

期权零基础入门

【vn.py全实战进阶系列】

课时19 – 在Excel中获取实时行情

主讲人：陈晚忧
www.vnpy.com

00:29 / 17:08

行情

5 0

倍速设置 1X

2020-03-06 14:11:53

本集要点

- 期权可以获取的数据字段
- 实操：10分钟做出一份实时数据表
- 初探：利用数据表做分析
- 本课Excel下载请至课程qq群

交流方式

- 课程交流QQ群：1058805375（备注 购买课程所用微信号或微信昵称）
- 除QQ群外，本课程提问也可至vn.py论坛，提问！<<点击

完整文字版

欢迎来到vn.py全实战进阶系列——期权零基础入门课程。那么在上一集里面我们初步认识了Excel RTD这个模块，知道怎么安装、怎么用。

在这一集里面主要在Excel里面获取一个完整的期权链的实时行情。有了实时的数据之后，就可以为后续做一些套利机会的分析、期权平价等等做好了一个基本的数据上的准备。

可以获取哪些字段？

在上一节课里面，我们通过rtd_tick_data函数获取到了期权合约的last price最新价的字段。但除此以外，其实可以获取的字段还很多：

可访问的行情字段

分类	字段	描述
合约信息	symbol	代码
	exchange	交易所
	name	中文名
	limit_up/limit_down	涨停价/跌停价
成交信息	last_price	最新价
	volume/open_interest	成交量/持仓量
	open_price/high_price/low_price	开盘价/最高价/最低价
	bid_price_1~5	买1~5价
盘口信息	bid_volume_1~5	买1~5量
	ask_price_1~5	卖1~5价
	ask_volume_1~5	卖1~5量

其中包括：

- 比如说合约信息类的：symbol 合约代码、exchange就是交易所、name是中文名称，limit_up和limit_down分别对应当天的涨跌停价；然后last_price我们上节课用的，就是最新的价格。
- volume和open_interests是成交量和持仓量这两个概念；open_price、high_price和low_price是开盘价、最高和最低价格；
- 然后最后的bid_price_1~5、bid_volume_1~5、ask_price_1~5、ask_volume_1~5，这个是我们盘口，包括买卖1到买卖5的价格，买卖1到买卖5的量等等。

所有的这些字段，都可以在Excel里面访问到，可以用到这些信息去构建我们后面所有的分析。

实操：在Excel做出一份实时行情界面

这节课主要内容就是带着大家来做出一个Excel里面的界面，那么我们会要用到一些Excel操作上的知识点：

Excel表操作技巧



整体上主要的知识点就是以上三个：

- 锁定单元格
- 字符串拼接
- 批量自动填充

大家看我操作的时候，稍微留心一些。

第一步还是跟上节课一样，启动VNTrader>> 链接CPT接口，然后另外打开Excel。

首先可以在VNTrader先查询一下合约，还是以3月份的为例，看3月份的看涨：IO2003-C-。看一下行权价范围从多少到多少：大概最低的行权价在3300的位置，最高的行权价在4650的位置，每个之间间隔是50块钱。

1. 那在Excel里，先把行权价一列准备好：就是3300到4650，先把我们IO2003上所有的价格都给准备好（自动填充操作见视频04：10）。
2. 生成合约代码，合约代码生成要运用到字符串拼接和锁定单元格（操作见视频05：10）。另外注意：VT symbol一定要带交易所的后缀。
3. 然后中间这块可能关心的内容包括最新价last_price、bid_volume.....输入rtd_tick_data函数，参数的输入会使用到自动填充和锁定单元格（操作见视频07：20）

这样我们就已经订阅了整个 IO2003看涨所有的期权链的合约信息了。

左边既然是看涨，右边就应该是看跌，把左边表头复制过来。我们发现其实结果基本上差不多，只要把合约代码里“-C-”改成“-P-”就是一个看跌期权的合约代码，双击快速填充。（见视频10：30）

这样，所有的IO2003，这个月份上不管看涨还是看跌就全部都在Excel里了，而且可以看到正在自动的刷新。

我们接下来就稍微把它变得好看一点。居中>>自动调整列宽（11：40）>>样式调整。

Excel表一个非常大的优势就是可以在很短的时间内快速构建出一套实时行情的页面（就像以上操作在10分钟不到的时间内）。我自己作为vn.py的作者，写了这么多年python代码的人，如果让我在Python里面那么快速的构建出这样的一套数据表也是做不到，因为毕竟要写代码，但是Excel就通过普通鼠标的操作，很快就可以把它都构建好了。

利用实时数据表做简单分析

有了这些数据之后，举个例子来算一下铜的看跌期权，bid\ask价差是多少？

在原来的实时表格中插入一列“价差”，=ask_price - bid_price，鼠标拖动，所有的数据都已算出来了。这也是为什么在零基础入门这个课程里面专门给大家讲如何在Excel里面做分析的原因。

我们所用的是Pyxll对接vn.py进程这个方式来做分析。如果你现在在一家金融机构里面工作，有万得终端或东方财富的choice客户端的话，也可以选择直接用它们的插件来获取数据来做分析。这只是获取数据的渠道不同而已。

后面的课程我们会说到平价套利的机会、盒式套利的机会等等逻辑，都是在Excel或者在Python里面操作，你可以慢慢学着用起来。

本课总结

回到PPT来，最后总结一下之前的一些操作点：

Excel表操作技巧



- 首先怎么样锁定单元格，加上美元符号作为前缀。
- 然后要快速切换的话，可以直接按F4
- 字符串拼接是通过拼接运算符&
- 批量自动填充的技术：选中用来做自动填充的区，然后往下拖，或者说选中区域之后双击右下角的正方形的图标，也可以实现这么一个填充的功能。

Ok，那么我们这一集的内容就先到这里，Excel表也同样会放在我们课程的QQ群里面，大家到时候直接来下载用就好了。当然我更推荐大家跟着我这个视频里面的方法，自己主动一步一步做一遍，可能学习效果会更好更多。

期权零基础入门

vn.py全实战进阶系列

更多精华内容，请扫描二维码关注社区微信公众号



收起描述

0条评论

回到首页 最新

已加载全部

发评论