量化交易需求文档1.0

模型训练需求

单模型实验

实现单模型的训练和数据回测，得到年化收益率和最大回测值。

模型设置：模型类型，模型位置，模型超参数。

训练数据设置：数据范围设置，因子设置，标签设置。

实验范围：

自定义训练模型，自定义训练数据，自定义回测范围，自定义输出文件，自定义文件位置。

多模型实验

多模型对比

相同数据范围(训练及回测数据设置相同)，不同模型对比。

相同数据范围(训练及回测数据时间范围相同)，训练数据标签设置不同，训练模型相同对比。

不同数据范围，相同模型数据设置，相同回测数据设置。

对比范围：年化收益、最大回测值，回测图像。

实验范围：

自定义多模型模型设置，自定义训练数据，自定义回测范围，自定义输出文件，自定义文件位置，自定义多模型对比设置。

对比设置：

实验输出需求

输出文件命名规则

训练时间\_文件类型\_训练模型\_标签类型

例如：

2022-06-20\_年化收益率\_LSTM\_当天收益率.xlsx

2022-06-20\_LSTM和LightGBM回测对比\_当天收益率.jpg

训练过程

模型存储位置，模型文件，模型收敛图像。

回测过程

年化收益率，最大回测值，回测收益曲线图，最大回测图等回测图像。

文件实现需求

每次训练的训练过程，每次回测的回测图像，每次训练对比的结果。

框架函数需求

功能函数

基础参数存储及调取

调取基础数据设置参数

调取不同模型的基础超参数

模型函数

对比实验设置函数

多实验训练过程设置函数

多实验模型存储设置函数

多实验对比设置函数

输出文件设置函数

设置文件位置

定义文件类型