

Backtrader量化平台教程

共 11 篇文章 · 已读 9%

加入清单架

清单「Backtrader量化平台教程」 10/11

Backtrader量化平台教程-跟踪止损单（十）

钱塘小甲子

AD：（本人录制的backtrader视频课程，大家多多支持哦
~ <https://edu.csdn.net/course/detail/9040>）

CTA当中，我们经常会采用跟踪止损的方法来控制回测，backtrader当中其实给我们准备好了这一方法。至于什么叫做跟踪止损单，简单介绍一下。

譬如在15年牛市中，我在某球网上听到一种大道至简的逃顶方式，就是你的净值跟踪止损达到20%的时候，马上全部立场走人，一年内不要碰股票。事实证明，这确实是一个挺好的方法。言下之意，当你某笔交易回撤达到某个值就止损的方法叫做跟踪止损。

```
class MyStrategy(bt.Strategy):
    def __init__(self):
        self.up_down = three_bars(self.data0)
        self.buy_signal = bt.indicators.CrossOver(self.data.close, self.u
        self.sell_signal = bt.indicators.CrossDown(self.data.close, self.

    def next(self):
        if not self.position and self.buy_signal[0] == 1:
            self.order = self.buy(size=1)
            self.order = self.sell(size=1, exectype=bt.Order.StopTrail, t
```

我们看一下上面这个策略，先不管buy_signal是什么，满足交易条件的时候，我们先买了一首，然后同时下了一个卖出的止损单“

```
1 | self.order = self.buy(size=1)
2 | self.order = self.sell(size=1, exectype=bt.Order.StopTrail, trailam
```

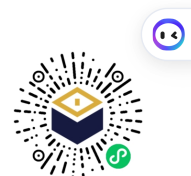
这里，我们的跟踪止损是这一笔交易亏损25元之后，就止损离场。如果你希望是一个百分比，那么就是，下面这样就是跟踪止损2%。

```
1 | self.order = self.buy(size=1)
2 | self.order = self.sell(size=1, exectype=bt.Order.StopTrail, trailpe
```

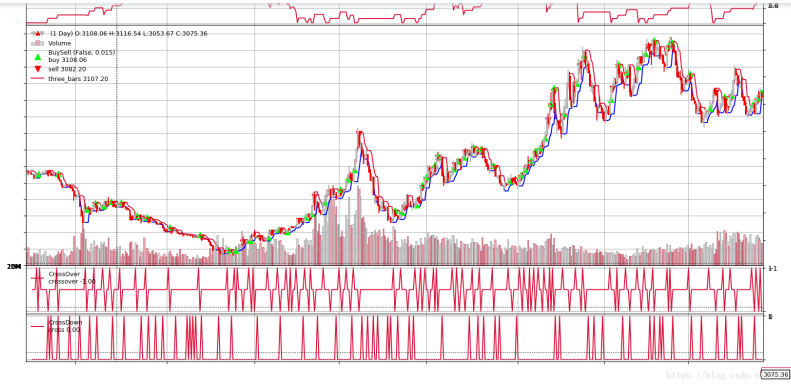
上面的策略跑一下，就是下面这样的。

- 1 Backtrader量化平台教程（一）:backtrader...
- 2 Backtrader量化平台教程（二）：Strategy类
- 3 Backtrader量化平台教程（三）Indicator
- 4 Backtrader量化平台教程（四）SSA策略实...
- 5 Backtrader量化平台教程（五）Signal
- 6 Backtrader量化平台教程（六）Analyzer
- 7 Backtrader量化平台教程（七）Optimizer
- 8 Backtrader量化平台教程（八）TimeFrame
- 9 Backtrader量化平台教程-Portfolio级别的...
- 10 Backtrader量化平台教程-跟踪止损单（十）
- 11 Backtrader量化平台教程-作者的一篇博客...

扫描小程序二维码
清单文章随时读



Backtrader量化平台教程 11篇文章



[下一篇](#)

Backtrader量化平台教程

共 11 篇文章 · 已读 9%

- 1 Backtrader量化平台教程（一）:backtrader...
- 2 Backtrader量化平台教程（二）： Strategy类
- 3 Backtrader量化平台教程（三） Indicator
- 4 Backtrader量化平台教程（四） SSA策略实...
- 5 Backtrader量化平台教程（五） Signal
- 6 Backtrader量化平台教程（六） Analyzer
- 7 Backtrader量化平台教程（七） Optimizer
- 8 Backtrader量化平台教程（八） TimeFrame
- 9 Backtrader量化平台教程-Portfolio级别的...
- 10 [Backtrader量化平台教程-跟踪止损单（十）](#)
- 11 Backtrader量化平台教程-作者的一篇博客...

举报

社区

- 专栏文章
- 阅读清单
- 互动问答
- 技术沙龙
- 技术视频
- 团队主页
- 腾讯云T1平台

活动

- 自媒体分享计划
- 邀请作者入驻
- 自荐上首页
- 技术竞赛

资源

- 技术周刊
- 社区标签
- 开发者手册
- 开发者实验室

关注

- 视频
- 社区
- 免费
- 联系
- 友情

热门产品

- 域名注册
- 云服务器
- 区块链服务
- 消息队列
- 网络加速
- 云

热门推荐

- 人脸识别
- 腾讯会议
- 企业云
- CDN 加速
- 视频通话
- 医

更多推荐

- 数据安全
- 负载均衡
- 短信
- 文字识别
- 云点播
- 商

Copyright © 2013 – 2023 Tencent Cloud. All Rights Reserved. 腾讯云 版权F
 深圳市腾讯计算机系统有限公司 ICP备案/许可证号：粤B2-20090059 深公网安备号 440:
 腾讯云计算（北京）有限责任公司 京ICP证150476号 | 京ICP备11018762号 | 京公网安备号1'

扫描小程序二维码
清单文章随时读

