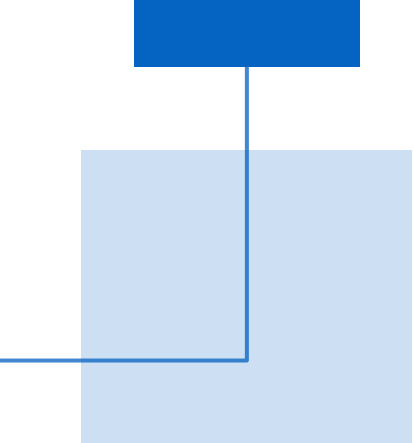


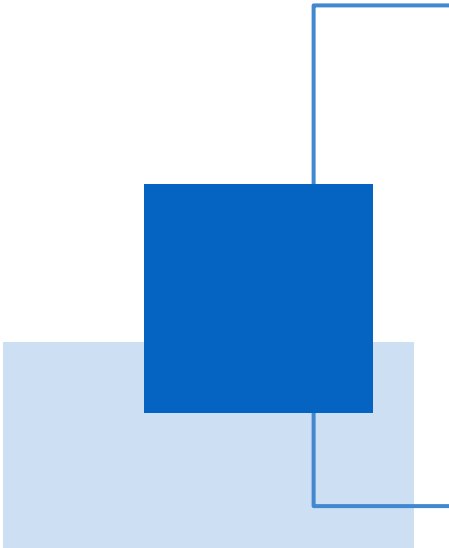
智能金融科技 策略实践-程序化交易2



1

专业回测平台回测练习

(华鑫证券提供仿真回测平台)



账户注册

投资理财 特色交易 量化投资 仿真投教 投资资讯 下载中心 开户 登录 注册 专业版 普通版

技术简化投资

→ 登录 + 注册

注册账号

请输入手机号码

请输入验证码

获取验证码

请输入密码

请再次输入密码

☐ 申请成为专业投资者

☒ 同意 [《N视界用户协议》](#)

确 定

已有账户，马上登录



<https://www.n-sight.com.cn/>

查询回测账户



基本信息

策略研究

我的回测报告

我的基本信息

昵称:

升级专业用户

个性签名:

这个人很懒，什么都没有留下

交易账户

00066882

证券 期权 期货 两融

交易密码

.....

该账号为本N视界账号的默认账号，适用于仿真（支持证券、两融、期权、期货市场）和回测（支持证券、期权市场）场景。[手续费规则说明](#)

回测参数设置

traderapi.ini

#订阅历史行情的起始日期

SubMD_Begin_date=20250324

#订阅历史行情的结束日期

SubMD_End_date=20250328

#用户设置初始资金。如果不设置则使用默认金额10000000

InitMoney=10000000

#是否使用缓存行情，如果不设置则默认使用

UseMDCache=1

#股票佣金费率，如果不设置默认是0.0003（万三）

StockFeeRatio=0.0003

#股票最低佣金金额，如果不设置默认是0元

StockFeeMin=0

#初始持仓需要在InitPosition配置项里设置：设置格式（交易所代码,股票代码,数量）,如果设置多个持仓请用分号分隔，交易所代码1是上海2是深圳。

#例如设置初始持仓上海机场1000股，中富电路1000股。

InitPosition=(1,600009,1000);(2,300814,1000)

启动回测程序

获取账号和API

运行策略

回测案例

成交单回测



上传成交单即可回测

点击进入 →

1. 配置策略回测的初始信息

首先需要在traderapi.ini配置文件中设置回测的初始信息。列如在traderapi.ini文件，配置回测时间段为20190211到20190226，初始资金设置为100000，使用缓存行情。

```
#订阅历史行情的起始日期
SubMD_Begin_date=20190211
#订阅历史行情的结束日期
SubMD_End_date=20190226
#用户设置初始资金。如果不设置则使用默认金额10000000
```

2. 启动策略程序 (C++)

本节将演示如何启动C++策略程序，具体C++代码请查看后面的C++源码展示区：

- 编译C++代码，去生成回测程序“Buy.exe”。
- BackTestApi的mdapi.dll，traderapi.dll两个动态库，traderapi.ini，以及“Buy.exe”都必须存放在同一个目录下面。
- 回测程序使用五个输入命令参数：

回测服务地址 用户名 密码 证券代码 买入日期

例如：

```
Buy.exe tcp://210.14.72.18:26666 user passwd 2_000725 20190211
```

指定证券代码可以定义多个证券，每个证券以“交易所代码_证券代码”形式来定义(交易所代码1是上证,2是深圳),每个证券之间以逗号分隔（比如定义万科A和浦发银行，则是2_000002,1_600000）。

3. 启动策略程序 (Python)

本节将演示如何启动Python策略程序，具体Python代码请查看后面的Python源码展示区：

- 只能在Python3.6环境下运行本策略：
- BackTestApi的python接口包括六部分：mdapi.dll，traderapi.dll，mdPythonAPI.py，_mdPythonAPI.pyd，traderPythonAPI.py，_traderPythonAPI.pyd。使用回测时，mdapi.dll，traderapi.dll，mdPythonAPI.py，_mdPythonAPI.pyd，traderPythonAPI.py，_traderPythonAPI.pyd和traderapi.ini配置文件，都必须和Python源码“Buy.py”放在同一目录下。
- 回测程序使用五个输入命令参数：

回测服务地址 用户名 密码 证券代码 买入日期

例如：

```
Buy.py tcp://210.14.72.18:26666 user passwd 2_000725 20190211
```

Python 要求指定版本

```
python buy.py tcp://210.14.72.18:26666 user passwd
```

回测结果



策略研究

奇点系统

特色交易

投研支持

资产管理

机构合作



专业版 普通版

test1

VS

沪深300

跑赢基准 0 周

市场类型: 股票

回测时间: 2025-04-06 11:24:39

指标说明

-0.30%

回测收益

-15.34%

回测年化收益

0.01%

基准收益

-0.32%

超额收益率

0.49%

样本组合收益

Alpha

-0.1679

Beta

0.0582

Sharpe

--

最大回撤率

0.21%

索提诺比率

-999999.0000

信息比率

-999999.0000

策略波动率

0.0125

基准波动率

0.0655

收益走势图

从 2022-12-12

至

2025-03-28

交易起止: 2025-03-24 至 2025-03-28

策略频率: 每分

期初资金: ¥10,066,100.00

用时: 13.000秒

一周

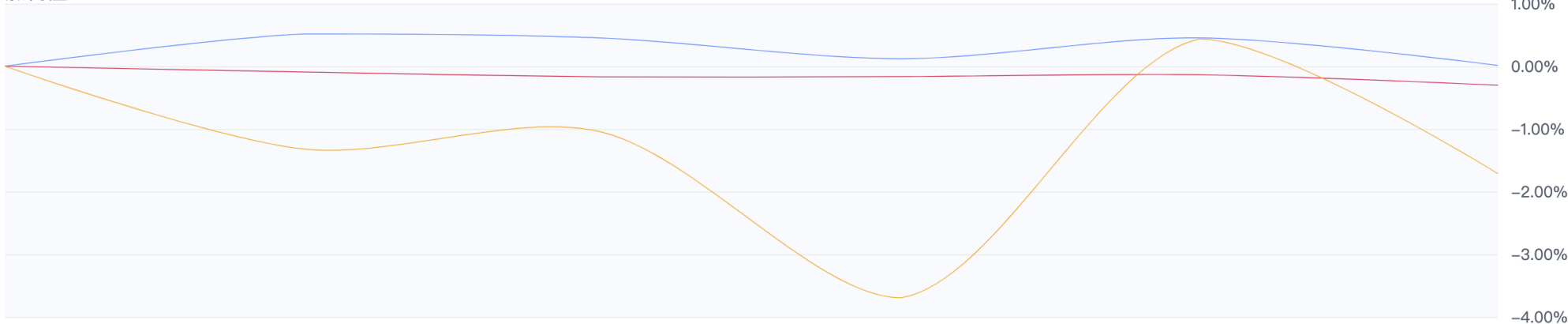
一月

三月

全部

累计收益

沪深300 样本组合收益 累计收益



出口系统

回测结果

回测明细

交易日期: 从 2025-03-24 至 20250328

类别	买入	卖出	盈亏	市值	资产	交易佣金
总计	177.55万	0.00	-3.06万	181.16万	1003.55万	498.78
当月	177.55万	0.00	-3.06万	181.16万	1003.55万	498.78
当日	23.24万	0.00	-1.68万	181.16万	1003.55万	67.22

交易详情

每日持仓

个股详情

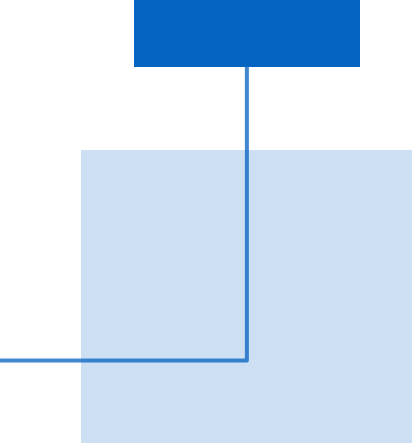
我的订阅

成交

委托

时间	股票代码	买/卖	数量	成交价	成交额	交易佣金	委托单号
09:30:00	123038.SZ (联得转债)	买入	70	162.67	1.14万	0.07	31
09:30:00	300814.SZ (中富电路)	买入	5376	32.50	17.47万	52.42	33
09:30:01	600009.SH (上海机场)	买入	1300	32.72	4.25万	13.61	35
09:30:01	118006.SH (阿拉转债)	买入	30	124.89	3746.61	1.12	37

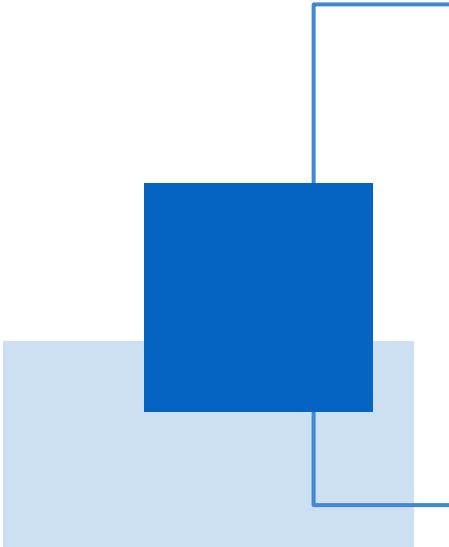
4 笔成交 买入: 23.24万 卖出: 0.00 交易佣金: 67.22



2

交易策略最优参数解算

基于backtrader开源框架



练习2（确保backtrader及相关库已经安装）：

`pip install backtrader`

<https://www.backtrader.com/>
<https://github.com/mementum/backtrader>

注：提高python包的安装效率

`pip install backtrader -i http://mirrors.aliyun.com/pypi/simple/ --trusted-host mirrors.aliyun.com`

修改tutorial_02.py，实现最优参数解算，在output.csv中查看最优参数