币安永续合约双向均线量化策略（实盘部署）

名词简介：

币安：

目前加密货币主流交易所，涉及现货、合约、NFT等交易标的

双均线策略：

指的是运用不同周期的短周期均线及长周期均线的相对大小，对当前趋势进行买入或者卖出研判的策略。本策略使用的是指数平滑均线。

BTCUSDT永续合约 (U本位)：

“永续合约”是一种没有到期日的期货合约，可以做空兼做多获得双向收益。“BTCUSDT永续“是指锚定BTCUSDT价格的一种永续合约。

回测框架：

Backtrader Framework

交易方式：

市价单成交

手续费：

0.04%

杠杆：

回测与实盘均使用一倍杠杆

实盘部署：

部署于腾讯云自购服务器（HK），目前已实盘部署。

实盘交易机器人部分代码：

Text

Description automatically generated

回测部分代码：

Text

Description automatically generated

回测参数：

训练集：2019-09-08 17:59:59 - 2021-04-25 23:59:59

数据频率：6小时数据

测试集：2021-04-26 05:59:59 - 2021-12-31 17:59:59

交易标的：BTCUSDT-Perpetual future contract

资金量：100刀

杠杆倍数：X1

佣金：0.4%

测试集收益：

Sharp ratio: 3.56

总收益（2021-04-26 - 2021-12-31）：77.36%

最大回撤：11.71%