

价差套利系统

目 录

- 价差套利系统原理介绍
- 价差套利系统使用说明
- 价差套利系统参数说明

价差套利系统原理介绍

价差套利的原理

同一个商品在不同平台上的报价，因为数据来源通道的不同以及网络条件的差异等因素，会造成s价格上有快慢的差别(虽然这个时间很短)，那么在某一个时间点上，一个价格突变使得两个平台之间价差达到几十甚至上百点(小点)，这就使价差套利成为可能。

例如，北京时间2017.07.10 19:26:37，黄金XAUUSD在平台A上的卖价1209.66，买价1210.16(点差50点)；同时在平台B上的卖价1211.15，买价1211.57(点差42点)；二者的净价差为 $1211.15 - 1209.66 - (0.50 + 0.42) = 0.57$ 美元。

如果此时在平台A上做1手XAUUSD多单开仓价1210.16，在平台B上做1手XAUUSD空单开仓价1211.15，那么这两个单子共同锁定0.57美元的净价差，理论上可获净利57美元。

价差套利系统使用说明

价差套利系统的组成

价差套利系统就是根据上述原理研发而成，由“价差套利系统(控制端)”和“价差套利系统(执行端)”两个部分组成，可以同时最多在4个平台交易账户两两之间，同时实现10个货币对的实时监控和价差套利交易。

那么工作的时候是由一个控制端EA(安装在任意一个MT4客户端上)和4个执行端EA程序(分别安装在4个MT4客户端上)协同工作来自动完成两两之间套利交易的。

控制端的功能，就是依据执行端上传的行情数据进行监控分析伺机发出开仓指令，并对已发出的指令进行跟踪伺机发出平仓指令。

执行端的功能，就是上传行情数据，执行开仓指令，上传相关订单数据和执行平仓指令。

价差套利系统的使用

价差套利系统可以做三种模型；剥头皮、抓新闻数据、抓延时。选取这三种任何一种交易模式，都对平台的点差要求较高，要选择点差较小的平台。

剥头皮模式：可以设置参数开仓净价差点数小点位刷单，赚取退佣。图例是一个平台刷单的手数。

货币对	单量(手)	利润(USD)
AUDUSD	2.00	144.00
EURJPY	1.00	28.95
EURUSD	4.20	44.50
GBPUSD	7.30	168.30
NZDUSD	1.00	31.00
USDCAD	8.30	-41.53
USDCHF	2.00	25.31
USDJPY	3.20	-117.23
XAUUSD	6.10	-117.70
总计:	35.10	165.60

抓新闻数据：指大行情数据来临时，抓住一波数据。我们把参数设置当中的开仓净价差点数扩大，这样的话遇大的行情波动就会抓的很准，因为设置的点数要是小，本来就是靠两个平台之间的价格差来获利的，小点数的有可能会因为滑点，导致平仓亏损。

抓延时：指把盈利固定在某些一个平台上，取决于平台之间的时间快慢。我们可以用一个实盘和模拟盘，把盈利都固定在实盘上，单独给实盘设置一个获利的点数，在通过平台的时间快慢，来抓取。

以下具体讲解每个参数的实际意义

价差套利系统使用说明

一、价差套利系统(执行端)的加载和参数设置

导航

Blackwell Global Trader

- 账户
- 技术指标
- EA交易
 - MACD Sample
 - Moving Average
 - 半自动交易策略
 - 标准震荡策略
 - 对冲套利策略
 - 对冲增强策略
 - 价差套利系统(控制端)
 - 价差套利系统(执行端)**
 - 价值周期策略
 - 趋势博弈策略
 - 万能交易策略
 - 增强震荡策略
- 脚本

EURUSD!H1 1.23912 1.23929 1.23809 1.23874

价差套利系统(执行端) [11]

对冲账号 = 203140
当前账号 = 800152401
平台时间 => 2018.03.08 10:23:33 [正常]
主控时间 => 2018.03.08 17:23:33 [正常]
本地时间 => 2018.03.08 17:23:33
循环速度 => 23 遍/秒

交易账号	货币对	报价时间	点差	卖价	买价
800152401	EURUSD!	10:23:32	30	1.23874	1.23904
800152401	GBPUSD!	10:23:31	35	1.38743	1.38778
800152401	AUDUSD!	10:23:32	35	0.77981	0.78016
800152401	NZDUSD!	10:23:32	40	0.72603	0.72643
800152401	USDJPY!	10:23:32	30	106.087	106.117

Expert - 价差套利系统(执行端)

关于 常用 输入参数 依存关系

变量	赋值
交易组号	11
显示总开关	true
显示价格信息	true
显示指令信息	true
原点坐标	10
	15
	430
	15
	30
	Yellow
	DarkTurquoise
	Red
	Red
	Gray
	Magenta
	DarkTurquoise
	Pink
	Gray

加载(L)

保存(S)

确定 取消 重置

6 Feb 2018

常用 收藏夹

执行端只要安装到MT4平台后，加载到任何图表中都可以工作。每一个参与对冲交易的MT4平台都要加载这个执行端程序，但不要重复加载。需要注意的是，就一个重要参数“交易组号”的设置要与控制端的“交易组号”设置相同的数字，否则它们相互间无法联络，也就无法正常工作了。参数设置及设置完毕后的显示画面如下：

二、价差套利系统(控制端)的加载和参数设置

控制端的参数设置分为八部分：组号与对冲品种、对冲账户属性、开关及行为属性、仓位开仓条件和目标与止损参数、交易时段控制、交易间隔和持仓时间控制、其他参数设置、显示参数设置。

价差套利系统 (控制端) 2.0

普通 输入 依存关系

可变	值
rem01	===> 组号与对冲品种-----
交易组号_说明	控制端与各执行端应设置相同的交易组号,否则...
对冲品种列表_说明1	填控制端能识别的货币对,以','做分隔符,须输入...
对冲品种列表_说明2	EA自动识别货币对名称后缀,若有非标名称,通...
对冲品种列表_说明3	注意:交易过程中变更货币对可能造成指令池...
禁止对冲账号列表_说明1	举例: 3001927/7668432,2011754/3322127
禁止对冲账号列表_说明2	3001927/7668432:表示3001927和7668432...
交易组号	11
对冲品种列表	EURUSD,GBPUSD,AUDUSD,NZDUSD,USDJ...
禁止对冲账号列表	
rem02	===> 对冲账户属性-----
交易账号_说明	最多可设置四个交易账号,相互间做价差套利...
单量倍数_说明	开仓时实际单量手数=(开仓手数)x[单量倍数X]...
非标参数列表_说明1	非标参数每组之间用','分隔,支持三种格式。举...
非标参数列表_说明2	XAUUSD/Gold/0.5/20: 控制端品种XAUUSD,...
非标参数列表_说明3	EURUSD/0.5/20: 控制端品种EURUSD,单量倍...
非标参数列表_说明4	GBPUSD/0.5: 控制端品种GBPUSD,单量倍数0...
非标参数列表_说明5	非标参数优先处理,没有定义的将按标准参数处...
1	-----
交易账号一	
单量倍数一	1
佣金点数一	0

载入(L) 保存(S)

确定 取消 重置

参数上面有每个参数的解释，可以理解上面的解释。

第一部分：组号与对冲品种

rem01	====> 组号与对冲品种-----
交易组号_说明	控制端和各执行端应设置相同的交易组号,否则相互间无法识别!
对冲品种列表_说明1	填控制端能识别的货币对,以','做分割符,须输入正确,最多10个。
对冲品种列表_说明2	EA自动识别货币对名称后缀,若有非标名称,通过下面的[非标参数列表X]设置。
对冲品种列表_说明3	注意：交易过程中变更货币对可能造成指令池信息部分或全部丢失!
禁止对冲账号列表_说明1	举例：3001927/7668432,2011754/3322127
禁止对冲账号列表_说明2	3001927/7668432:表示3001927和7668432两个账号之间不做对冲交易
交易组号	11
对冲品种列表	EURUSD,GBPUSD,AUDUSD,NZDUSD,USDJPY,USDCHF,USDCAD,XAUUSD
禁止对冲账号列表	

交易组号：选择任意一个MT4平台加载控制端程序并设置好参数后就可以工作了。控制端不要重复加载，同时需要注意的是，参数“**交易组号**”的设置要与各执行端的“**交易组号**”设置相同的数字，否则它们相互间无法联络，也就无法正常工作了。

对冲品种列表：选择以控制端货币能识别的货币，最多输入10个货币。例如：控制端平台货币有货币后缀，而执行端没有，这个就要设置以控制端货币为准，写的货币带后缀。

（若有货币的前缀，这个是无法识别的）

第一部分：组号与对冲品种

rem01	====> 组号与对冲品种-----
交易组号_说明	控制端和各执行端应设置相同的交易组号,否则相互间无法识别!
对冲品种列表_说明1	填控制端能识别的货币对,以','做分割符,须输入正确,最多10个。
对冲品种列表_说明2	EA自动识别货币对名称后缀,若有非标名称,通过下面的[非标参数列表X]设置。
对冲品种列表_说明3	注意:交易过程中变更货币对可能造成指令池信息部分或全部丢失!
禁止对冲账号列表_说明1	举例:3001927/7668432,2011754/3322127
禁止对冲账号列表_说明2	3001927/7668432:表示3001927和7668432两个账号之间不做对冲交易
交易组号	11
对冲品种列表	EURUSD,GBPUSD,AUDUSD,NZDUSD,USDJPY,USDCHE,USDCAD,XAUUSD
禁止对冲账号列表	

对冲品种列表当中的货币要是两个账户显示的名称不一样，可以在参数当中的非标参数列表中设置。

例如：控制端显示XAUUSD, 执行端显示GOLD, 这种的时候就要在非标参数列表中设置XAUUSD/GOLD

禁止对冲账号列表：指两个账户之间不能做对冲交易。

例如：203140/800152401：这样写就表示这两个账号之间不做对冲交易。

第二部分：对冲账户属性

rem02	====> 对冲账户属性-----
交易账号_说明	最多可设置四个交易账号，相互间做价差套利交易。
单量倍数_说明	开仓时实际单量手数 = [开仓手数] x [单量倍数X]。
非标参数列表_说明1	非标参数每组之间用','分隔,支持三种格式。举例：XAUUSD/Gold/1/20, EURUSD/0.5/20, ...
非标参数列表_说明2	XAUUSD/Gold/0.5/20: 控制端品种XAUUSD, 执行端品种Gold, 单量倍数0.5, 佣金点数20。
非标参数列表_说明3	EURUSD/0.5/20: 控制端品种EURUSD, 单量倍数0.5, 佣金点数20。
非标参数列表_说明4	GBPUSD/0.5: 控制端品种GBPUSD, 单量倍数0.5。
非标参数列表_说明5	非标参数优先处理, 没有定义的将按标准参数处理。
1	-----
交易账号一	203140
单量倍数一	1
佣金点数一	0
盈利点数一	0
非标参数列表一	
2	-----
交易账号二	800152401
单量倍数二	1
佣金点数二	0
盈利点数二	0
非标参数列表二	
3	-----
交易账号三	0

交易账号一：参与对冲交易的交易账号，可以输入控制端账号也可以输入执行端账号，先输入任何一端账号都可以。如不输入账号，则直接忽略掉

单量倍数一：如预设值为 1.0，指一倍。实际开仓单量=开仓手数x此单量倍数。**注意系统有内定手数限制(最高手数限制2手/见左上角标题), 因此实际开仓单量会受此限制。**

佣金点数一： 账户的每交易一手数的佣金，如要是佣金，可以在这个位置加上去。

盈利点数一： 指这个账号的盈利和平仓条件（平仓条件有三个持仓秒数、整体获利、一个账户的单独盈利点数，只要符合其中任何一个条件就会平仓）

例如： 单独设置这个账号内的盈利点数，可以做抓延时，将盈利固定在某一个平台内，也就是说只要这个账户达到了设置的盈利点数就会平仓，另外一个进行对冲的账户也会相应的平掉。

非标参数列表一： 对冲品种列表当中的货币要是两个账户显示的名称不一样，可以在参数当中的非标参数列表中设置。

例如： 控制端显示XAUUSD, 执行端显示GOLD, 这种的时候就要在非标参数列表中设置
XAUUSD/GOLD

注意： 其余的交易账号，就不一一举例了，因为参数的使用方法一样，如果交易账号一输入的是控制端账号，那么交易账号二，就要输入执行端账号。

第三部分：开关及行为属性

ab	rem03	===> 开关及行为属性-----
ab	工作模式_说明	二选一:仅作监测/对冲交易,后者才会发开仓指令,前者暂停交易。
ab	开仓方式_说明	二选一:按市场价/按指令价,后者对交易有利,首选。
ab	对冲方式_说明	二选一:高空低多/高多低空,前者是首选,表示价格高的一方做,价格低的一方做多。
123	工作模式	仅作监测
123	开仓方式	按指令价
123	对冲方式	高空低多

工作模式：指账户做单的模式，有两种分别是仅作监测、对冲交易。选择仅作监测是不会交易，也就是暂停交易；选择对冲交易模式才会发出开仓指令，进行交易。

开仓方式：指按什么方式开仓，有两种分别是按市场价、按指令价。选择按市场价比较容易成交；按指令价比较对交易获利有利，一般都是选择按照指令价进行。

对冲方式：指按什么条件开仓，有两种分别是高空低多/高多低空。前者表示价格对比后，价格高的一方做空，价格低的一方做多，这样可以锁定价差利润；后者通常不应该出现，但作为一种选项，使用者不妨尝试一下。

第四部分：仓量、开仓条件、目标与止损参数

ab	rem04	====> 仓量、开仓条件、目标与止损参数-----
ab	净价差点数_说明1	净价差点数=[一方高价]-[对冲方低价]-[双方的点差]-[双方的佣金点差]
ab	净价差点数_说明2	净价差点数=> [开仓净价差点数]时,才会发开仓指令。
ab	盈利点数_说明	当双边合计净赢利平均点数>=[盈利点数]时全部平仓,同时持仓时间要达标
ab	遇反向信号平仓_说明	true:被套时等出现反向信号且净价差点数>=[反向净价差点数]时平仓
ab	止损点数_说明	当双边合计亏损平均点数>=[止损点数]时全部平仓,不管持仓时间是否达标
ab	关于点数_说明	所有涉及'点'的参数,都是按照控制端货币对报价来考量的
1/2	开仓手数	0.1
1/2	最大合计持仓手数	0
123	开仓净价差点数	20
123	盈利点数	10
123	遇反向信号平仓	true
123	反向净价差点数	20
123	止损点数	0
123	滑点数	30

开仓手数： 指定开仓时订单的手数，最高手数限制为2。如账户一，设置了单量倍数3，开仓手数设置为0.3，则实际下单为 $0.3 \times 3 = 0.9$ 手数，公式为：实际开仓单量=开仓手数x单量倍数；要是没有设置单量倍数，则就按照实际设置的开仓手数下单。

最大合计持仓手数： 指设定每个交易账户最大合计持仓量，若达到或超过此数值时，不会开新单。当参数为0，则不受此限制。

开仓净价差点数：指满足设置的开仓条件，才会进场做单。

如何知道是否满足开仓净价差点数，先要知道平台之间的净价差是多少？

图例：

	交易账号	货币对	报价时间	点差	卖价	买价
账号1	203140	EURUSD	11:38:00	19	1.23093	1.23112
账号2	800152401	EURUSD!	11:38:01	30	1.23088	1.23118

毛价差点数指两交易账户在同一商品的报价中，较高的报价减去较低的报价的差。

毛价差点数=1.23088-1.23093=5点

净价差点数=毛价差-（账号1点差+账号2点差+佣金点数1+佣金点数2）=
5-（19+30+0+0）=-44

（佣金点数1和佣金点数2如没有设置就加上0即可）

以上结论：当**净价差点数**≥**开仓净价差点数**时，即满足价差套利的开仓信号条件。所以通常设置**开仓净价差点数**大于0，比如30，才有钱可赚；如果设置一个负数，比如-50，就会很频繁地下开仓指令。

盈利点数：指每手账户的盈利点数。如账户1手数1+账户2的手数1=2手*盈利点数10=20，就是指两个账户要盈利20点才会平仓。（平仓的条件有三个，只要符合其中的一个就会平仓，盈利点数一，没有设置的话，就可以直接忽略；盈利点数，整个对冲账户的整体盈利；持仓秒数，在规定的时间内持仓，超过了就会平仓）

与反向信号平仓：默认的是开启，指正向信号被套住的时候，并且出现了反向信号，这个时候会在一个最有利的情况下平仓。

反向净价差点数：和正向净价差点数一样的算法，符合了反向净价差点数的话，就会启动反向信号平仓。

止损点数：指当两边账户合计的亏损点数 \geq 设置的止损点数时就会全部平仓。

滑点数：开仓条件指定的滑点数，如不设置则会不做单。

第五部分：交易时段控制

ab	rem05	===> 交易时段控制-----
ab	周一开始_说明	填本地时间小时,0-24有效
ab	周五截至_说明	填本地时间小时,0-48有效,大于23延续到周六
ab	每天开始结束_说明	填本地时间小时,0-23有效。截至<开始,表延续到次日
123	周一开始LocalHour	7
123	周五截至LocalHour	23
123	每天开始LocalHour	6
123	每天截至LocalHour	3

周一开始LocalHour：预设7，指周一开始7点以后开始交易，周二做单就以每天的开始时间为准。

周五截至LocalHour：预设23，指周五23点以后不在交易。

每天开始LocalHour：预设6，周二开始6之后开始交易。

每天截至LocalHour：预设3，每天超过凌晨3点，不交易。除了周五以上四个参数是设置本地时间交易时段，在这个交易时段内才会开仓。

第六部分：交易间隔和持仓时间控制

ab	rem06	===> 交易间隔和持仓时间控制-----
ab	最小开仓间隔秒数_说明	针对同一对账户之间、同一个品种及同一个方向而言
ab	最小持仓秒数_说明	有些平台有最小持仓时间要求,请依具体情况设置
ab	最大持仓秒数_说明	超过此时间还没有达到目标,将强制平仓
ab	开仓指令有效秒数_说明	超过此时间还没有开仓的指令,将作废
ab	指令完结后保留秒数_说明	指令池中指令历史被保留的最长时间
123	最小开仓间隔秒数	60
123	最小持仓秒数	65
123	最大持仓秒数	300
123	开仓指令有效秒数	60
123	指令完结后保留秒数	432000

最小开仓间隔秒数：指每次开仓最小间隔多少秒。

最小持仓秒数：对冲的两个订单已经开出来了虽然已经盈利，但持仓时间没达到的话，也不会立即平仓，因为要取决于平台的最小持仓要求。

最大持仓秒数：指持仓时间超过此参数时，订单将被强制平仓，而不管是否达到盈利标准。

开仓指令有效秒数：交易指令发出后时间超过了此参数值，还没有开单的，指令作废，若已开单的一方将被按孤单处理立即平仓

指令完结后保留秒数：为了在控制端显示已经完成的交易指令的执行情况。

第七部分：其他参数设置

ab	rem07	===> 其他参数设置-----
ab	防高频_说明	有时平台插件,你开仓,被立即平仓,持仓时间超短。true:遇此情况将停止交易。
ab	隐藏订单备注_说明	true:开仓时订单备注将不记录对冲信息。
ab	速度调节毫秒数	0-100,数值越小,循环扫描速度越高,CPU占用率越高,请权衡设置。
ab	域内断线侦测秒数	主控端与执行端之间若超过设定时间没有交换信息,判域内断线。
🌿	防高频平仓	false
🕒	高频持仓秒数	2
🕒	高频暂停秒数	28800
🌿	隐藏订单备注	false
🕒	控制端速度调节毫秒数	40
🕒	执行端速度调节毫秒数	40
🕒	域内断线侦测秒数	2

防高频平仓：默认是关闭，选择true是开启

高频持仓秒数：2，最高持仓两秒被平仓，就会被认定为高频交易

高频暂停秒数：28800，被认为高频平仓之后，系统会暂停交易28800，秒之后再开始交易。

以上三个参数是防止平台后台插件故意平仓，造成高频平仓。如果出现这情况，继续交易对我们不利，系统就暂停对应账户和货币对的对冲交易。

隐藏订单备注：默认是false不隐藏；true，开仓时订单备注将不记录对冲信息。

订单备注信息记录了开仓的指令价和当时的点差， 举例：311_610388, 113.914, 30，311是任务号；610388是与当前账户对冲的交易账户的账号；113.914是指令开仓价，与实际开仓价进行比较，就知道平台是不是给滑点了及滑点的程度；30是当时下达开仓指令时的买卖价差点数。设当前交易账号是800130473，那么在610388这个交易账户中找到对应的订单，备注信息311_800130473, 113.974, 25。

控制端速度调节毫秒数：指控制端监测速度的周期。

执行端速度调节毫秒数：指执行端监测速度的周期。

域内断线侦测秒数：预设值2秒。控制端与执行端之间是否断线的标准，超过这个时间没有连接算断线。比如执行端没有启动或**自动交易**按钮没有打开，控制端就会显示对应的执行端断线；如控制端没有启动或**自动交易**按钮没有打开，执行端就会显示控制端断线。

第八部分：显示参数设置

rem08	===> 显示参数设置-----
显示总开关	true
显示货币属性	false
显示价格信息	true
显示高频信息	false
显示指令信息	true
不显示已完成指令	false
123 原点X坐标	10
123 原点Y坐标	15
123 每组的宽度	430
123 行间距	15
123 每组显示行数	30

显示总开关： true，这是信息显示总开关，是开启的。还有后面若干参数都是控制画面显示的，就不一一赘述了。

下一页是控制端画面显示的样式。

标题及手数限制

工作模式 = [对冲交易] [净价差20点] [0.1手]

开仓方式 = [按指令价] [高空低多]

本地时间 => 2018.03.09 14:38:39

循环速度 => 18 遍/秒

指令总数 => 0

交易账号 发送时间 平台时间 账户状态 账户余额

203140 14:38:38 14:38:39 正常 25000

800152401 14:38:39 14:38:39 正常 7002.35

货币对 点差 点大小 点值

EURUSD 20 0.00001 1

GBPUSD 25 0.00001 1

AUDUSD 23 0.00001 1

NZDUSD 24 0.00001 1

USDJPY 20 0.001 0.937031

USDCHF 25 0.00001 1.0506

USDCAD 23 0.00001 0.775753

XAUUSD 35 0.01 1

交易账号 货币对 报价时间 点差 卖价 买价

203140 EURUSD 14:38:39 20 1.23180 1.23200

800152401 EURUSD! 14:38:39 30 1.23175 1.23205

203140 GBPUSD 14:38:39 25 1.38064 1.38089

800152401 GBPUSD! 14:38:38 35 1.38059 1.38094

203140 AUDUSD 14:38:39 23 0.77955 0.77978

800152401 AUDUSD! 14:38:38 35 0.77948 0.77983

203140 NZDUSD 14:38:39 24 0.72787 0.72811

800152401 NZDUSD! 14:38:39 40 0.72780 0.72820

203140 USDJPY 14:38:38 20 106.700 106.720

800152401 USDJPY! 14:38:37 30 106.696 106.726

运行状态

货币属性

市场价格

203140	USDCHF	14:38:39	25	0.95159	0.95184
800152401	USDCHF!	14:38:38	40	0.95149	0.95189
203140	USDCAD	14:38:39	23	1.28884	1.28907
800152401	USDCAD!	14:38:38	35	1.28878	1.28913
203140	XAUUSD	14:38:39	35	1318.47	1318.82
800152401	XAUUSD!	14:38:39	50	1318.41	1318.91

高频平仓信息列表

货币对 任务号 交易账号 订单号 开仓时间 持仓秒数

无高频记录

交易指令和执行状况

24小时内合计: 0 对订单, 手数 0手, 利润 0

指令池合计: 0 对订单, 手数 0手, 利润 0

任务号 货币对 多方账号 空方账号 开仓时间 平仓时间

任务号 合计利润 多方利润 空方利润 开仓状态 平仓状态

高频信息

指令和执行情况



谢谢观看