银河启睿策略中心

Search docs

参数配置

参数配置

API 手册

- 入口函数
- 约定函数
- 交易接口
 - 。 OrderStyle 订单类型
 - submit order 自由参数下单「通用」
 - o order 智能下单「通用」
 - order to 智能下单「通用」
 - order_shares 指定股数交易
 - o order lots 指定手数交易
 - o order value 指定价值交易
 - <u>order_percent 一定比例下单</u>
 - order_target_value 目标价值下单
 - order target percent 目标比例下单
 - <u>order_target_portfolio</u> 批量调仓
 - buy open(期货期权) 买开
 - o sell close(期货期权) 平买仓
 - <u>sell_open(期货期权) 卖开</u>
 - <u>buy_close(期货期权) 平卖仓</u>
 - o <u>exercise(期权/转债) 行权</u>
 - o cancel order 撤单
 - get open orders 获取未成交订单数据
 - <u>subscribe_value 基金申购指令</u>
 - subscribe_percent 按权重申购基金
 - o subscribe shares 按照份额申购
 - redeem percent 按权重赎回基金
 - o <u>redeem_shares 按份额赎回基金</u>
 - o redeem value 根据赎回总金额计算份额
- 仓位查询接口
- 数据查询接口
- 其他接口
- scheduler 定时器
- 类
- 枚举常量

银河启睿策略中心

- »
- 交易接口
- View page source

交易接口

OrderStyle - 订单类型<mark>1</mark>

```
该类型可供后续下单接口中 price or style 参数使用
```

```
class deepquant.quest.model.order.MarketOrder
```

```
order_shares("000001.SZ", amount=100, price_or_style=MarketOrder())
```

市价单

class deepquant. quest. model. order. LimitOrder(limit_price)1

Parameters:

limit_price (float) -- 价格

```
order_shares("000001.SZ", amount=100, price_or_style=LimitOrder(10))
```

限价单

class deepquant. quest. model. order. TWAPOrder(start_min, end_min)1

Parameters:

- start min (int) -- 分钟起始时间
- end_min (int) -- 分钟结束时间

order_shares("000001.SZ", amount=100, price_or_style=TWAPOrder(931, 945))

算法时间加权价格订单

class deepquant. quest. model. order. VWAPOrder(start min, end min) 1

Parameters:

- start min (int) -- 分钟起始时间
- end min (int) -- 分钟结束时间

```
order_shares("000001.SZ", amount=100, price_or_style=VWAPOrder(931, 945))
```

算法成交量加权价格订单

submit_order - 自由参数下单「通用」<u>1</u>

deepquant.quest.api.submit_order(id or ins, amount, side, price=None, position effect=None)1

通用下单函数,策略可以通过该函数自由选择参数下单。

Parameters:

- id_or_ins (Union[str, Instrument]) -- 下单标的物
- amount (float) -- 下单量, 需为正数
- side (SIDE) -- 多空方向
- price (Optional[float]) -- 下单价格, 默认为None, 表示市价单
- position_effect (Optional[POSITION_EFFECT]) -- 开平方向,交易股票不需要该参数

Example:

```
# 购买 2000 股的平安银行股票,并以市价单发送:
submit_order('000001.SZ', 2000, SIDE.BUY)
# 平 10 份 RB1812 多方向的今仓,并以 4000 的价格发送限价单
submit_order('RB1812', 10, SIDE.SELL, price=4000, position_effect=POSITION_EFFECT.CLOSE_TODAY)
```

Return type:

Optional [Order]

order - 智能下单「通用」<u>1</u>

deepquant. quest. api. order(market_code, quantity, price_or_style=None, price=None, style=None)1

全品种通用智能调仓函数

如果不指定 price, 则相当于下 MarketOrder

如果 market_code 是股票,等同于调用 order_shares

如果 market_code 是期货,则进行智能下单:

- quantity 表示调仓量
- 如果 quantity 为正数,则先平 Sell 方向仓位,再开 Buy 方向仓位
- 如果 quantity 为负数,则先平 Buy 反向仓位,再开 Sell 方向仓位

Parameters:

- market_code (Union[str, Instrument]) -- 下单标的物
- quantity (int) -- 调仓量
- price_or_style (Union[int, float, OrderStyle, None]) -- 默认为None,表示市价单,可设置价格,表示限价单,也可以直接设置订单类型,有如下选项:MarketOrder、LimitOrder、TWAPOrder、VWAPOrder

Example:

```
1 # 当前仓位为0
2 # RB1710 多方向调仓2手: 调整后变为 BUY 2手
3 order('RB1710', 2)
4
5 # RB1710 空方向调仓3手: 先平多方向2手 在开空方向1手, 调整后变为 SELL 1手
6 order('RB1710', -3)
```

Return type:

List[Order]

order_to - 智能下单「通用」<u>1</u>

deepquant.quest.api.order_to(market_code, quantity, price_or_style=None, price=None, style=None)1

全品种通用智能调仓函数

如果不指定 price, 则相当于 MarketOrder

如果 market_code 是股票,则表示仓位调整到多少股

如果 market_code 是期货,则进行智能调仓:

- quantity 表示调整至某个仓位
- quantity 如果为正数,则先平 SELL 方向仓位,再 BUY 方向开仓 quantity 手
- quantity 如果为负数,则先平 BUY 方向仓位,再 SELL 方向开仓 -quantity 手

Parameters:

- market code (Union[str, Instrument]) -- 下单标的物
- quantity (int) -- 调仓量
- price_or_style (Union[int, float, OrderStyle, None]) -- 默认为None,表示市价单,可设置价格,表示限价单,也可以直接设置订单类型,有如下选项:MarketOrder、LimitOrder、TWAPOrder、VWAPOrder

Example:

```
1 # 当前仓位为0
2 # RB1710 调仓至 BUY 2手
3 order_to('RB1710', 2)
4
5 # RB1710 调仓至 SELL 1手
6 order_to('RB1710', -1)
```

Return type:

List Order

order_shares - 指定股数交易¶

deepquant.quest.api.order_shares(id_or_ins, amount, price_or_style=None, price=None, style=None)1

指定股数的买/卖单,最常见的落单方式之一。如有需要落单类型当做一个参量传入,如果忽略掉落单类型,那么默认是市价单(market order)。

Parameters:

- id or ins (Union[str, <u>Instrument</u>]) -- 下单标的物
- amount (int) -- 下单量, 正数代表买入,负数代表卖出。将会根据一手xx股来向下调整到一手的倍数,比如中国A股就是调整成100股的倍数。
- price_or_style (Union[int, float, OrderStyle, None]) -- 默认为None,表示市价单,可设置价格,表示限价单,也可以直接设置订单类型,有如下选项:MarketOrder、LimitOrder、TWAPOrder、VWAPOrder

Example:

```
#购买Buy 2000 股的平安银行股票,并以市价单发送:
order_shares('000001.SZ', 2000)
#卖出2000股的平安银行股票,并以市价单发送:
order_shares('000001.SZ', -2000)
#购买1000股的平安银行股票,并以限价单发送,价格为¥11:
order_shares('000001.SZ', 1000, price_or_style=11)
#购买1000股的平安银行股票,并以限价单发送,价格为¥10:
order_shares('000001.SZ', 1000, price_or_style=LimitOrder(10))
#购买1000股的平安银行股票,并以 9:31 到 9:45 的VWAP价格发送:
order_shares('000001.SZ', 1000, price_or_style=VWAPOrder(931, 945))
```

Return type:

Optional[Order]

order_lots - 指定手数交易<u>1</u>

deepquant.quest.api.order_lots(id_or_ins, amount, price_or_style=None, price=None, style=None)1

指定手数发送买/卖单。如有需要落单类型当做一个参量传入,如果忽略掉落单类型,那么默认是市价单(market order)。

Parameters:

- id_or_ins (Union[str, <u>Instrument</u>]) -- 下单标的物
- amount (int) -- 下单量, 正数代表买入, 负数代表卖出。将会根据一手xx股来向下调整到一手的倍数, 比如中国A股就是调整成100股的倍数。
- price_or_style (Union[int, float, OrderStyle, None]) -- 默认为None,表示市价单,可设置价格,表示限价单,也可以直接设置订单类型,有如下选项:MarketOrder、LimitOrder、TWAPOrder、VWAPOrder

Example:

```
#买入20手的平安银行股票,并且发送市价单:
order_lots('000001.SZ', 20)
#买入10手平安银行股票,并且发送限价单,价格为¥10:
order_lots('000001.SZ', 10, price_or_style=Limit0rder(10))
```

Return type:

Optional[Order]

order_value - 指定价值交易<mark>1</mark>

deepquant.quest.api.order_value(id_or_ins, cash_amount, price_or_style=None, price=None, style=None)1

使用想要花费的金钱买入/卖出股票,而不是买入/卖出想要的股数,正数代表买入,负数代表卖出。股票的股数总是会被调整成对应的100的倍数(在A中国A股市场1手是100股)。 如果资金不足,该API将会使用最大可用资金发单。

需要注意: 当您提交一个买单时,cash_amount 代表的含义是您希望买入股票消耗的金额(包含税费),最终买入的股数不仅和发单的价格有关,还和税费相关的参数设置有关。 当您提交一个卖单时,cash_amount 代表的意义是您希望卖出股票的总价值。如果金额超出了您所持有股票的价值,那么您将卖出所有股票。

Parameters:

- id_or_ins (Union[str, Instrument]) -- 下单标的物
- cash amount (float) -- 需要花费现金购买/卖出证券的数目。正数代表买入,负数代表卖出。
- price_or_style (Union[int, float, OrderStyle, None]) -- 默认为None,表示市价单,可设置价格,表示限价单,也可以直接设置订单类型,有如下选项:MarketOrder、LimitOrder、TWAPOrder、VWAPOrder

Example:

#花费最多¥10000买入平安银行股票,并以市价单发送。具体下单的数量与您策略税费相关的配置有关。order_value('000001.SZ', 10000) #卖出价值¥10000的现在持有的平安银行,以10¥价格发出限价单:order_value('000001.SZ', -10000, price_or_style=10)

Return type:

Optional Order

order_percent - 一定比例下单<u>1</u>

deepquant.quest.api.order_percent(id_or_ins, percent, price_or_style=None, price=None, style=None)1

发送一个花费价值等于目前投资组合(市场价值和目前现金的总和)一定百分比现金的买/卖单,正数代表买,负数代表卖。股票的股数总是会被调整成对应的一手的股票数的倍数(1手是100股)。百分比是一个小数,并且小于或等于1(<=100%),0.5表示的是50%.需要注意,如果资金不足,该API将会使用最大可用资金发单。

需要注意:

发送买单时,percent 代表的是期望买入股票消耗的金额(包含税费)占投资组合总权益的比例。 发送卖单时,percent 代表的是期望卖出的股票总价值占投资组合总权益的比例。

Parameters:

- id or ins (Union[str, Instrument]) -- 下单标的物
- percent (float) -- 占有现有的投资组合价值的百分比。正数表示买入,负数表示卖出。
- price_or_style (Union[int, float, OrderStyle, None]) -- 默认为None,表示市价单,可设置价格,表示限价单,也可以直接设置订单类型,有如下选项: MarketOrder、LimitOrder、TWAPOrder、VWAPOrder

Example:

#花费等于现有投资组合50%价值的现金买入平安银行股票: order_percent('000001.SH', 0.5) #花费等于现有投资组合50%价值的现金买入平安银行股票, 以10¥限价单: order_percent('000001.SH', 0.5, price_or_style=10)

Return type:

Optional[Order]

order_target_value - 目标价值下单<u>1</u>

deepquant.quest.api.order_target_value(id or ins, cash amount, price or style=None, price=None, style=None)1

买入/卖出并且自动调整该证券的仓位到一个目标价值。 加仓时,cash_amount 代表现有持仓的价值加上即将花费(包含税费)的现金的总价值。 减仓时,cash_amount 代表调整仓位的目标价至。

需要注意,如果资金不足,该API将会使用最大可用资金发单。

Parameters:

- id_or_ins (Union[str, Instrument]) -- 下单标的物
- cash amount (float) -- 最终的该证券的仓位目标价值。
- **price_or_style** (Union[float, OrderStyle, None, Tuple, Tuple[Union[int, float, OrderStyle, None]], Tuple[Union[int, float, OrderStyle, None]], Tuple[Union[int, float, OrderStyle, None]]]) -- 默认为None,表示市价单,可设置价格,表示限价单,也可以直接设置订单类型,有如下选项:MarketOrder、LimitOrder、TWAPOrder、VWAPOrder

Example:

#如果现在的投资组合中持有价值¥3000的平安银行股票的仓位,以下代码范例会发送花费 ¥7000 现金的平安银行买单到市场。(向下调整到最接近每手股数即100的倍数的股数): order_target_value('000001.SZ', 10000) #如果现在的投资组合中持有价值¥3000的平安银行股票的仓位,以下代码范例会发送10¥限价单共花费 ¥7000 现金的平安银行买单到市场 #或者如果现在的投资组合中持有价值¥13000的平安银行股票的仓位,以下代码范例会发送11¥限价单共花费 ¥3000 现金的平安银行卖单到市场 order_target_value('000001.SZ', 10000, price_or_style=(10, 11)

Return type:

Optional[Order]

order_target_percent - 目标比例下单1

deepquant.quest.api.order_target_percent(id or ins, percent, price or style=None, price=None, style=None)1

买入/卖出证券以自动调整该证券的仓位到占有一个目标价值。

加仓时,percent 代表证券已有持仓的价值加上即将花费的现金(包含税费)的总值占当前投资组合总价值的比例。 减仓时,percent 代表证券将被调整到的目标价至占当前投资组合总价值的比例。

其实我们需要计算一个position_to_adjust (即应该调整的仓位)

position to adjust = target position - current position

投资组合价值等于所有已有仓位的价值和剩余现金的总和。买/卖单会被下舍入一手股数(A股是100的倍数)的倍数。目标百分比应该是一个小数,并且最大值应该<=1,比如0.5表示50%。

如果 position_to_adjust 计算之后是正的,那么会买入该证券,否则会卖出该证券。需要注意,如果需要买入证券而资金不足,该 API 将使用最大可用资金发出订单。

另外,如果您希望大量调整股票仓位,推荐使用 order_target_portfolio 而非在循环中调取 order_target_percent,前者将拥有更好的性能。

Parameters:

- id_or_ins (Union[str, Instrument]) -- 下单标的物
- percent (float) -- 仓位最终所占投资组合总价值的目标百分比。
- **price_or_style** (Union[float, OrderStyle, None, Tuple, Tuple[Union[int, float, OrderStyle, None]], Tuple[Union[int, float, OrderStyle, None], Union[int, float, OrderStyle, None]]]) -- 默认为None,表示市价单,可设置价格,表示限价单,也可以直接设置订单类型,有如下选项:MarketOrder、LimitOrder、TWAPOrder、VWAPOrder

Example:

#如果投资组合中已经有了平安银行股票的仓位,并且占据目前投资组合的10%的价值,那么以下代码会消耗相当于当前投资组合价值5%的现金买入平安银行股票: order_target_percent('000001.SZ', 0.15) #如果投资组合中已经有了平安银行股票的仓位,并且占据目前投资组合的10%的价值,那么以下代码会消耗相当于当前投资组合价值5%的现金以10¥限价单买入平安银行股票: #或者如果投资组合中已经有了平安银行股票的仓位,并且占据目前投资组合的20%的价值,那么以下代码会消耗相当于当前投资组合价值5%的现金以11¥限价单卖出平安银行股票: order_target_percent('000001.SZ', 0.15, price_or_style=(10, 11))

Return type:

Optional [Order]

order_target_portfolio - 批量调仓<u>1</u>

deepquant.quest.api.order_target_portfolio(*target_portfolio, price_or_styles={}*)<u>¶</u>

批量调整股票仓位至目标权重。注意:股票账户中未出现在 target_portfolio 中的资产将被平仓!

该 API 的参数 target_portfolio 为字典,key 为 market_code 或 instrument,value 为权重。 此时将根据参数 price_or_styles 中设置的价格来计算目标持 仓数量并调仓。

Parameters:

- target portfolio (Dict[str, float]) -- 目标权重字典, key 为 market_code, value 为权重。
- price_or_styles (Dict[str, Union[float, OrderStyle, None, Tuple, Tuple[Union[int, float, OrderStyle, None]], Tuple[Union[int, float, OrderStyle, None]], Union[int, float, OrderStyle, None]]]]) -- 目标下单价格字典, key 为 market_code, value 为价格或订单类型或订单类型和价格组成的 tuple

Example:

```
# 调整仓位,以使平安银行和万科 A 的持仓占比分别达到 10% 和 15%,同时发送市价单
order_target_portfolio({
    \overline{0}000\overline{0}1.\overline{SZ}': 0.1,
    '000002. SZ': 0.15
})
# 调整仓位,分别以 14 和 26 元发出限价单,目标是使平安银行和万科 A 的持仓占比分别达到 10% 和 15%
order_target_portfolio({
    '000001. SZ': 0.1,
    '000002.SZ': 0.15
    '000001. SZ': 14,
   '000002.SZ': 26,
})
# 调整仓位, 使平安银行和万科 A 的持仓占比分别达到 10% 和 15%。
# 其中平安银行的平仓价为 14 元, 开仓价为 15 元; 万科 A 的平仓价为 26 元, 开仓价为 27 元。
order_target_portfolio({
    '000001.SZ': 0.1,
    '000002. SZ': 0.15
    000001.SZ': (15, 14),
   '000002.SZ': (27, 26)
})
```

Return type:

List[Order]

buy_open(期货期权) - 买开¶

deepquant. quest. api. buy_open(id_or_ins, amount, price_or_style=None, price=None, style=None)1

买入开仓。

Parameters:

- id_or_ins (Union[str, <u>Instrument</u>]) -- 下单标的物
- amount (int) -- 下单手数
- price_or_style (Union[int, float, OrderStyle, None]) -- 默认为None,表示市价单,可设置价格,表示限价单,也可以直接设置订单类型,有如下选项:MarketOrder、LimitOrder、TWAPOrder、VWAPOrder

Example:

```
#以价格为3500的限价单开仓买入2张上期所AG1607合约:
buy_open('AG1607', amount=2, price_or_style=3500))
```

Return type:

Union Order, List Order, None

sell_close(期货期权) - 平买仓¶

deepquant. quest. api. sell_close(id or ins, amount, price or style=None, price=None, style=None, close today=False)

平买仓

Parameters:

- id or ins (Union[str, Instrument]) -- 下单标的物
- amount (float) -- 下单手数
- close today (Optional[bool]) -- 是否指定发平今仓单,默认为False,发送平仓单
- price_or_style (Union[int, float, OrderStyle, None]) -- 默认为None,表示市价单,可设置价格,表示限价单,也可以直接设置订单类型,有如下选项:MarketOrder、LimitOrder、TWAPOrder、VWAPOrder

Example:

```
# 以市价单单将现有IF1603买入平仓2张:
sell_close('IF1603', 2, price_or_style=MarketOrder())
```

Return type:

Union[Order, List[Order], None]

sell_open(期货期权) - 卖开¶

deepquant.quest.api.sell_open(id_or_ins, amount, price_or_style=None, price=None, style=None)1

卖出开仓

Parameters:

- id_or_ins (Union[str, Instrument]) -- 下单标的物
- amount (int) -- 下单手数
- price_or_style (Union[int, float, OrderStyle, None]) -- 默认为None,表示市价单,可设置价格,表示限价单,也可以直接设置订单类型,有如下选项:MarketOrder、LimitOrder、TWAPOrder、VWAPOrder

Example:

```
# 以3100发出限价单将现有IF1603卖出开仓2张:
sell_open('IF1603', 2, price_or_style=3100)
```

Return type:

Union[Order, List[Order], None]

buy_close(期货期权) - 平卖仓¶

deepquant.quest.api.buy_close(id_or_ins, amount, price_or_style=None, price=None, style=None, close_today=False)1

平卖仓

Parameters:

- id or ins (Union[str, Instrument]) -- 下单标的物
- amount (int) -- 下单手数
- price_or_style (Union[int, float, OrderStyle, None]) -- 默认为None,表示市价单,可设置价格,表示限价单,也可以直接设置订单类型,有如下选项: MarketOrder、LimitOrder、TWAPOrder、VWAPOrder
- close_today (Optional[bool]) -- 是否指定发平今仓单,默认为False,发送平仓单

```
Example:
```

```
#市价单将现有IF1603空仓买入平仓2张:
buy_close('IF1603', 2)
```

Return type:

Union[Order, List[Order], None]

exercise(期权/转债) - 行权1

```
deepquant.quest.api.exercise(id_or_ins, amount, convert=False)1
```

行权。针对期权、可转债等含权合约,行使合约权利方被赋予的权利。

Parameters:

- id_or_ins (Union[str, Instrument]) -- 行权合约, market_code 或 Instrument 对象
- amount (int) -- 参与行权的合约数量
- convert (Optional[bool]) -- 是否为转股 (转债行权时可用)

Example:

```
# 行使一张豆粕1905购2350的权力
exercise("M1905C2350", 1)
```

Return type:

Optional Order

cancel_order - 撤单<mark>1</mark>

```
deepquant.quest.api.cancel_order(order)1
```

撤单

Parameters:

order (Order) -- 需要撤销的order对象

Return type:

<u>Order</u>

get_open_orders - 获取未成交订单数据¶

```
deepquant.quest.api.get_open_orders()1
```

获取当日未成交订单数据

Return type:

List[Order]

subscribe_value - 基金申购指令¶

deepquant.quest.mod.mod_fund.api.subscribe_value(market_code, cash_amount)1

按申购金额申购基金

Parameters:

- market_code (Union[str, Instrument]) -- 申购基金
- cash_amount (float) -- 申购所用资金

Return type:

Optional[Order]

Returns:

None or Order

Example:

```
# 申购五千块的'华夏成长混合'(000001)
order = subscribe_value('000001', 5000)
assert order.avg_price * order.quantity + order.transaction_cost <= 5000
```

subscribe_percent - 按权重申购基金¶

deepquant.quest.mod.mod_fund.api.subscribe_percent(market_code, percent)1

按账户资金百分比申购基金

file:///D:/Download/order_api.html

7/9

Parameters:

```
• market_code (Union[str, Instrument]) -- 申购基金
```

```
• percent (float) -- 可用资金权重
```

Return type:

```
Optional Order
```

Returns:

None or Order

Example:

```
# 用当前账户资金的20%申购
order = subscribe_percent('000001', 0.2)
```

subscribe_shares - 按照份额申购¶

```
deepquant.quest.mod.mod_fund.api.subscribe_shares(market_code, shares)1
```

按照份额申购

Parameters:

- market_code (Union[str, <u>Instrument</u>]) -- 申购基金
- shares (int) -- 份额

Return type:

```
Optional[Order]
```

Returns:

None or Order

Example:

```
# 申购3000份'华夏成长混合'(000001)
order = subscribe_shares('000001', 3000)
```

redeem_percent - 按权重赎回基金¶

```
deepquant.quest.mod.mod_fund.api.redeem_percent(market_code, percent)1
```

按权重赎回基金,需要根据赎回总金额,计算份额。按比例赎回时,不足0.01份则不赎回

Parameters:

- market code (Union[str, Instrument]) -- 赎回基金
- percent (float) -- 可赎回份额权重

Return type:

```
Optional [Order]
```

Returns:

None or Order

Example:

```
# 赎回20%的'华夏成长混合'(000001)
order = redeem_percent('000001', 0.2)
```

redeem_shares - 按份额赎回基金¶

```
{\tt deepquant.\,quest.\,mod.\,mod\_fund.\,api.\,redeem\_shares} ({\it market\_code,\,shares}) \underline{\mathbb{I}}
```

按份额赎回基金

Parameters:

- market code (Union[str, Instrument]) -- 赎回基金
- shares (float) -- 赎回份额

Return type:

```
Optional[Order]
```

Returns:

None or Order

file:///D:/Download/order_api.html

8/9

Example:

```
# 赎回200份'华夏成长混合'(000001)
order = redeem_shares('000001', 200)
```

redeem_value - 根据赎回总金额计算份额1

deepquant.quest.mod.mod_fund.api.redeem_value(market_code, cash_amount)1

根据赎回总金额计算份额

Parameters:

- market_code (Union[str, <u>Instrument</u>]) -- 赎回基金
- cash_amount (float) -- 赎回金额

Return type:

```
Optional[Order]
```

Returns:

None or Order

Example:

```
# 赎回价值5000块'华夏成长混合'(000001)
order = redeem_value('000001', 5000)
```

Next Previous

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