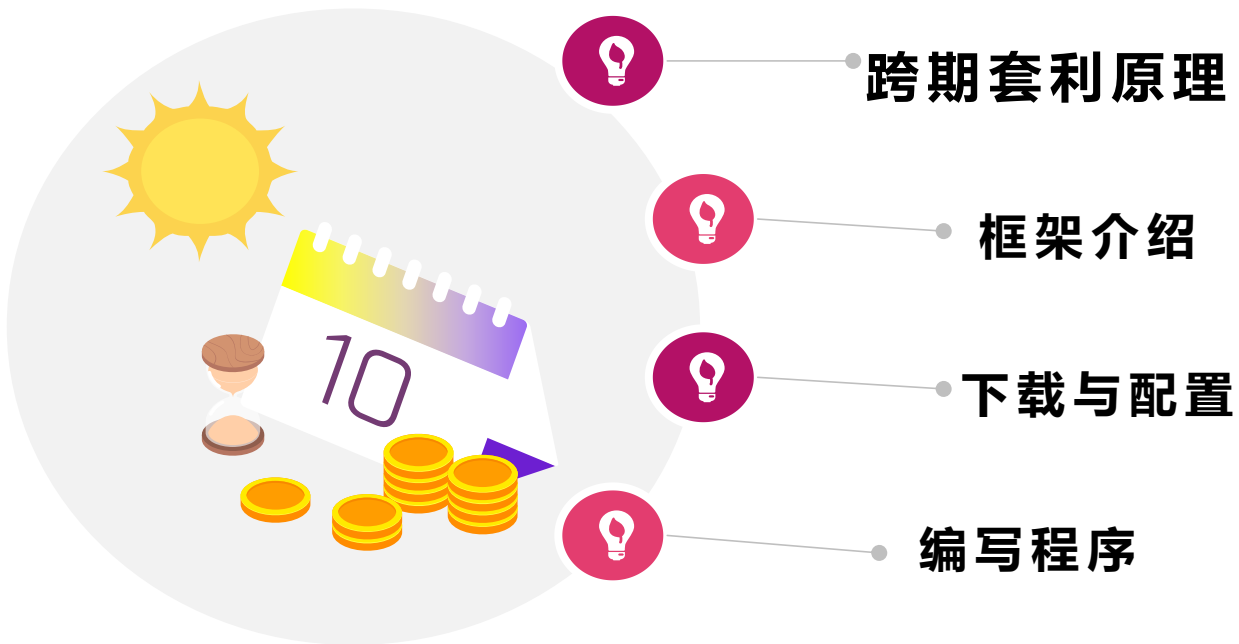




# 基于thenextquant 的deribit交易所跨 期套利分享

Paul-zhou  
2019-06-26

# 目 录





**Deribit**

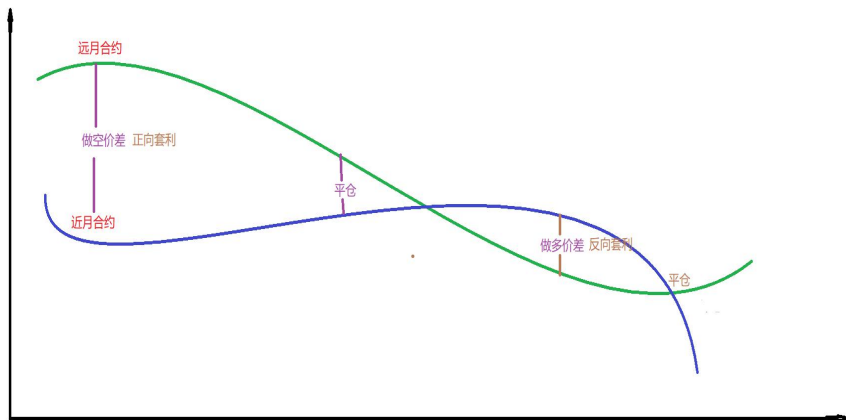
**DIGITAL**  
**ROAD GROUP**

# 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

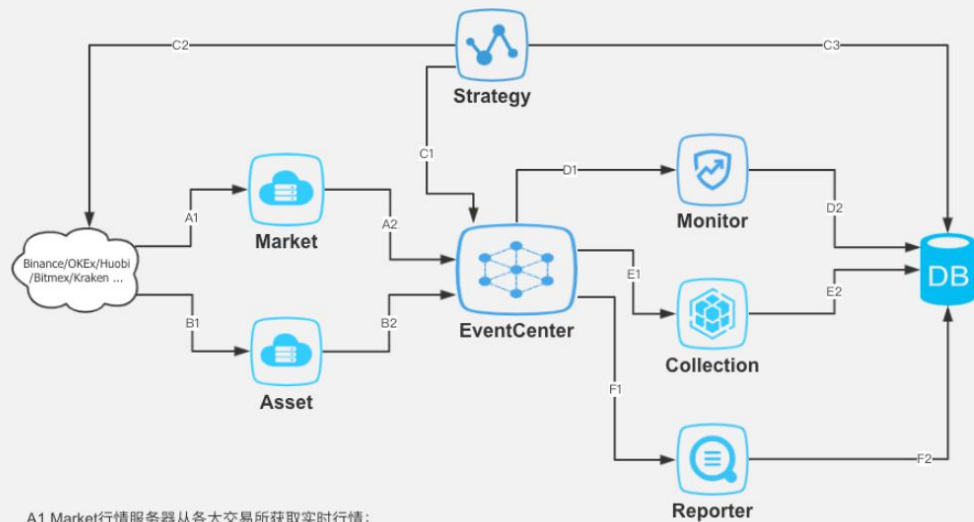
采用方式比较：

(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

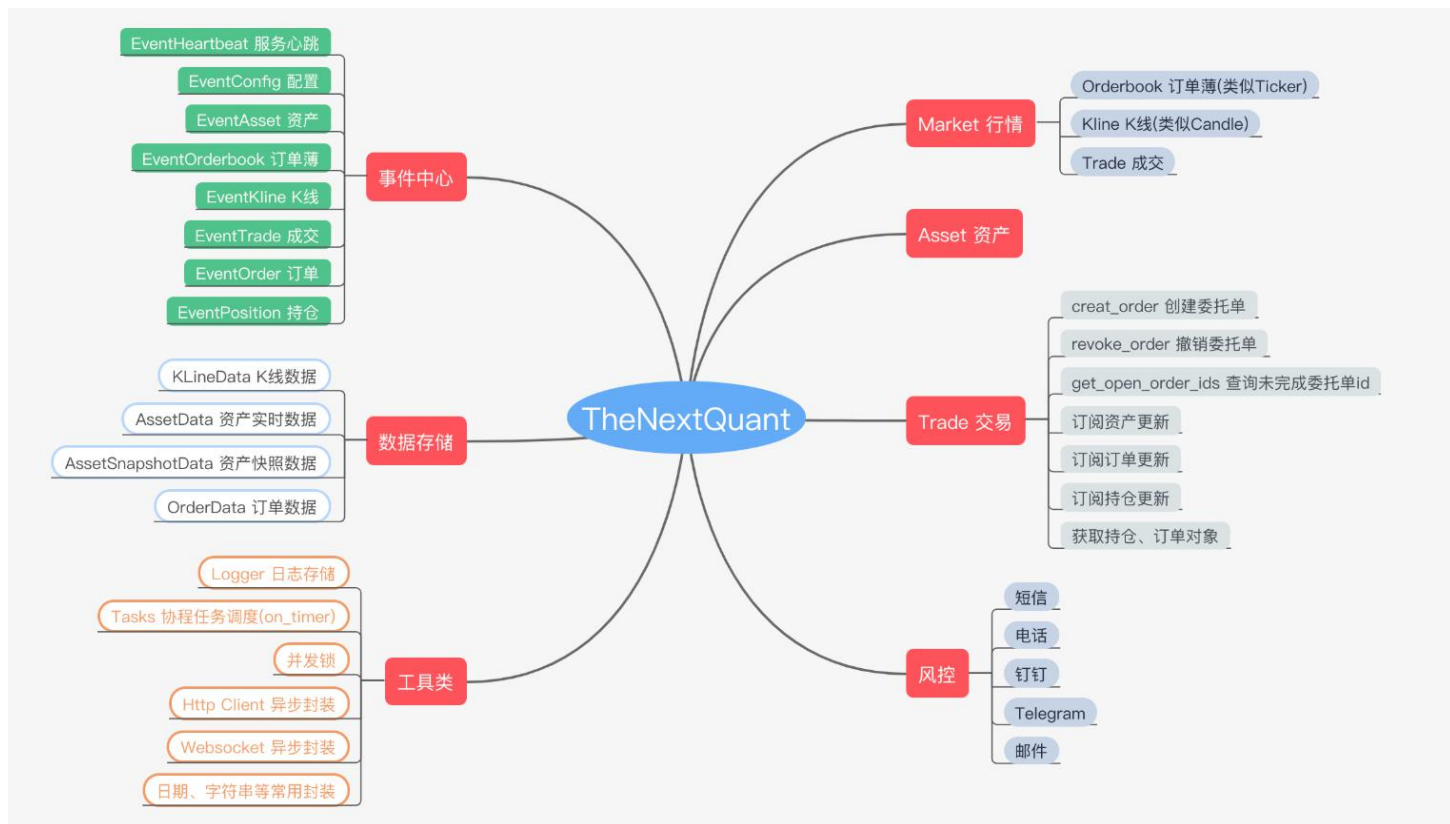
## 2 thenextquant框架简介

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EventCenter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 Collection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 Collection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>



TheNextQuant

Follow

数港通 | DigitalRoadGroup

HongKong

<https://www.digitalroadgroup.com/>

Block or report user

Overview Repositories 3 Projects 0 Stars 6 Followers 0 Following 0

Popular repositories

**thenextquant**

事件驱动的量化交易/做市框架。

Python 28 9

**Market**

各大交易所的行情数据收集服务。

Python 2 1

**Asset**

资产服务器。

Python 1

Introducing activity overview

Now you can see an overview of a GitHub user's activity and filter activity by organization.

Nov Dec Jan Feb Mar Apr May Jun

2019

2018



## 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, quantity > 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>