2021年1月3日星期日

老师，您好。最近我在使用脚本做回测，采用的是tick回测模式，为了确认数据能正确读取，以及确认可以使用tick正确合成bar，分别在on\_tick下写了print(tick)，在on\_bar下面写了print(bar)，设置时间段为2020年4月1日至2020年7月1日。

结果发现tick数据可以完整打印，但是bar只能打印4月1日至4月2日一共2天的数据，研究了半天实在不知道原因。结果如图所示。

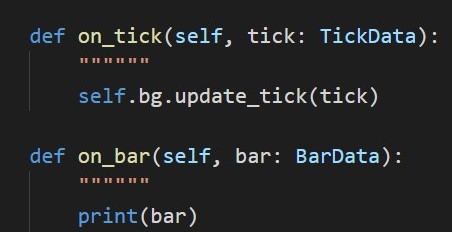
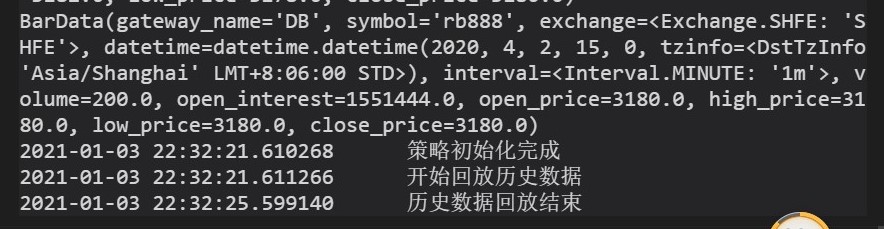
麻烦您请教几个问题：

1. 出现上述问题，可能是什么原因呢？

2. 设置初始化函数为load\_tick(10)，那么在这里，是不是回测引擎会从数据库中读取测试起始时间（即4月1日）前10天的tick数据作为初始化之用？

3. 查看策略中load\_tick函数的具体实现，查找源头的路径大概是：CtaTemplate中的load\_tick函数→cta\_engine中的load\_tick函数。发现cta\_engine中的load\_tick函数中，设置的初始化结束时间为end=datetime.now，那岂不是和自定义的测试时间段对不上？还是说，在回测模式下，系统会自动将这个end设置为回测时间段的起始时间？

4. tick回测模式下，为了完成初始化，是不是要在on\_init下将load\_tick(10)和load\_bar(10)都写上？

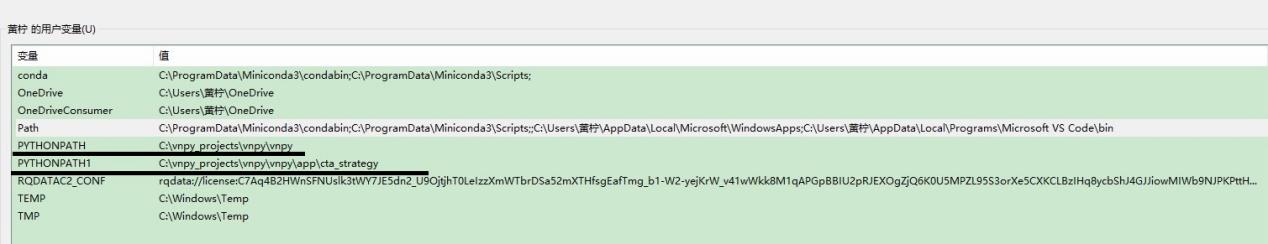
非常感谢！

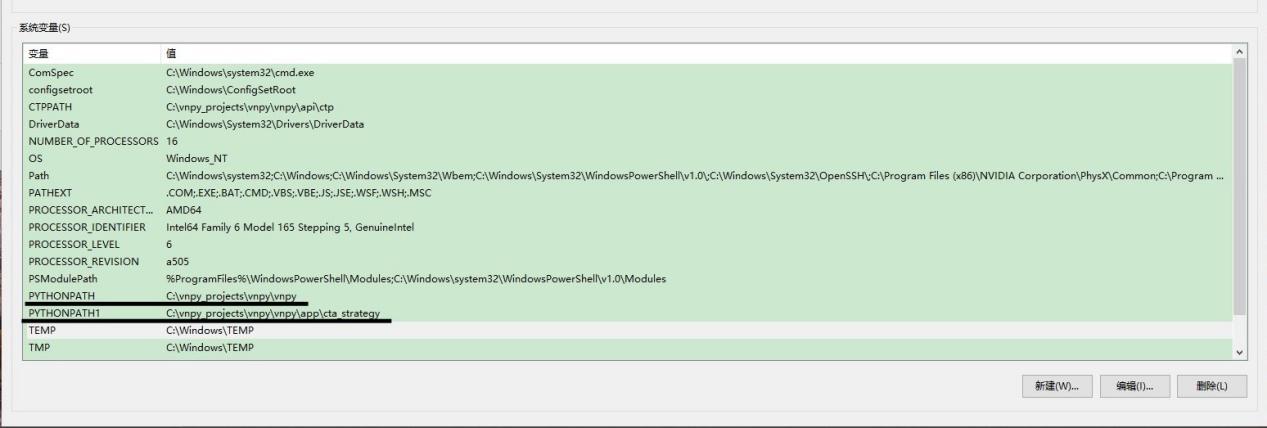
2021年1月19日星期二

两位老师，我找到原因了，但还是再麻烦请教几个问题吧。

不能正确合成bar的原因：系统自动调用的文件夹位置为C:\ProgramData\Miniconda3\Lib\site-packages\vnpy-2.1.7.1-py3.8.egg\vnpy，这个路径应该是手动安装的时候脚本自动生成的。

但我一直以为调用的是我自己设置的路径：C:\vnpy\_projects\vnpy，我把fork过来的vnpy仓库clone到这个文件夹下了。而且安装的时候，我还设置了环境变量。

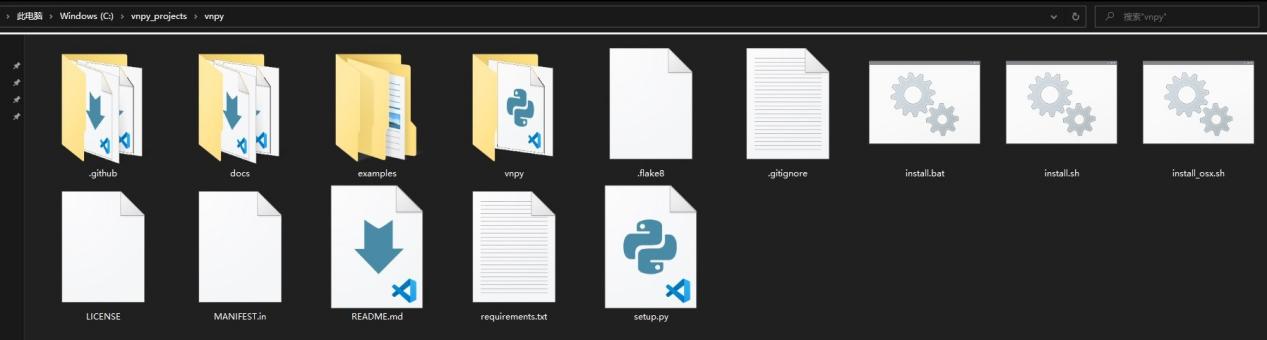




但是这个环境变量貌似没有起作用，所以，无论我怎么更新，系统始终调用的是脚本自动生成的那个旧文件夹。

所以，麻烦问一下：

1. clone过来的文件夹必须放到miniconda中吗？如果只能这样，考虑到github上的vnpy文件夹下面还有一个vnpy文件夹，以及example等其他文件夹，如果直接clone到上面写的那个miniconda下面的路径，好像会有点儿乱，该怎么处理呢？



1. C:\ProgramData\Miniconda3\Lib\site-packages\vnpy-2.1.7.1-py3.8.egg下面除了有vnpy文件夹，还有一个EGG-INFO文件夹，这个文件夹的作用是什么呢？
2. 如果想按照我自己设定的路径（比如：C:\vnpy\_projects\vnpy）来clone，现在应该怎么处理呢？

答：安装这个问题，您自己安装到python环境里了，那么所有的import都会是安装目录里的代码。改过的东西要安装到python环境的site-packages下才能生效了。