

套利指数

一、简介

易得程序化支持套利指数，我们可以通过自编简单的公式表达式定义品种间的套利价差，从而跟踪品种间的实时价差套利空间。套利指数能够在盘中实时刷新，也可以像普通股票一样查看 K 线、分时、分笔成交等数据。

套利指数的历史数据计算依赖于定义品种的历史数据，在计算时要保证定义品种历史数据的完整。指数盘中实时行情的计算需要定义品种的全推行情，建议开通使用易得全推行情服务。

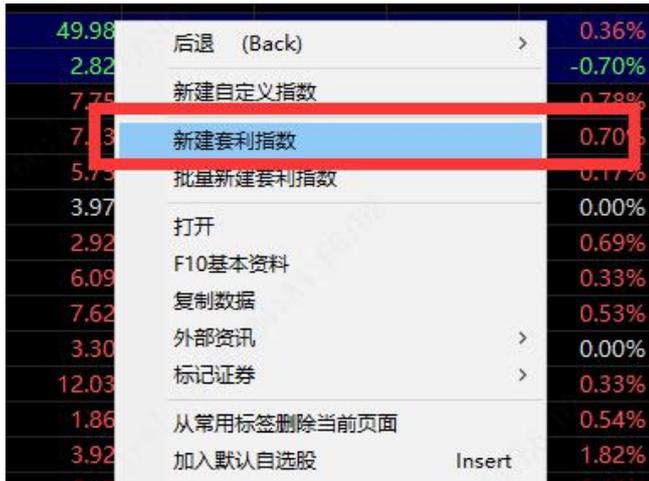
二、调出套利指数

调出套利指数有两种方法：

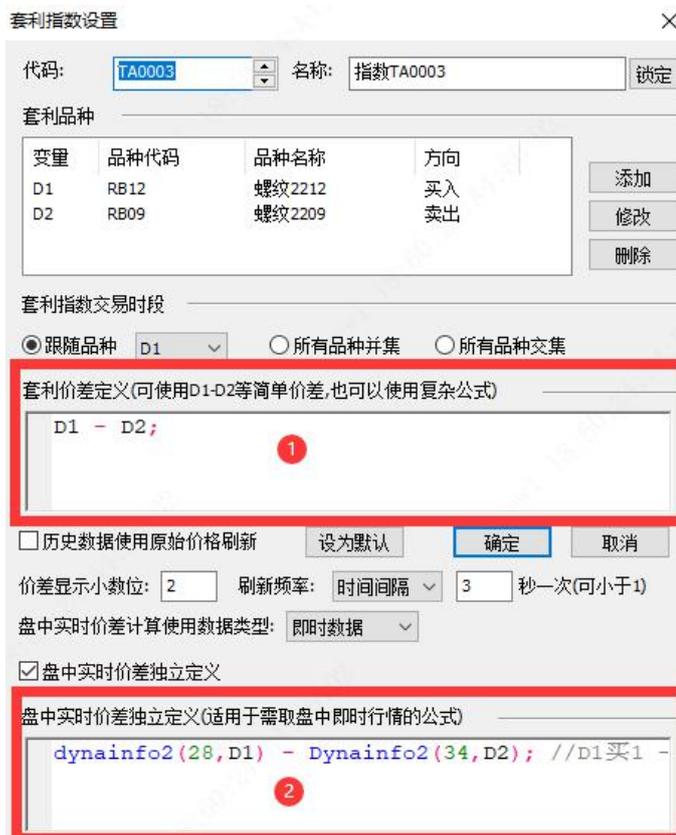
- 1、通过主菜单“交易” - “套利指数” - “新建套利指数合约”。



- 2、在动态显示牌中选中多个品种，通过右键菜单“新建套利指数”快速创建选中品种的套利指数。



三、套利指数的设置



打开套利指数设置，我们可以在这里设置套利指数的相关配置。下面我们逐个介绍一下每个设置的含义。

代码：是这个指数的标识代码，必须以“TA”打头。

名称：是指数名，加入品种后，名称也会自动变，锁定可以不让名称自动变。

套利品种：可以任意添加，一般添加 2 个即可。方向可以设置是买入还是卖出。

套利指数交易时段：可以设定指数的**交易时间段**，比如沪深 A 股的交易时间段是上午 9:30-11:30,下午 13:00-15:00。套利指数将根据交易时间段生成对应时间的分时线和分钟线数据。可以跟随其中的一个品种，也可以是所有品种的并集或者所有品种交集。

套利价差定义：在上图 1 号标签处设定。默认的是 D1 - D2，既两个品种的差值。也可以使用任意公式函数。表达式解析器按 D1,D2,D3...代表每只品种代码的计算变量。

使用原始价格计算：指数历史数据默认使用成分股前复权数据进行计算，如果勾选该选项将使用未除权数据计算。

价差小数位数：设定指数的价格精度。

刷新频率：可以指定时间间隔（可以小于 1 秒）或者所有品种每笔 Tick 的频率。

盘中实时价差计算使用数据类型：盘中实时价差的计算，可以自定义指定使用什么数据类型来计算。一般使用即时行情即可，除非有特殊需求应用。

盘中实时价差独立定义：在上图 2 号标签处设置。意思是计算盘中行情即时差价可以跟 1 号标签处的价差定义区别。如果勾选了该选项，1 号标签区的表达式只用来计算历史价差，2 号标签区的定义来计算盘中实时价差。一般不用勾选该选项即可，除非有特殊需求应用。

例如：

上图 1 号标签区是 D1-D2，指用 D1 的最新价减 - D2 的最新价。

2 号标签区的表达式是：dynainfo2(28,D1) - Dynainfo2(34,D2); 是指 D1 买 1 价 - D2 卖 1 价。这种情况下，盘中实时价差计算使用数据类型也要选即时行情。

四、套利指数的查看

创建好套利指数后，在动态显示牌的“指数”栏目中选择“套利指数”分类，即可列出所有的套利指数列表。



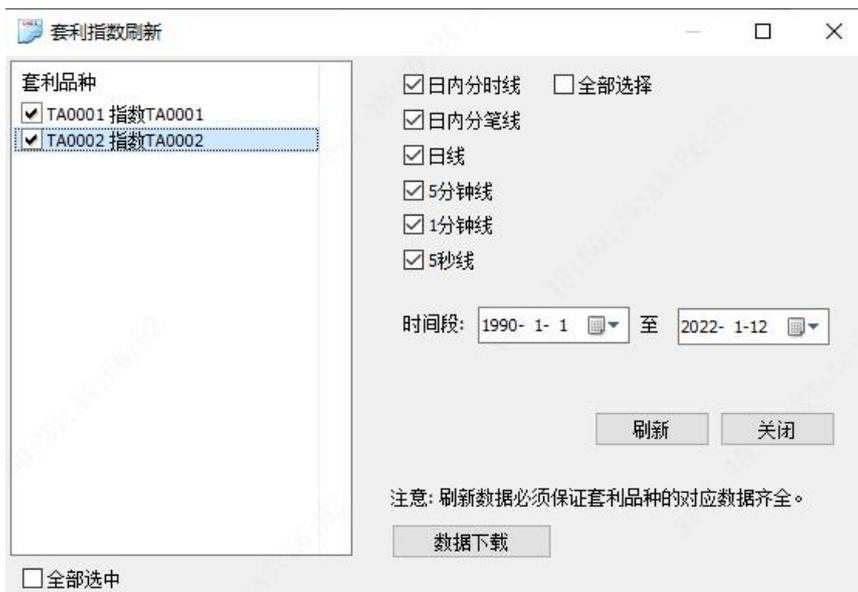
选中一只套利指数后，打开右键菜单。“刷新选中套利指数” 菜单按钮能打开刷新套利指数对话框。

在右键菜单中，我们还可以通过“修改套利指数” 菜单按钮对指数的设置进行修改。通过“删除套利指数” 菜单按钮可以删除该套利指数，以及复制套利指数。

数据刷新后，即可在分析图形中看到该套利指数的各种类型数据，如同普通个股一样操作。

五、套利指数的刷新

见下图，在套利指数刷新对话框，我们可以勾选套利合约，以及勾选需要刷新的数据类型，指定时间段即可完成一键刷新所有套利指数的所有数据类型。



注意，历史数据计算依赖于各品种的历史数据，请保证本地数据的完整性，如果数据不全请提前通过“数据下载”功能补全数据。

六、套利指数盘中自动实时刷新

在盘中有即时行情的时候会按照设定的刷新频率进行实时指数刷新计算。

如果您修改了指数的配置，盘中实时刷新都会为您重新加载新配置。

注意，盘中实时刷新需要有全部成分股的全推行情数据，否则数据缺失将会影响指数计算结果。

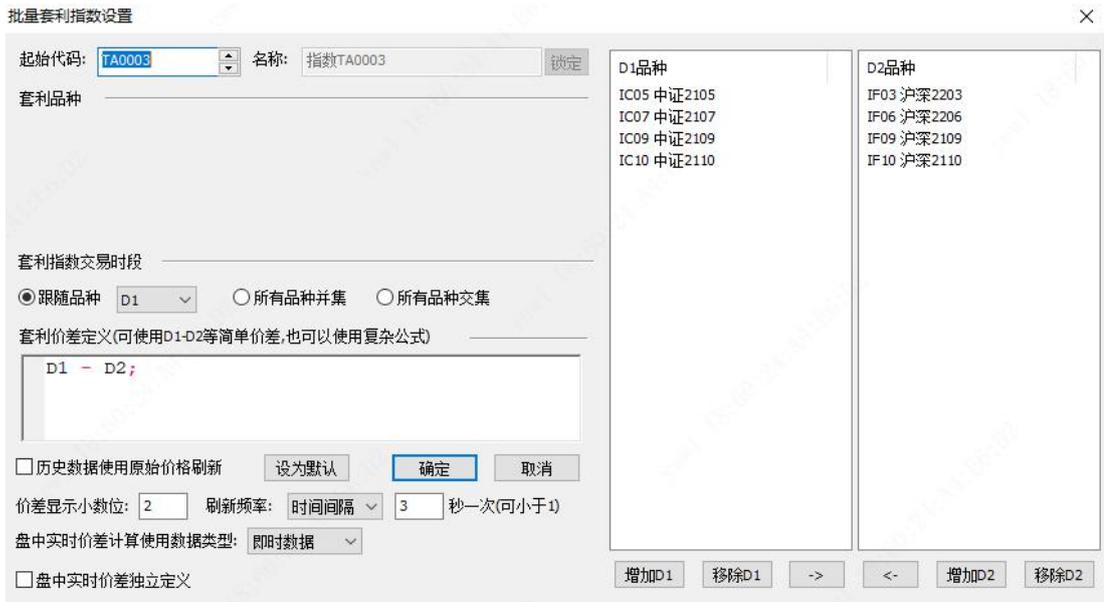
七、批量创建套利指数

在动态显示牌选中多个品种，点击右键菜单可以批量创建套利指数，方便需大量套利指数的用户快速创建。



打开批量新建套利指数，我们看到列表中列出选中品种到 D1，我们可以自由与 D2 进行交换。您可以通过起始代码设置这些指数的开始代码，并按递增的方式展开。批量创建会为您进行 D1 区品种和 D2 区品种的交叉套利指数。

这里的各种选项设置会应用于批量创建的所有套利指数。



查看上图批量创建的 4*4 的 16 个套利指数。

常用	基础行情	扩展行情	阶段统计	指标统计	模板	最近	涨幅	涨跌	量比
	田	1	TA0001	指数TA0001		-4.06	10.03%	-0.37	1.6
	田	2	TA0002	指数TA0002		-1.85	-8.87%	0.18	2.6
自选	田	3	TA0003	中证2105.沪深22			0.00%	0.00	0.0
	田	4	TA0004	中证2105.沪深22			0.00%	0.00	0.0
沪深	田	5	TA0005	中证2105.沪深21			0.00%	0.00	0.0
	田	6	TA0006	中证2105.沪深21			0.00%	0.00	0.0
指数	田	7	TA0007	中证2107.沪深22			0.00%	0.00	0.0
	田	8	TA0008	中证2107.沪深22			0.00%	0.00	0.0
板块	田	9	TA0009	中证2107.沪深21			0.00%	0.00	0.0
	田	10	TA0010	中证2107.沪深21			0.00%	0.00	0.0
期货	田	11	TA0011	中证2109.沪深22			0.00%	0.00	0.0
	田	12	TA0012	中证2109.沪深22			0.00%	0.00	0.0
基金	田	13	TA0013	中证2109.沪深21			0.00%	0.00	0.0
	田	14	TA0014	中证2109.沪深21			0.00%	0.00	0.0
债券	田	15	TA0015	中证2110.沪深22			0.00%	0.00	0.0
	田	16	TA0016	中证2110.沪深22			0.00%	0.00	0.0
	田	17	TA0017	中证2110.沪深21			0.00%	0.00	0.0
	田	18	TA0018	中证2110.沪深21			0.00%	0.00	0.0