二十、K线合成

（一）所有CTA策略都是基于K线的，最基础的是tick数据，然后依次是1分钟K线、N分钟K线、1小时K线、N小时K线。从米筐只下载1分钟K线即可。

（二）K线合成器BarGenerator位于vnpy.trader.utility目录下。最少要填self.on\_bar作为参数。在默认条件下，N分钟K线的N值只能是能整除60的整数，如果要合成其他时间周期的K线，如7分钟K线、9分钟K线等，需要自行对BarGenerator内部代码进行修改。

（三）如果要合成小时K线，需要在参数中加入Interval=ITERVAL.HOUR。

五十、自定义K线合成

（一）定义任意分钟的K线

（二）定义任意秒钟的K线

通过切分时间的方法来减少竞争，是性价比很高的方法，因为如果拼速度肯定拼不过大机构的高频策略，而且高频策略中，大家都是在统一的时间间隔中竞争，不能像在低频策略中这样，可以通过切分独特的时间间隔减少竞争。