基于thenextquant的deribit交易所跨期套利分享

Paul-zhou

2019-06-26

目　录

跨期套利原理

框架介绍

下载与配置

编写程序

Deribit

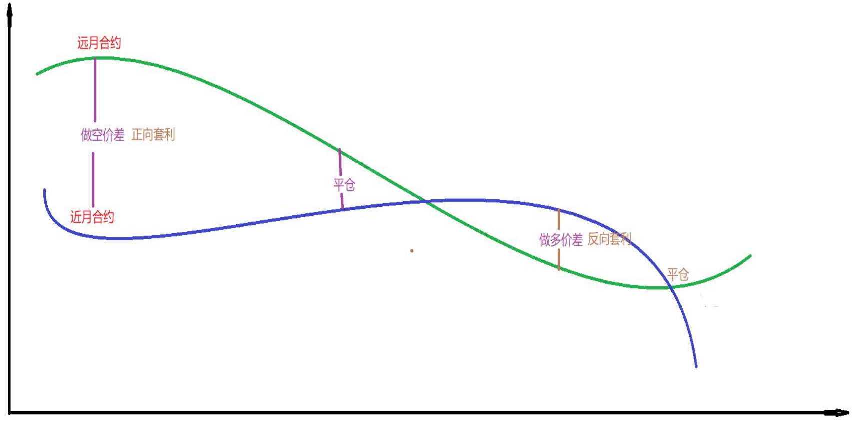
DIGITAL
ROAD GROUP

1跨期套利介绍

统计远近月合约价差分布情况，**当监控到价差异常时开仓交易，当价差回归时平仓。**

正向套利：做空远月，做多近月

反向套利：做多远月，做空近月



1跨期套利介绍

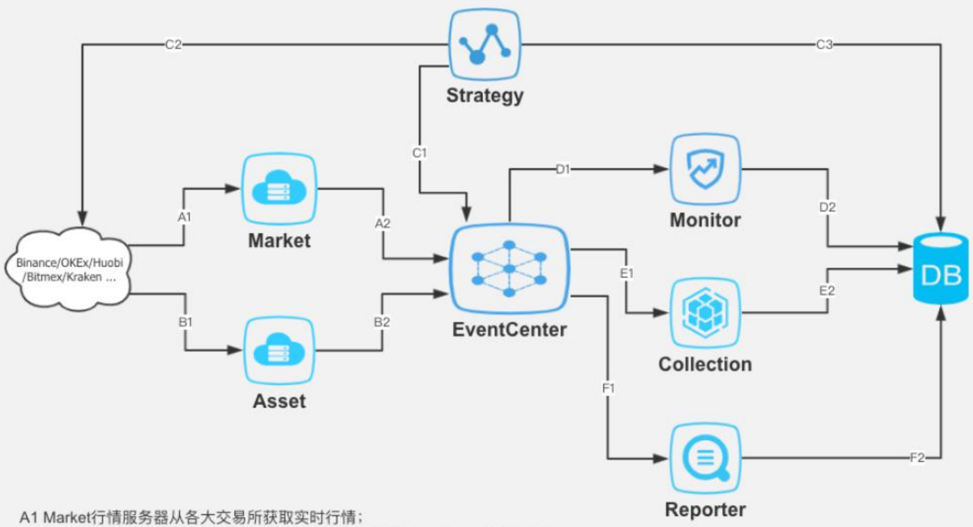
采用方式比较：

(1) 采用 连续合约 & 交割合约，收敛，有持仓费用

(2) 采用 交割合约 & 交割合约，可能不收敛(期转现)，无持仓费

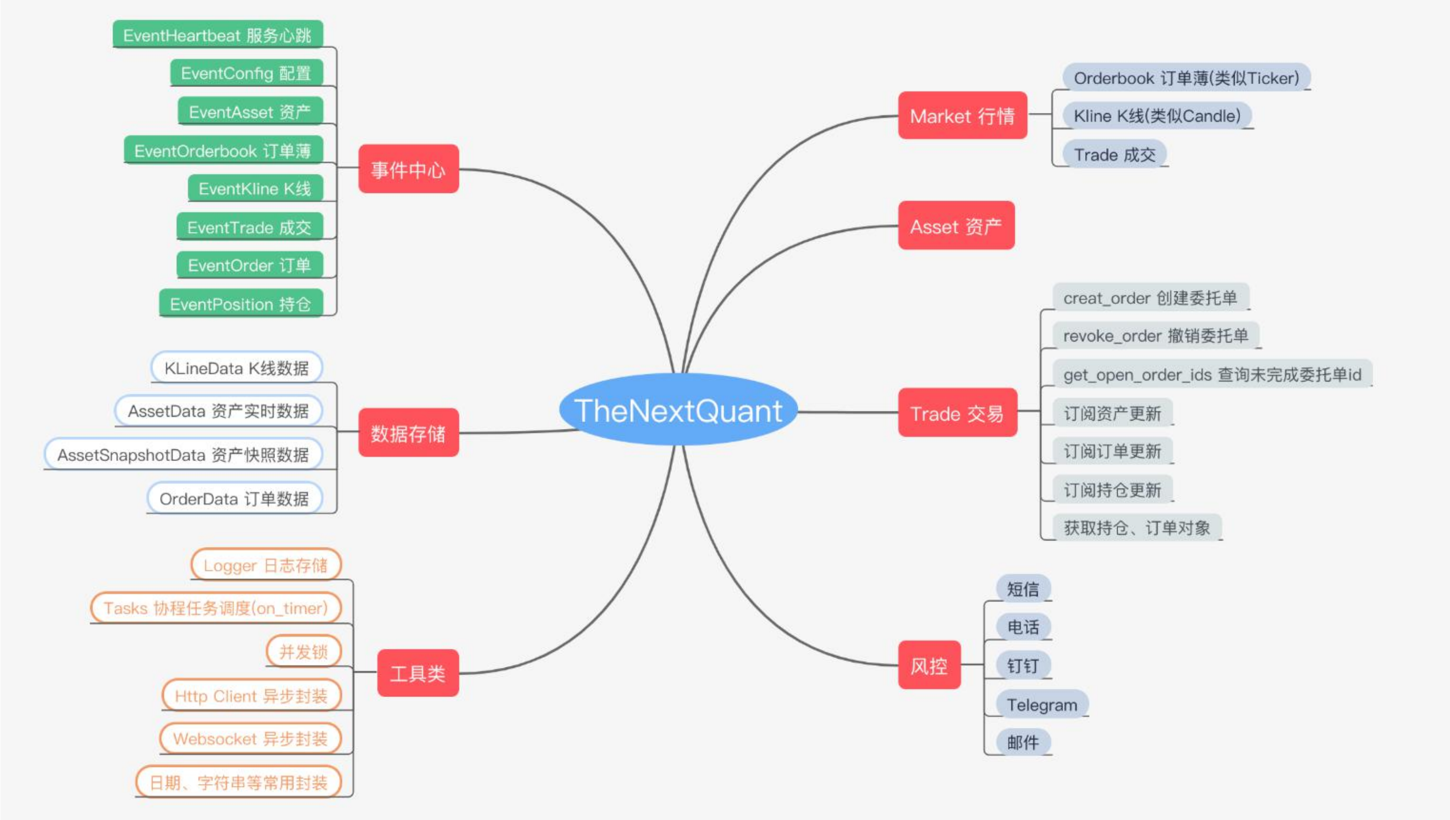
2 thenextquant框架简介

TheNextQuant交易系统架构图



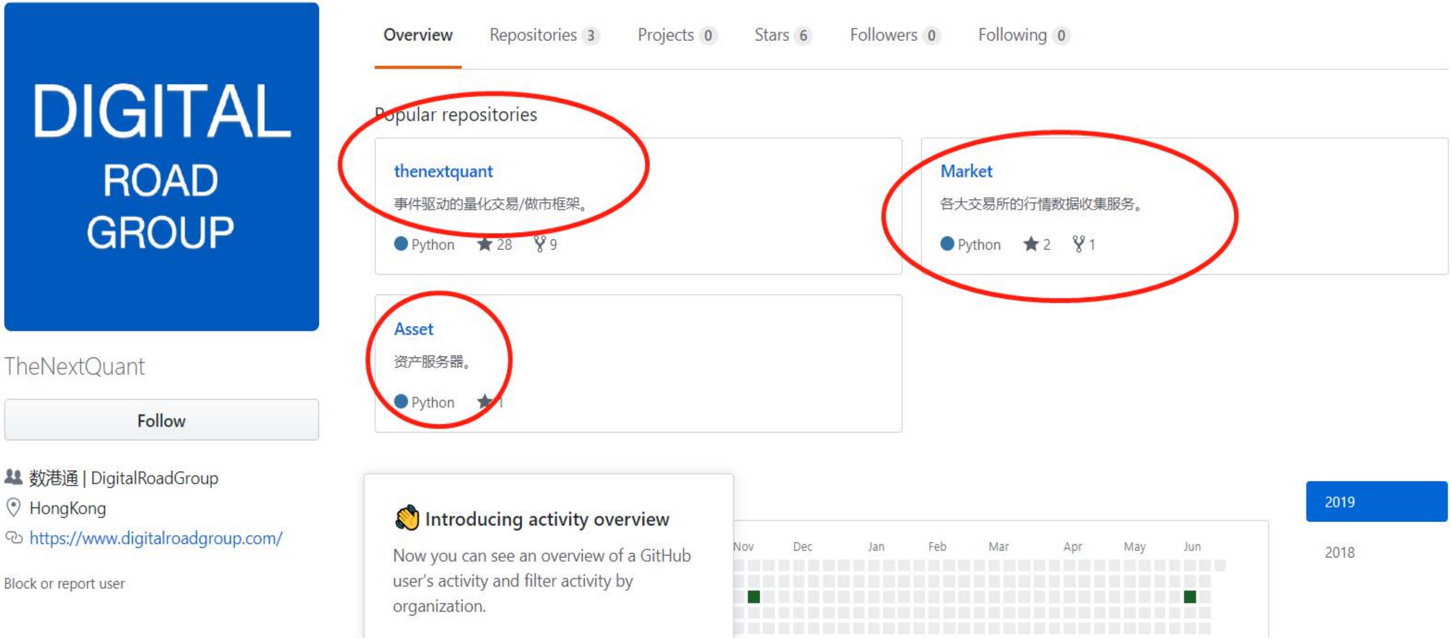
A1 Market行情服务器从各大交易所获取实时行情；
A2 Market行情服务器将行情信息通过事件的形式发布至EventCenter事件中心；
B1 Asset资产服务器从各大交易所同步实时资产数据；
B2 Asset资产服务器将资产信息通过事件的形式发布至EventCenter事件中心；
C1 Strategy策略服务器从EventCenter事件中心订阅实时行情、实时资产等信息，同时发布订单事件、持仓事件等至EventCenter事件中心；
C2 Strategy策略服务器与各大交易所发起交易；
C3 Strategy策略服务器存取数据至数据库；
D1 Monitor风控服务器从EventerCenter事件中心订阅行情、资产、订单、持仓等各种所需的事件，并实时计算监控规则和触发报警；
D2 Monitor风控服务器将监控数据存储至数据库；
E1 Colletion服务器订阅行情、资产、订单、持仓等各种所需的事件，并经过整合收集处理；
E2 Colletion服务器将经过整合处理之后的数据，存储至数据库；
F1 Reporter服务器订阅行情、资产、订单、持仓等各种所需的事件，并经过整合之后发出报表统计数据；
F2 Reporter服务器将经过整合处理之后的报表统计数据，存储至数据库；

2 thenextquant框架简介



3 下载与配置

https://github.com/TheNextQuant



4 程序编写

整体思路：

(1) 行情：跟踪远近月合约价差

(2) 交易逻辑：当达到开仓条件时，则发单交易，当收敛时则平仓

(3) 资产信息

(4) 风控预警：钉钉、电话等

5 交易指令说明

deribit、bitmex只有买开和卖开指令，而okex和huobi则有买开、买平、卖开和卖平指令，为了统一，我们规定如下：

针对多头的操作

买开：action=buy，quantiy > 0

卖平：action=sell，quantity > 0

针对空头的操作

卖开：action=sell，quantity < 0

买平：action=buy，quantity < 0

6 程序编写--写一个案例

DigitalRoadGroup官网网：https://www.digitalroadgroup.com/
TheNextQuant官网：https://thenextquant.com/
thenextquant开源项目目：https://github.com/TheNextQuant/thenextquant