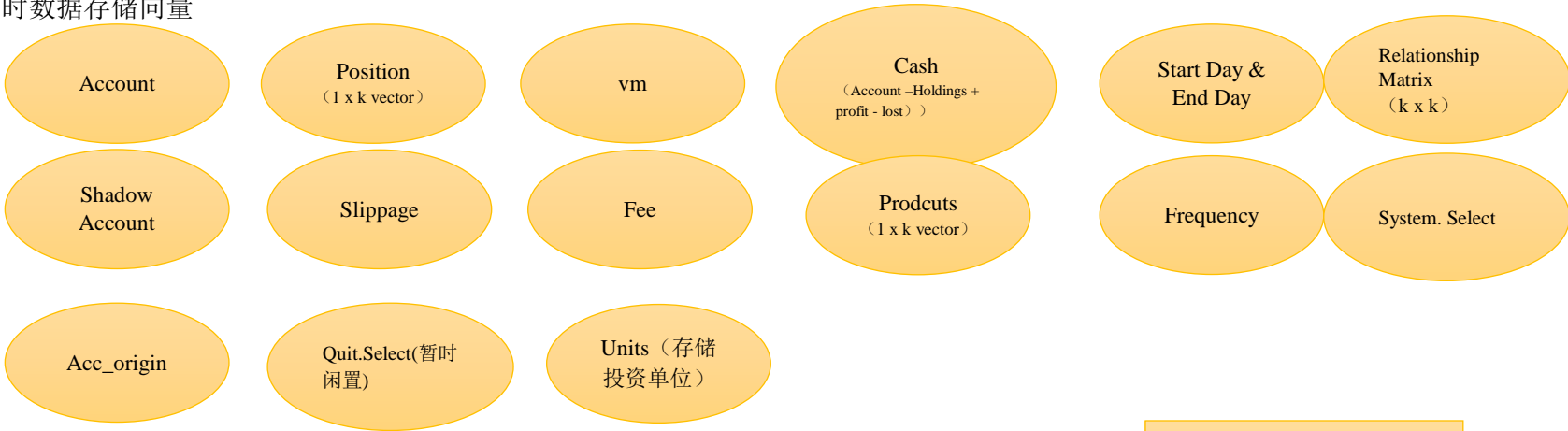


临时数据存储向量



临时数据存储 list

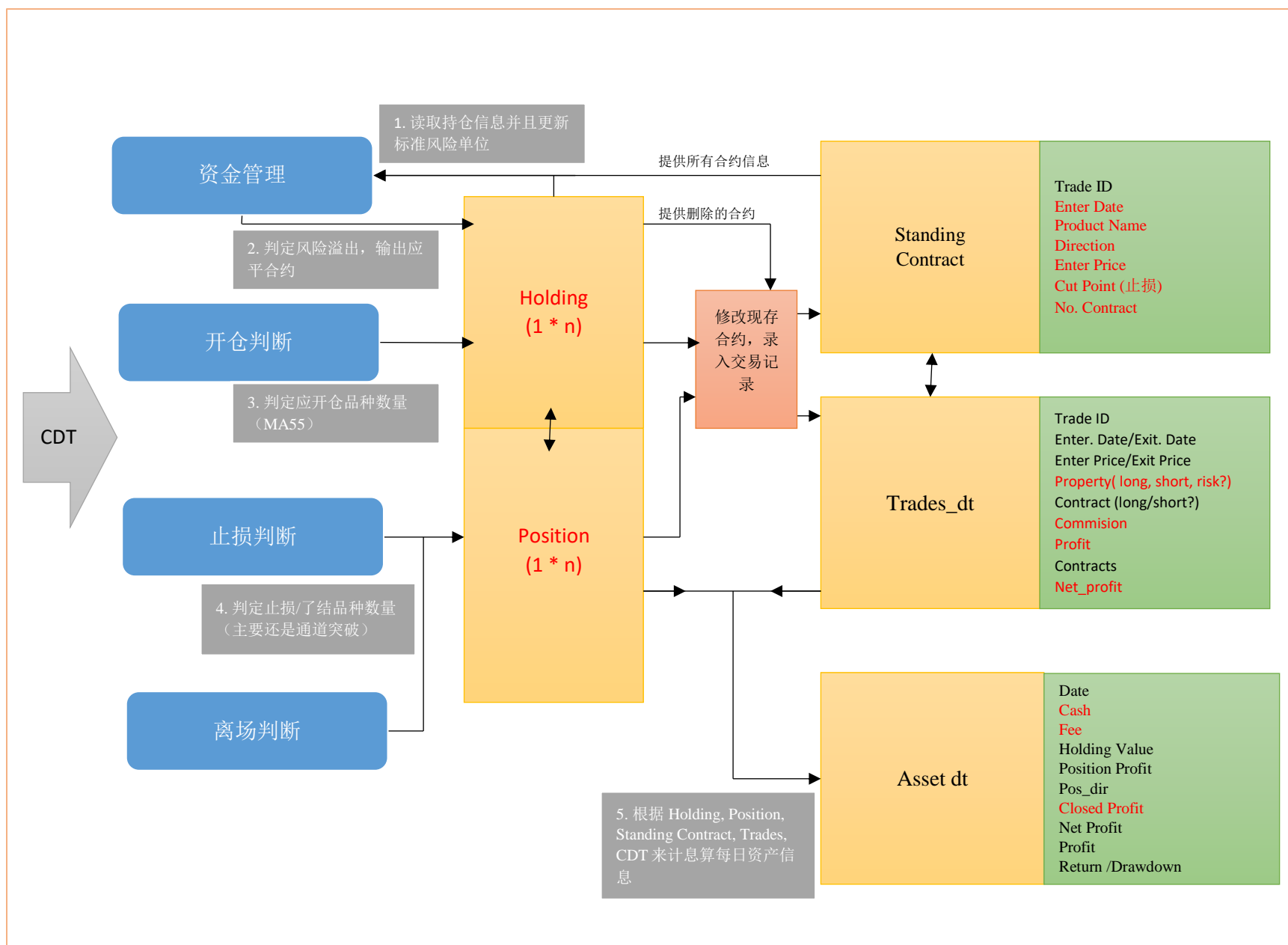
Trade_Out	Update From Standing Contract Enter. Date/Exit. Date Contract (long/short?) Profit/Lost Units (how many contracts) Commissions(双向)
Standing_Contract (临时存储现有合约)	Enter. Date Product.Name Contract (long/short?) Enter.Price Units (how many contracts) Fee (修改, 不计入) Lost cutting

资产表 (更新每日的日期, position (资产总额), closed_profit, position_profit)	Date Holding Value Holding Profit Closed Profit Position profit Fee drawdown
--	--

cdt(data.frame)
存储了所有产品数据
((5+i)*k 列)

Data(list)
存储了所有产品数据

sd



目前遇到比较重大的 Bug:

1. 牵涉到贵金属（低价格，每手合约数很高）的情况下，系统倾向于开很多单，直接导致风控亏损超过风险标准化的设定。
解决方案：找出对应的单然后跑到该循环，看看当时是哪个因素造成了高昂的成本。（slippage 还是单纯的风险分解算错了？）
2. 整个系统目前对于数据质量要求很高，对于中间有缺失的数据容易出现 bug，目前还没能定位到是哪一个环节出的问题，希望在检查问题 1 的时候得到一些启发。
3. 整个开仓其实还是比较随意的，后面要添加进一步的约束来控制开仓，比如从现金/保证金上面进行考量。