

一、交易日志截图：

成交编号	委托编号	合约代码	名称	方向	开平	价格	数量	成交时间	接口
158990	8	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3275.2	1	14:59:02	CTP
158752	7	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3275.4	1	14:58:45	CTP
155510	6	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3270.2	1	14:54:02	CTP
151366	5	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3266.4	1	14:46:10	CTP
145413	4	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3274.0	1	14:32:02	CTP
105231	2	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3276.2	1	11:23:53	CTP
99273	1	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3283.0	1	11:11:06	CTP

二、所持资金额截图：

账户	昨结	净值	可用	手续费	保证金	平仓盈亏	持仓盈亏	接口
079240	995611.15	992954.161	599390.161	436.989	393024.0	-2760.0	540.0	CTP

三、统计事项：

1.日交易次数：共3笔。

详细交易过程：

- (1) 买多，输6.8个点
- (2) 买多，输7.6个点
- (3) 买多，胜5.2个点

2.日交易胜率：3笔中赢了1笔，胜率为33.3%。

3.日内交易累积胜点数：5.2

日内交易累积败点数：14.4

日内交易点数总计：输9.2

四、行情交易过程：

刚开始运行时代码有问题，停止运行了。正式运行是在 10:30 之后，所以数据记录少了一部分。



五、交易成败原因：

(1) 可以看出，第一笔的预测结果有误，第二笔和第三笔的预测都是正确的。但是第二笔由于止盈阈值过高，上涨之后没有及时卖出，导致后面直接止损了。

(2) 修改后的模型在测试时性能有了明显改善，但是在实际应用中还是效果不好。之前是太多的出现大涨大跌的预测，现在是预测结果不灵敏，经常连续几分钟始终保持同样的预测结果。所以建仓次数变得比较少。

(3) 之前策略为 14:58 时，还有持仓就交易掉。但在 14:59 分又开了一仓，没有平掉。已对代码进行了修改，14:58 分后不再交易。

六、优化和改进目标：

(1) 预测结果过于平稳，怀疑是 IC 和 IH 的涨跌幅与 IF 的涨跌幅区间不同，导致分类阈值设置的不准确有关。考虑更多的使用 IF 合约，加上前几年的和最近时间的。

(2) 只使用类别加权得分来确定建仓时间过于笼统。需要对策略进行修改，确定更合理的建仓时间。