

1.5 Backtrader运行中的相关概念



wanggs66

关注

赞赏支持

1.5 Backtrader运行中的相关概念



wanggs66

关注

0.113 2020.04.19 10:37:11 字数 615 阅读 512

Line Iterators

- 策略和指标都是 line 迭代器：迭代 + 命名
- method:
 - next : 每次迭代中运行
 - prenext : 在迭代器最小期间满足之前运行
 - nextstart : 当最小期间满足时调用，默认调用next
 - runonce : 指标批量处理方法，包括once, preonce, oncestart

Minimum Period

- 单一Minimum Period时：如sma = btind.SimpleMovingAverage(self.data, period=25)，需要执行prenext 24 次，然后执行nextstart 1次，在执行next
- 复合Minimum Period时：如


```
sma1 = btind.SimpleMovingAverage(self.data, period=25)
```

```
sma2 = btind.SimpleMovingAverage(sma1, period=20)
```

需要执行prenext 25 + 18 = 43次（第一个指标执行25次后产生第一个sma1，还需要执行18此后才能获得19个sma1）

执行nextstart 1 次

然后执行next

- preonce, oncestart, once 遵循相同的规则

Up and Running

至少需要是三个lines 对象：一个Data feed，一个Strategy，一个Cerebro

Data Feeds

- 支持多种不同类型的数据 feeds, data feeds 支持名称、重采样等属性和操作
- 气质起始日期截断数据，注意包含其实和截止日期

A Strategy (derived) class

- 至少需要两个方法：
 - init : 完成变量初始化计算等功能
 - next : 实现策略的具体逻辑
 - 注意：如果data feeds 在next方法提供了不同频率的数据，则要求主数据（第一个传递给cerebro的数据）拥有最高的频率
- 其他method

热门故事

一个女网红试睡员的自白：一觉醒来我口吐芬芳

果然，没有一个女人能笑着走出老公的手机

男子深夜点外卖备注内容诡异，外卖小哥吓傻

爱情没有先后来后到，但做人要有礼义廉耻

推荐阅读

Python_遍历 list
阅读 336

writeFileSync、existsSync、writeFileSync用法
阅读 345

Delphi计算程序运行时间
阅读 338

Compaction
阅读 74

Swift实现KVO
阅读 260

写下你的评论...

评论0

赞1

...

1.5 Backtrader运行中的相关概念



wanggs66

关注

赞赏支持

notify方法查看

- close: 获取当前的仓位状态, 并关闭订单
- getposition(或者参数'position'): 获取当前 仓位
- setsizer/getsize(或者参数'sizer'): 设置获取默认的stake sizer.

A Cerebro

Cerebro 把 Data Feeds 和 Strategy 等内容组合到一块, 并执行相应的操作

- Cerebro中的默认值:
 1. 默认的broker
 2. 交易中没有手续费
 3. Data Feeds 会预先导入
 4. 默认的执行模式是批量处理模式: 所有指标都支持runonce操作, 如果自定义的指标没有runonce 方法, 能运行但是会影响速度。
- 设定preloading 和 runonce模式: cerebro = bt.Cerebro(runonce=True, preload=True)
- setbroke / getbroker(broker 参数)
- plotting: 可设定想用参数: numfigs, plotter...
- 策略参数优化: cerebro.optstrategy(MyStrategy, period=xrange(10, 20))
cerebro.optstrategy(MyStrategy, period=xrange(10, 20), factor=3.5)



1人点赞 >

Backtrader Learning Notes



更多精彩内容, 就在简书APP



"小礼物走一走, 来简书关注我"

赞赏支持

还没有人赞赏, 支持一下



wanggs66

总资产1 共写了2.0W字 获得13个赞 共18个粉丝

关注

推荐阅读

更多精彩内容 >

Python3.X内置函数

内置函数Python解释器内置了许多功能和类型,总是可用的。他们是按字母顺序列在这里。abs(x)返回一个数的绝...

uagianlap 阅读 830 评论 0 赞 0



写下你的评论...

评论0

赞1

1.5 Backtrader运行中的相关概念



wanggs66

关注

赞赏支持

面试题

Python语言特性 1 Python的函数参数传递 看两个如下例子，分析运行结果: 代码一: a = 1 def...

清清子衿木子水心 阅读 776 评论 0 赞 3

Classes of Python | Python中的类详解

Classes of Python(Version 2.7.13) 全文主要内容翻译自 Python 2.7.13...

只记录自己的声音 阅读 3,635 评论 0 赞 1

随笔

望天远兮意不在，风锁罗兰何以赖。苍穹之下污垢存，生来便乃无为材。

卫凌 阅读 60 评论 0 赞 1

王兴：美团的战争与和平 || 遇见匠人第36篇

(遇见匠人第36篇原创文章) 多元化布局的王兴四处树敌，美团做的越多，敌人就越多。美团发展于团购业务，如今很难用一...

预见匠人 阅读 3,144 评论 0 赞 0



十月中旬的一个晚上

逗留枝头的桂花在冷风中贡献着最后的芬芳。有户人家吵架了，歇斯底里地嘶吼着，惹得一只狗也跟着狗瞎叫起来.....男人嗓门比...

贫尼净根 阅读 19 评论 0 赞 0

英语学习日记2017.06.07

前天做了班长，以前没做过，不知道怎么做，尴尬的。好多基础的句子读不出，好崩溃，再有一个unit就要结束I...

classybaby 阅读 60 评论 0 赞 0

苔花如米小，也学牡丹开

可能是疫情缘故吧，总觉得今年的春天来得有些晚。“但道青春未谢，不知芳径幽深”，猛然一看，春意浓郁之际，苔藓已葱葱郁郁...

眉目存山河 阅读 31 评论 0 赞 2

热门故事

一个女网红试睡员的自白：一觉醒来我口吐芬芳

果然，没有一个女人能笑着走出老公的手机

男子深夜点外卖备注内容诡异，外卖小哥吓傻

爱情没有先后来后到，但做人要有礼义廉耻

推荐阅读

Python_遍历 list 阅读 336

writeFileSync、existsSync、writeFileSync用法 阅读 345

Delphi计算程序运行时间 阅读 338

Compaction 阅读 74

Swift实现KVO 阅读 260



写下你的评论...

评论0

赞1