## 富田为

## 期权期货综合策略开发平台

## 使用指南

**软件背景介绍：**

随着我国金融市场的发展，以期货、期权为代表的金融衍生品日益丰富，为投资提供了更多的选择。但金融衍生品固有的复杂性也使基于期货、期权的综合策略难于开发和评估。

本平台提供了一个包含多源数据处理整合、策略构造、策略优化、策略回测评估，策略定型、策略监控的全过程策略研发解决方案，能够大大提高期权期货策略的评估和开发效率。

以本平台为基础研发的策略已经规模应用在实盘产品中，并在2019年京东量化投资大赛中荣获过中性策略组第一名的好成绩。

**登录使用指南：**

1. telnet登录： telnet ip:23 (ip为您购买的华为云服务器公网ip)
2. 进入应用软件平台目录：OFSDP
3. 在OFSDP下分别有如下四个子平台目录，运行子系统的名称即可运行：

 DataHandler 数据处理整合系统

 StrategyBuilder 策略构造系统

 DataWindTunnle 数字风洞系统

 StrategyMaintence 策略维护系统

**子平台介绍：**

本平台包括：数据处理整合系统、策略构造系统、数据风洞系统和策略定型及维护系统

* 数据处理整合系统

 通过自研的接口系统将多元数据源（Wind、信通及其它第三方数据提供方）的原始交易数据转换成统一的通用数据结构，并在这个过程中完成各种异常数据检测、缺失数据补足等处理。处理后的通用数据的尺度涵盖了从Tick级、秒级、分钟级、日级、周级，为后续各种尺度的策略研发做好了数据准备。同时，各种数据的时间都用统一内部格式标识，为后续多标的物组合策略的时间对齐提供了方便的底层数据基础。

* 策略构造子系统

 实现了策略结构化构造：核心是各种“指标“评估各个时点的买卖交易形势，然后辅以止盈止亏管理和仓位管理，共同构造出完整的策略方案。系统内置了数十种经过大量行情数据验证有效的核心指标，并自主编程实现，保证了每个指标的性能和特点在被策略引用时都能被完全理解和适当应用；同时也留有与专业第三方的数理统计、模式识别、人工智能接口，丰富和扩展“指标”，实现了灵活性和可扩展性。

* 数据风洞系统

数据风洞的功能实现对策略的优化、回测和评估，其核心是一个“数据风洞“引擎。风洞是以人工方式产生并控制气流，用来模拟飞行器周围气体的流动情况，并可定量分析飞行器在各种复杂气流中的性能的装置。我们自研的”数据风洞“就是通过各种数据源的数据，在Tick级别重构相关标的物的交易场景，然后将策略构造子平台上生成的各种策略在各种历史场景回测或在特定构造场景下高仿真模拟运行，进而对策略的性能进行全面的评估。

* 策略定型及维护系统

 在策略经过数据风洞定型定参后，如果评估结果达到设定标准，策略就进入定型和维护阶段。在这个阶段，随着时间演进，我们通过数据处理子平台将最新交易数据导入系统，并动态滚动评估策略的最新表现，根据评估结果对策略进行参数级别、模型级别和系统级别三个层次的调整，以使策略随时间不断演化。