**回放撮合相关笔记**

一、回测运行步骤

1.初始化策略

调用on\_init函数

2.回放初始化数据

交易日

3.初始化完成

inited = True

4.启动策略

调用on\_start函数

5.启动完成

trading = True

6.回放数据

new\_bar/new\_tick

new\_bar(self, bar: BarData):

self.bar = bar

        self.datetime = bar.datetime

        self.cross\_limit\_order() # 撮合限价单

        self.cross\_stop\_order() # 撮合停止单

        self.strategy.on\_bar(bar)

        self.update\_daily\_close(bar.close\_price)

注意：

1. self.cross\_limit\_order()和self.cross\_stop\_order()这两个委托函数的先后顺序对运行结果没有影响。

2. 价格撮合函数撮合的是T-1分钟的委托单。

3. 完成T-1分钟的委托撮合之后再推送新的bar给策略的on\_bar函数。

4. 策略在收到T时刻的K线后，生成的委托会缓存在引擎里，直到收到T+1时刻的K线，再开始T时刻发出的委托的撮合。

5. self.update\_daily\_close(bar.close\_price)是用来计算每日收盘价，最终用于逐日盯市计算。

long\_cross\_price 用来判断我的多头委托