1号:YunJi1 没有 [5日] 策略需要执行
 10:34:57 AM 基金运行-状态监控-引擎启动成功

2019-01-17 10:14:42,048 INFO: MAIN_ENGINE 云集1号:YunJi1 Rscript tradingSignals.R

[1] TRUE

[1] TRUE

2019-01-17 10:14:44,517 INFO: CTP 贝贝专享:BeiBei:[hongyuan@902500688@宏源期货] 行情服务器连接成功

2019-01-17 10:14:44,521 INFO: CTP 贝贝专享:BeiBei:[hongyuan@902500688@宏源期货] 交易服务器连接成功

2019-01-17 10:14:44,540 INFO: CTP 贝贝专享:BeiBei:[hongyuan@902500688@宏源期货] 行情服务器登录完成

2019-01-17 10:14:44,576 INFO: CTP 贝贝专享:BeiBei:[hongyuan@902500688@宏源期货] 交易服务器登录完成

2019-01-17 10:14:44,652 INFO: CTP 贝贝专享:BeiBei:[hongyuan@902500688@宏源期货] 结算信息确认完成

2019-01-17 10:14:44,926 INFO: CTP 贝贝专享:BeiBei:[hongyuan@902500688@宏源期货] 交易合约信息获取完成

2019-01-17 10:14:44,926 INFO: CTP 贝贝专享:BeiBei:[hongyuan@902500688@宏源期货] 账户登录成功

2019-01-17 10:14:49,253 INFO: CTP 贝贝专享:BeiBei:[zhonghang@10270528@中航期货] 行情服务器连接成功

2019-01-17 10:14:49,255 INFO: CTP 贝贝专享:BeiBei:[zhonghang@10270528@中航期货] 交易服务器连接成功

2019-01-17 10:14:49,256 INFO: CTP 贝贝专享:BeiBei:[zhonghang@10270528@中航期货] 行情服务器登录完成

2019-01-17 10:14:49,258 INFO: CTP 贝贝专享:BeiBei:[zhonghang@10270528@中航期货] 交易服务器登录完成

2019-01-17 10:14:49,369 INFO: CTP 贝贝专享:BeiBei:[zhonghang@10270528@中航期货] 结算信息确认完成

2019-01-17 10:14:49,583 INFO: CTP 贝贝专享:BeiBei:[zhonghang@10270528@中航期货] 交易合约信息获取完成

2019-01-17 10:14:49,583 INFO: CTP 贝贝专享:BeiBei:[zhonghang@10270528@中航期货] 账户登录成功

2019-01-17 10:14:52,299 INFO: MAIN_ENGINE 贝贝专享:BeiBei Rscript tradingSignals.R

[1] TRUE

[1] TRUE

2019-01-17 10:14:54,620 INFO: XTP XTP模拟账户1:XTPSimNow1:[fl@15042150@中泰证券] 行情服务器登录成功

2019-01-17 10:14:54,622 INFO: XTP XTP模拟账户1:XTPSimNow1:[fl@15042150@中泰证券] 查询合约信息

2019-01-17 10:14:54,915 INFO: XTP XTP模拟账户1:XTPSimNow1:[fl@15042150@中泰证券] 交易服务器登录成功,会话编号:304087040

2019-01-17 10:14:55,029 INFO: XTP XTP模拟账户1:XTPSimNow1:[fl@15042150@中泰证券] 交易合约信息获取完成

2019-01-17 10:14:55,030 INFO: XTP XTP模拟账户1:XTPSimNow1:[fl@15042150@中泰证券] 账户登录成功

2019-01-17 10:14:55,284 INFO: XTP XTP模拟账户1:XTPSimNow1:[fl@15042150@中泰证券] 交易合约信息获取完成

2019-01-17 10:14:55,286 INFO: XTP XTP模拟账户1:XTPSimNow1:[fl@15042150@中泰证券] 账户登录成功

2019-01-17 10:14:57,953 INFO: MAIN_ENGINE XTP模拟账户1:XTPSimNow1 Rscript tradingSignals.R

[1] TRUE

[1] TRUE

2019-01-17 10:15:04,950 INFO: -----

2019-01-17 10:15:04,950 INFO: 准备启动交易模块

2019-01-17 10:15:04,951 INFO: -----

2019-01-17 10:15:04,951 INFO: 主引擎创建成功

[1] TRUE

[1] TRUE

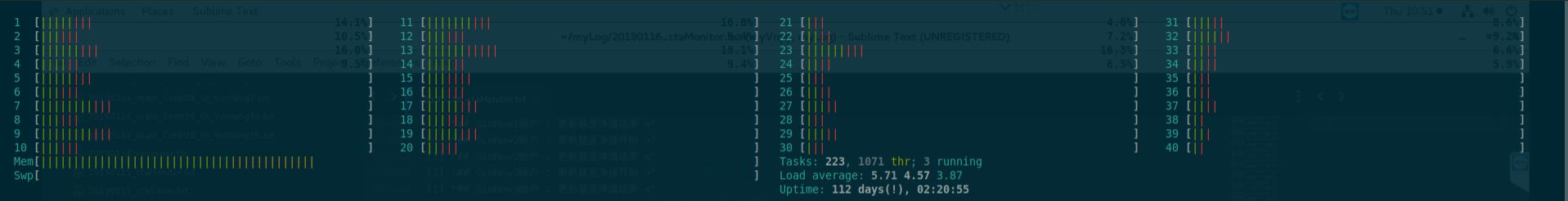
2019-01-17 10:15:07,582 INFO: AShares 账户XTP模拟账户1:XTPSimNow1[@fl@15042150]

策略stg_S_D_5_testing 当日需要执行的开仓订单

```
{u'000001.SZSE-buy': {'TradingDay': datetime.date(2019, 1, 17),
                        'direction': 'long',
                        'last': datetime.datetime(2019, 1, 17, 10, 14, 34, 534857),
                        'orderType': u'buy',
                        'subOrders': {},
                        'totalVolume': 2500
```



zsh:3:sshpass - "workstation" 1#,2#



PID	USER	PRI	NI	VIRT	RES	SHR	S	CPU%	MEM%	TIME+	Command
180726	trader	20	0	22596	2060	1348	S	0.0	0.0	4:16.82	tmux
18675	trader	20	0	167M	2380	1024	S	0.0	0.0	0:00.00	ssh: trader@pts/1
7312	trader	20	0	167M	2368	1016	S	0.0	0.0	0:00.77	ssh: trader@notty
7393	trader	20	0	167M	2488	1116	S	0.0	0.0	0:01.08	ssh: trader@notty
7305	trader	20	0	167M	5656	4304	S	0.0	0.0	0:00.21	ssh: trader [priv]
7353	trader	20	0	167M	5656	4304	S	0.0	0.0	0:00.21	ssh: trader [priv]
18548	trader	20	0	167M	5688	4328	S	0.0	0.0	0:00.23	ssh: trader [priv]
102318	trader	20	0	167M	5732	4376	S	0.0	0.0	0:00.55	ssh: root@pts/0
18088	trader	20	0	105M	348	276	S	0.0	0.0	0:00.00	sleep 60
167950	trader	20	0	870M	31108	17512	S	0.0	0.1	0:00.00	nautilus-desktop --force
167952	trader	20	0	870M	31108	17512	S	0.0	0.1	0:00.02	nautilus-desktop --force
168055	trader	20	0	870M	31108	17512	S	0.0	0.1	0:00.00	nautilus-desktop --force
167916	trader	20	0	870M	31108	17512	S	0.0	0.1	0:17.78	nautilus-desktop --force
167660	trader	20	0	442M	7396	3332	S	0.0	0.0	0:13.05	ibus-daemon --xim --panel disable
167661	trader	20	0	442M	7396	3332	S	0.0	0.0	0:00.02	ibus-daemon --xim --panel disable
167657	trader	20	0	442M	7396	3332	S	0.0	0.0	0:13.13	ibus-daemon --xim --panel disable
18940	trader	20	0	121M	4076	1504	R	2.0	0.0	0:00.79	htop
144342	trader	20	0	121M	3832	1524	S	2.7	0.0	5h51:23	htop
117431	trader	20	0	8532	724	596	S	0.0	0.0	0:00.00	gnome-pty-helper
167189	trader	20	0	388M	5608	4028	S	0.0	0.0	0:00.00	gdm-session-worker [pam/gdm-password]
167190	trader	20	0	388M	5608	4028	S	0.0	0.0	0:00.01	gdm-session-worker [pam/gdm-password]
167188	trader	20	0	388M	5608	4028	S	0.0	0.0	0:00.24	gdm-session-worker [pam/gdm-password]
167221	trader	20	0	58860	968	468	S	0.0	0.0	0:00.00	dbus-launch --sh-syntax --exit-with-session
24986	trader	20	0	110M	1556	1344	S	0.0	0.0	0:00.01	bash /home/trader/myVnpy/vnpy-1.8.2/trading/run_recorder.sh
9708	trader	20	0	110M	1556	1344	S	0.0	0.0	0:00.00	bash /home/trader/myVnpy/vnpy-1.8.2/trading/run_ctaMonitor.sh
183690	trader	20	0	110M	1384	1204	S	0.0	0.0	0:00.00	bash /home/trader/myVnpy/vnpy-1.7.2/trading/run_main_CentOS_UI_YunYang3b.sh
183691	trader	20	0	110M	1388	1208	S	0.0	0.0	0:00.00	bash /home/trader/myVnpy/vnpy-1.7.2/trading/run_main_CentOS_UI_YunYang3a.sh
180852	trader	20	0	110M	1392	1208	S	0.0	0.0	0:00.00	bash /home/trader/myVnpy/vnpy-1.7.2/trading/run_main_CentOS_UI_YunYang2.sh
180851	trader	20	0	110M	1388	1208	S	0.0	0.0	0:00.00	bash /home/trader/myVnpy/vnpy-1.7.2/trading/run_main_CentOS_UI_YunYang1.sh
186588	trader	20	0	110M	1392	1208	S	0.0	0.0	0:00.00	bash /home/trader/myVnpy/vnpy-1.7.2/trading/run_main_CentOS_UI_YunJi1.sh
178093	trader	20	0	110M	1392	1208	S	0.0	0.0	0:00.00	bash /home/trader/myVnpy/vnpy-1.7.2/trading/run_main_CentOS_UI_TianMi4.sh
175305	trader	20	0	110M	1392	1208	S	0.0	0.0	0:00.00	bash /home/trader/myVnpy/vnpy-1.7.2/trading/run_main_CentOS_UI_TianMi3.sh
172638	trader	20	0	110M	1388	1208	S	0.0	0.0	0:00.01	bash /home/trader/myVnpy/vnpy-1.7.2/trading/run_main_CentOS_UI_TianMi2.sh
192088	trader	20	0	110M	1388	1208	S	0.0	0.0	0:00.00	bash /home/trader/myVnpy/vnpy-1.7.2/trading/run_main_CentOS_UI_BeiBeiB.sh
192086	trader	20	0	110M	1388	1208	S	0.0	0.0	0:00.00	bash /home/trader/myVnpy/vnpy-1.7.2/trading/run_main_CentOS_UI_BeiBeiA.sh
1274	trader	20	0	72276	396	0	S	0.0	0.0	0:00.00	avahi-daemon: chroot helper
168005	trader	20	0	532M	16060	10460	S	0.0	0.0	0:00.00	abrt-applet
168013	trader	20	0	532M	16060	10460	S	0.0	0.0	0:00.00	abrt-applet
167984	trader	20	0	532M	16060	10460	S	0.0	0.0	0:00.23	abrt-applet
3402	trader	20	0	78616	3456	2668	S	0.0	0.0	0:28.23	/usr/sbin/wpa_supplicant -u -f /var/log/wpa_supplicant.log -c /etc/wpa_supplicant/wpa_supplicant.conf -P /var/run/wpa_supplicant.pid
1754	trader	20	0	110M	4328	3304	S	0.0	0.0	0:00.59	/usr/sbin/ssh -D



Technical Debt.

技术债

技术开发

HiQuant 2.0+

- 实现 XTP 实盘运行
- 对接其他券商交易通道
- Python2 -> Python3 技术迁移
- c/c++ 高频交易支持
- 汉云多功能量化回测系统

研究与支持

R&D

- 技术积累与传递
- 编写汉云技术手册
- 汇总通用软件包
 - package • module • .so
- 一个被技术耽误的研究员

扫描二维码关注微信公众号



漢雲投資

HI-CLOUD INVESTMENT

—— 河汉无极 云程万里 ——

厦门市思明区鹭江道100号财富中心3009

400-6380-850

福州市鼓楼区光荣路332号西湖别墅3座

0591-83635767

上海市浦东新区陆家嘴东路161号招商局大厦1203室

021-5031 0366

深圳市福田区深南路4009号华融大厦2208

0755-23944613

官网 www.hicloud-investment.com

扫描二维码关注微信公众号

