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



情

5

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

2020-03-06 14:11:53

倍速设置 1X

• 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

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

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

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

分类

可访问的行情字段

可以获取的字段还很多:

字段 描述 代码 symbol 交易所 exchange 合约信息 中文名 name 涨停价/跌停价 limit up/limit down 最新价 last price 成交量/持仓量 volume/open interest 成交信息

open_price/high_price/low_price

bid_price_1~5

bid_volume_1~5

ask_price_1~5

ask_volume_1~5

们上节课用的,就是最新的价格。

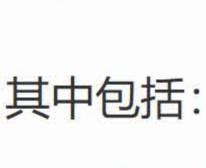
开盘价/最高价/最低价

买1~5价

买1~5量

卖1~5价

卖1~5量



盘口信息

等等。

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

volume和open_interests是成交量和持仓量这两个

• 比如说合约信息类的: symbol 合约代码、exchang

e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

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:

所有的这些字段,都可以在Excel里面访问到,可以用

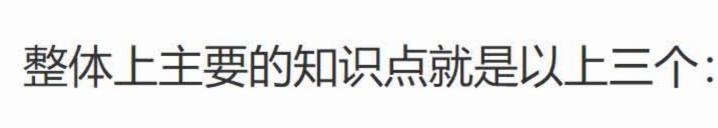
到这些信息去构建我们后面所有的分析。

\$前缀锁定 F4按钮切换 字符串拼接 拼接运算符& 配合锁定生成

批量自动填充

选中区域后双击右下角

锁定单元格



锁定单元格

字符串拼接

频07:20)

列宽(11:40)>>样式调整。

bid\ask价差是多少?

Excel里面做分析的原因。

本课总结

的合约信息了。

选中区域后拖动

Excel表操作技巧

- 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。
 - 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 pric e、bid_volume.....输入rtd_tick_data函数,参数

这样我们就已经订阅了整个 IO2003看涨所有的期权链

左边既然是看涨,右边就应该是看跌,把左边表头复制

1. 那在Excel里,先把行权价一列准备好:就是3300

好(自动填充操作见视频04:10)。

到4650, 先把我们IO2003上所有的价格都给准备

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:

的输入会使用到自动填充和锁定单元格(操作见视

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

Excel表一个非常大的**优势就是可以在很短的时间内快**

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

速构建出一套实时行情的页面(就像以上操作在10分钟

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,

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

我们所用的是 PyxII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。

锁定单元格

字符串拼接

批量自动填充

F4按钮切换

配合锁定生成

选中区域后双击右下角

回到PPT来,最后总结一下之前的一些操作点:

\$前缀锁定

拼接运算符&

选中区域后拖动

• 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,

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,可能学习效果会好更

然后往下拖,或者说选中区域之后双击右下角的正

期权零基础入门

更多精华内容,请扫描二维码关注社区微信公众号

vn.py全实战进阶系列

↑ 回到首页

0条评论

发评论

多。

收起描述 🙆 已加载全部