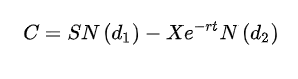
策略逻辑：

期权和股票的价格相对于对方来说可能是错误的（Black Scholes），如果你正确地进行这种套利交易，就会有（小的）利润。套利期权交易是一种市场中立的策略，旨在通过采取抵消多头和空头的相关证券来中和某些市场风险。

代码模型简要：

1. Black-Sholes模型：分别输出欧式认购期权的价格和欧式认沽期权的价格，以及计算期权中的delta，即期权价格关于标的物价格的一阶偏导数，期权价格变化对其标的物价格变化的比率，在BS公式中，对于看涨期权，Δ=N（d）；对于看跌期权，Δ=N（d）-1。
2. arbitrary\_demo.py：
   1. 导入市场价和到期日的数据。
   2. 设置好BS模型的参数后，根据公式分别计算多方和空方的call\_value，put\_value，call\_delta，put\_delta，并计算预期的BidPrice和AskPrice的市场价格。
   3. 判断是否存在套利机会，并按照Timestamp计算trades函数
   4. 计算累计现金流，当前持仓累计数目和买卖价差导致的BS套利

参考代码及原理出处：  
<https://github.com/JerBouma/AlgorithmicTrading/tree/master/Options%20Arbitrage>