

银河启睿策略中心

参数配置

- [参数配置](#)

API 手册

- [入口函数](#)
- [约定函数](#)
- [交易接口](#)
- [仓位查询接口](#)
- [数据查询接口](#)
- [其他接口](#)
- [scheduler 定时器](#)
- [类](#)
 - [Context - 策略上下文](#)
 - [RunInfo - 策略运行信息](#)
 - [Bar - k 线行情](#)
 - [基金bar说明](#)
 - [Tick - 快照行情](#)
 - [Order - 订单](#)
 - [Portfolio - 投资组合](#)
 - [Account - 账户](#)
 - [StockPosition - 股票持仓](#)
 - [FuturePosition - 期货持仓](#)
 - [FundPosition - 基金持仓](#)
 - [Instrument - 交易标的](#)
- [枚举常量](#)

银河启睿策略中心

- »
- 类
- [View page source](#)

类

Context - 策略上下文

class `deepquant.quest.core.strategy_context.StrategyContext`

策略上下文

property `future_account`

期货账户

Return type:

[Account](#)

property `now`

当前 Bar/Tick 所对应的时间

Return type:

`datetime`

property `portfolio`

策略投资组合，可通过该对象获取当前策略账户、持仓等信息

Return type:

[Portfolio](#)

property `run_info`

测略运行信息

Return type:

[RunInfo](#)

property stock_account [¶](#)

股票账户

Return type:

[Account](#)

property universe [¶](#)

在运行 `update_universe()`, `subscribe()` 或者 `unsubscribe()` 的时候，合约池会被更新。

需要注意，合约池内合约的交易时间（包含股票的策略默认会在股票交易时段触发）是`handle_bar`被触发的依据。

Return type:

`Set[str]`

RunInfo - 策略运行信息 [¶](#)

class `deepquant.quest.core.strategy_context.RunInfo`(*config*) [¶](#)

策略运行信息

property commission_multiplier [¶](#)

手续费倍率

Return type:

`float`

property end_date [¶](#)

策略的结束日期

Return type:

`date`

property frequency [¶](#)

'1d'或'1m'

Return type:

`str`

property future_starting_cash [¶](#)

期货账户初始资金

Return type:

`float`

property futures_commission_multiplier [¶](#)

期货手续费倍率

property margin_multiplier [¶](#)

保证金倍率

Return type:

`float`

property matching_type [¶](#)

撮合方式

Return type:

`str`

property run_type [¶](#)

运行类型

Return type:

str

property slippage[¶](#)

滑点水平

Return type:

float

property start_date[¶](#)

策略的开始日期

Return type:

date

property stock_commission_multiplier[¶](#)

股票手续费倍率

property stock_starting_cash[¶](#)

股票账户初始资金

Return type:

float

Bar - k 线行情[¶](#)

class deepquant. quest. model. bar. BarObject(*instrument, data, dt=None*)[¶](#)

Bases: deepquant. quest. model. bar. PartialBarObject

close_price()[¶](#)

[float] 收盘价

high()[¶](#)

[float] 最高价

high_limited()[¶](#)

[float] 涨停价

is_trading()[¶](#)

[bool] 是否有成交量

last_price()[¶](#)

[float] 当前最新价

low_limited()[¶](#)

[float] 跌停价

low_price()[¶](#)

[float] 最低价

market_code()[¶](#)

[str] 交易标的代码

open_interest()[¶](#)

[float] 截止到当前的持仓量（期货专用）

open_price()[¶](#)

[float] 开盘价

`orig_time()`[¶](#)

[datetime.datetime] 时间戳

`prev_close()`[¶](#)

[float] 昨日收盘价

`prev_settlement()`[¶](#)

[float] 昨日结算价（期货专用）

`security_name()`[¶](#)

[str] 合约简称

`settlement()`[¶](#)

[float] 结算价（期货专用）

`total_turnover()`[¶](#)

[float] 截止到当前的成交额

`volume()`[¶](#)

[float] 截止到当前的成交量

基金bar说明[¶](#)

当开启基金mod时 货币基金bar数据新增下列字段 基金的高开低收(high/open/low/close)字段为单位净值(unit_net_value)字段

字段	类型	说明
daily_profit	float	每万元收益（日结型货币基金专用）
weekly_yield	float	7 日年化收益率（日结型货币基金专用）
subscribe_status	str	订阅状态。开放 - Open, 暂停 - Suspended, 限制大额申购 - Limited, 封闭期 - Close
redeem_status	str	赎回状态。开放 - Open, 暂停 - Suspended, 限制大额赎回 - Limited, 封闭期 - Close
subscribe_upper_limit	float	申购上限（金额）
subscribe_lower_limit	float	申购下限（金额）
redeem_lower_limit	float	赎回下限（份额）

Tick - 快照行情[¶](#)

class `deepquant.quest.model.tick.TickObject`(*instrument, tick_dict*)[¶](#)

Bases: `object`

property `ask_vols`[¶](#)

[list] 卖出报盘数量，ask_vols[0]代表盘口卖一档报盘数量

property `asks`[¶](#)

[list] 卖出报盘价格，asks[0]代表盘口卖一档报盘价

property `bid_vols`[¶](#)

[list] 买入报盘数量，bids_vols[0]代表盘口买一档报盘数量

property `bids`[¶](#)

[list] 买入报盘价格，bids[0]代表盘口买一档报盘价

property `high_limited`[¶](#)

[float] 涨停价

property `high_price`[¶](#)

[float] 截止到当前的最高价

property `last_price`[¶](#)

[float] 当前最新价

property `low_limited`[¶](#)

[float] 跌停价

property `low_price`[¶](#)

[float] 截止到当前的最低价

property `market_code`[¶](#)

[str] 标的代码

property `open_interest`[¶](#)

[float] 截止到当前的持仓量（期货专用）

property `open_price`[¶](#)

[float] 当日开盘价

property `orig_time`[¶](#)

[datetime.datetime] 当前快照数据的时间戳

property `prev_close`[¶](#)

[float] 昨日收盘价

property `prev_settlement`[¶](#)

[float] 昨日结算价（期货专用）

property `total_turnover`[¶](#)

[float] 截止到当前的成交额

property `volume`[¶](#)

[float] 截止到当前的成交量

Order - 订单[¶](#)

class `deepquant.quest.model.order.Order`[¶](#)

Bases: `object`

property `avg_price`[¶](#)

[float] 成交均价

property `datetime`[¶](#)

[datetime.datetime] 订单创建时间

property `filled_quantity`[¶](#)

[int] 订单已成交数量

property `frozen_price`[¶](#)

[float] 冻结价格

property `init_frozen_cash`[¶](#)

[float] 冻结资金

property `market_code`[¶](#)

[str] 合约代码

property message[¶](#)

[str] 信息。比如拒单时候此处会提示拒单原因

property order_id[¶](#)

[int] 唯一标识订单的id

Return type:

int

property position_effect[¶](#)

[POSITION_EFFECT] 订单开平（期货专用）

property price[¶](#)

[float] 订单价格，只有在订单类型为'限价单'的时候才有意义

property quantity[¶](#)

[int] 订单数量

property secondary_order_id[¶](#)

[str] 实盘交易中交易所产生的订单ID

property side[¶](#)

[SIDE] 订单方向

Return type:

SIDE

property status[¶](#)

[ORDER_STATUS] 订单状态

property style[¶](#)

[ORDER_STYLE] 订单类型

property trading_datetime[¶](#)

[datetime.datetime] 订单的交易日期（对应期货夜盘）

property transaction_cost[¶](#)

[float] 费用

property type[¶](#)

[ORDER_TYPE] 订单类型

property unfilled_quantity[¶](#)

[int] 订单未成交数量

Portfolio - 投资组合[¶](#)

class deepquant. quest. portfolio. Portfolio(*starting_cash, init_positions, financing_rate, start_date, data_proxy, event_bus*)[¶](#)

Bases: object

投资组合，策略所有账户的集合

property accounts[¶](#)

账户字典

Return type:

Dict[DEFAULT_ACCOUNT_TYPE, [Account](#)]

property annualized_returns[¶](#)

[float] 累计年化收益率

property cash [¶](#)

[float] 可用资金

property cash_liabilities [¶](#)

[float] 现金负债

property daily_pnl [¶](#)

[float] 当日盈亏

property daily_returns [¶](#)

[float] 当前最新一天的日收益

deposit_withdraw(*account_type, amount, receiving_days=0*) [¶](#)

出入金

finance_repay(*amount, account_type*) [¶](#)

融资还款

property frozen_cash [¶](#)

[float] 冻结资金

property future_account [¶](#)

[FutureAccount] 期货账户

property market_value [¶](#)

[float] 市值

property pnl [¶](#)

[float] 收益

property portfolio_value [¶](#)

[Deprecated] 总权益

property positions [¶](#)

[dict] 持仓字典

property start_date [¶](#)

[datetime.datetime] 策略投资组合的开始日期

property starting_cash [¶](#)

[float] 初始资金

property static_unit_net_value [¶](#)

[float] 昨日净值

property stock_account [¶](#)

[StockAccount] 股票账户

property total_returns [¶](#)

[float] 累计收益率

property total_value [¶](#)

[float]总权益

property transaction_cost [¶](#)

[float] 交易成本（税费）

property unit_net_value [¶](#)

[float] 实时净值

property units [¶](#)

[float] 份额

Account - 账户 [¶](#)

class deepquant. quest. portfolio. account. Account(*account_type, total_cash, init_positions, financing_rate*) [¶](#)

账户，多种持仓和现金的集合。

不同品种的合约持仓可能归属于不同的账户，如股票、转债、场内基金、ETF 期权归属于股票账户，期货、期货期权归属于期货账户

property buy_margin [¶](#)

多方向保证金

Return type:

float

property cash [¶](#)

可用资金

Return type:

float

property cash_liabilities [¶](#)

现金负债

Return type:

float

property cash_liabilities_interest [¶](#)

现金负债当日的利息

Return type:

float

property daily_pnl [¶](#)

当日盈亏

Return type:

float

deposit_withdraw(*amount, receiving_days=0*) [¶](#)

出入金

finance_repay(*amount*) [¶](#)

融资还款

property frozen_cash [¶](#)

冻结资金

Return type:

float

get_position(*market_code, direction=POSITION_DIRECTION.LONG*) [¶](#)

获取某个标的的持仓对象

Parameters:

- **market_code** (str) -- 标的编号
- **direction** (POSITION_DIRECTION) -- 持仓方向

Return type:

Position

get_positions()[¶](#)

获取所有持仓对象列表,

Return type:

Iterable[Position]

property management_fees[¶](#)

该账户的管理费用总计

Return type:

float

property market_value[¶](#)

[float] 市值

Return type:

float

property position_equity[¶](#)

持仓总权益

Return type:

float

property position_pnl[¶](#)

昨仓盈亏

Return type:

float

register_management_fee_calculator(*calculator*)[¶](#)

设置管理费用计算逻辑 该方法需要传入一个函数

```
def management_fee_calculator(account, rate):
```

```
    return len(account.positions) * rate
```

```
def init(context):
```

```
    context.portfolio.accounts["STOCK"].set_management_fee_calculator(management_fee_calculator)
```

Return type:

None

property sell_margin[¶](#)

空方向保证金

Return type:

float

set_management_fee_rate(*rate*)[¶](#)

管理费用计算费率

Return type:

None

property total_cash[¶](#)

账户总资金

Return type:

float

property total_value[¶](#)

账户总权益

Return type:

float

property trading_pnl[¶](#)

交易盈亏

Return type:

float

property transaction_cost[¶](#)

总费用

Return type:

float

StockPosition - 股票持仓[¶](#)

class deepquant. quest. mod. mod_sys_accounts. position_model. StockPosition(*market_code, direction, init_quantity=0, init_price=None*)[¶](#)

property avg_price[¶](#)

开仓均价

Return type:

float

property closable[¶](#)

可平仓位

Return type:

int

property daily_pnl[¶](#)

返回该持仓的浮动盈亏

Return type:

float

property direction[¶](#)

返回当前持仓的方向

Return type:

POSITION_DIRECTION

property dividend_receivable[¶](#)

应收分红

Return type:

float

property last_price[¶](#)

当前最新价

Return type:

float

property market_code[¶](#)

返回当前持仓的 market_code

Return type:

str

property market_value[¶](#)

返回当前持仓的市值

Return type:

float

property pnl[¶](#)

返回该持仓的累积盈亏

Return type:

float

property position_pnl[¶](#)

返回当前持仓当日的持仓盈亏

Return type:

float

property prev_close[¶](#)

昨日收盘价

Return type:

float

property quantity[¶](#)

返回当前持仓量

Return type:

int

property today_closable[¶](#)

返回今仓中的可平仓位

Return type:

int

property trading_pnl[¶](#)

返回当前持仓当日的交易盈亏

Return type:

float

FuturePosition - 期货持仓[¶](#)

class deepquant. quest. mod. mod_sys_accounts. position_model. FuturePosition(*market_code, direction, init_quantity=0, init_price=None*)[¶](#)

property avg_price[¶](#)

开仓均价

Return type:

float

property closable[¶](#)

可平仓位

Return type:

int

property daily_pnl[¶](#)

返回该持仓的浮动盈亏

Return type:

float

property direction[¶](#)

返回当前持仓的方向

Return type:

POSITION_DIRECTION

property last_price[¶](#)

当前最新价

Return type:

float

property margin[¶](#)

保证金 = 持仓量 * 最新价 * 合约乘数 * 保证金率

property market_code[¶](#)

返回当前持仓的 market_code

Return type:

str

property market_value[¶](#)

返回当前持仓的市值

Return type:

float

property pnl[¶](#)

返回该持仓的累积盈亏

Return type:

float

property position_pnl[¶](#)

返回当前持仓当日的持仓盈亏

Return type:

float

property prev_close[¶](#)

昨日收盘价

property quantity[¶](#)

返回当前持仓量

Return type:

int

property today_closable[¶](#)

返回今仓中的可平仓位

Return type:

int

property trading_pnl[¶](#)

返回当前持仓当日的交易盈亏

Return type:

float

FundPosition - 基金持仓[¶](#)

class deepquant. quest. mod. mod_fund. position. FundPosition(*market_code, direction, init_quantity=0, init_price=None*)[¶](#)

基金持仓_quantity 预期持仓份额 = 已到账份额 + 未到账份额
_old_quantity _logical_old_quantity + 今日对昨仓的操作
_logical_old_quantity 今日开盘时已到账的份额

property avg_price[¶](#)

开仓均价

Return type:

float

property closable[¶](#)

可平仓位

Return type:

float

property daily_pnl[¶](#)

返回该持仓的浮动盈亏

Return type:

float

property direction[¶](#)

返回当前持仓的方向

Return type:

POSITION_DIRECTION

property dividend_receivable[¶](#)

应收分红

Return type:

float

property equity[¶](#)

净值 = 预期持仓金额 + 赎回金额

property last_price[¶](#)

当前最新价

Return type:

float

property market_code[¶](#)

返回当前持仓的 market_code

Return type:

str

property market_value[¶](#)

返回当前持仓的市值

Return type:

float

property `pnl`[¶](#)

返回该持仓的累积盈亏

Return type:

float

property `position_pnl`[¶](#)

返回当前持仓当日的持仓盈亏

Return type:

float

property `prev_close`[¶](#)

昨日收盘价

Return type:

float

property `quantity`[¶](#)

已到账份额 = 预期持有份额 - 未到账份额

property `receivable_cash`[¶](#)

未到账金额

Return type:

float

property `receivable_quantity`[¶](#)

未到账份额

Return type:

float

property `today_closable`[¶](#)

返回今仓中的可平仓位

Return type:

float

property `trading_pnl`[¶](#)

返回当前持仓当日的交易盈亏

Return type:

float

Instrument - 交易标的[¶](#)

class `deepquant.quest.model.instrument.Instrument`[¶](#)

`market_code`[¶](#)

【str】股票：证券代码，证券的独特的标识符。应以'.SH'或'.SZ'结尾，前者代表上证，后者代表深证。期货：期货代码，期货的独特的标识符（郑商所期货合约数字部分进行了补齐。例如原有代码'ZC609'补齐之后变为'ZC1609'）。主力连续合约 UnderlyingSymbol+88，例如'IF88'；指数连续合约命名规则为UnderlyingSymbol+99

`symbol`[¶](#)

【str】股票：证券的简称，例如'平安银行'。期货：期货的简称，例如'沪深1005'。

`abbrev_symbol`[¶](#)

【str】证券的名称缩写，在中国A股就是股票的拼音缩写，例如：'PAYH'就是平安银行股票的证券名缩写；在期货市场中例如'HS1005'，主力连续合约与指数连续合约都为'null'。

round_lot[🔗](#)

【int】股票：一手对应多少股，中国A股一手是100股。期货：一律为1。

sector_code（股票专用）

【str】板块缩写代码，全球通用标准定义

sector_code_name（股票专用）

【str】以当地语言为标准的板块代码名

industry_code（股票专用）

【str】国民经济行业分类代码，具体可参考下方 “Industry列表”

industry_name（股票专用）

【str】国民经济行业分类名称

listed_date[🔗](#)

【str】股票：该证券上市日期。期货：期货的上市日期，主力连续合约与指数连续合约都为'0000-00-00'。

de_listed_date[🔗](#)

【str】股票：退市日期。期货：交割日期。

type[🔗](#)

【str】合约类型，目前支持的类型有: 'CS', 'INDX', 'LOF', 'ETF', 'FenjiMu', 'FenjiA', 'FenjiB', 'Future'

concept_names（股票专用）

【str】概念股分类，例如：'铁路基建', '基金重仓'等

exchange[🔗](#)

【str】交易所。股票：'SZSE' - 深交所, 'SSE' - 上交所。期货：'DCE' - 大连商品交易所, 'SHFE' - 上海期货交易所, 'CFFEX' - 中国金融期货交易所, 'CZCE'- 郑州商品交易所

board_type（股票专用）

【str】板块类别, 'MainBoard' - 主板,'GEM' - 创业板

status（股票专用）

【str】合约状态。'Active' - 正常上市, 'Delisted' - 终止上市, 'TemporarySuspended' - 暂停上市, 'PreIPO' - 发行配售期间, 'FailIPO' - 发行失败

special_type（股票专用）

【str】特别处理状态。'Normal' - 正常上市, 'ST' - ST处理, 'StarST' - *ST代表该股票正在接受退市警告, 'PT' - 代表该股票连续3年收入为负，将被暂停交易, 'Other' - 其他

contract_multiplier（期货专用）

【float】合约乘数，例如沪深300股指期货的乘数为300.0

underlying_market_code（期货专用）

【str】合约标的代码，目前除股指期货(IH, IF, IC)之外的期货合约，这一字段全部为'null'

underlying_symbol（期货专用）

【str】合约标的名称，例如IF1005的合约标的名称为'IF'

maturity_date（期货专用）

【str】期货到期日。主力连续合约与指数连续合约都为'0000-00-00'

settlement_method（期货专用）

【str】交割方式, 'CashSettlementRequired' - 现金交割, 'PhysicalSettlementRequired' - 实物交割

product（期货专用）

【str】产品类型, 'Index' - 股指期货, 'Commodity' - 商品期货, 'Government' - 国债期货

Instrument对象也支持如下方法：

合约已上市天数：

```
instruments(market_code).days_from_listed()
```

如果合约首次上市交易，天数为0；如果合约尚未上市或已经退市，则天数值为-1

合约距离到期天数：

```
instruments(market_code).days_to_expire()
```

如果策略已经退市，则天数值为-1

最小价格变动单位：

```
instruments(market_code).tick_size()
```

[Next](#) [Previous](#)

© Copyright 2025, Chinastock Last updated on Apr 18, 2025.