$ctaLSTM_V2_20161221_fengzp_test002_Report$

一、交易日志截图:

(1)正常交易(包含两笔平昨天的仓)

108831 61 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3309.8 1 14:59:00 CTP 98344 60 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.4 1 14:35:42 CTP 68179 46 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3306.0 1 11:26:24 CTP 66503 45 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3301.8 1 11:21:01 CTP 63739 44 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3302.6 1 11:15:11 CTP 62703 43 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3300.8 1 11:13:01 CTP 61134 42 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.4 1 11:08:18 CTP 60021 41 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3307.2 1 11:04:01 CTP 57473 40 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3300.4 1 10:53:10 CTP 55674 39 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3300.4 1 10:53:10 CTP 55285 38 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3304.6 1 10:46:30 CTP 50960 37 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3308.8 1 10:34:01 CTP 48935 36 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3308.8 1 10:34:01 CTP 48914 33 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3311.8 1 10:26:14 CTP 48914 33 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3311.8 1 10:25:06 CTP 45897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP	(1)正市文物(10日内七十叶八印10)									
98344 60 IF1701 沪深300股指1701 P	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
F1701 沪深300股指1701 平仓 3306.0 1 11:26:24 CTP F1701 沪深300股指1701 平仓 3301.8 1 11:21:01 CTP F1701 沪深300股指1701 平仓 3302.6 1 11:15:11 CTP F1701 沪深300股指1701 平仓 3300.8 1 11:13:01 CTP F1701 沪深300股指1701 平仓 3303.4 1 11:08:18 CTP F1701 沪深300股指1701 平仓 3307.2 1 11:04:01 CTP F1701 沪深300股指1701 平仓 3300.4 1 10:53:10 CTP F1701 沪深300股指1701 平仓 3302.2 1 10:47:52 CTP F1701 沪深300股指1701 平仓 3304.6 1 10:46:30 CTP F1701 沪深300股指1701 平仓 3308.8 1 10:34:01 CTP F1701 沪深300股指1701 平仓 3308.8 1 10:34:01 CTP F1701 沪深300股指1701 平仓 3308.8 1 10:26:14 CTP F1701 沪深300股指1701 平仓 3311.8 1 10:25:06 CTP F1701 沪深300股指1701 平仓 3311.8 1 10:25:06 CTP F1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP F1701 沪深300股指1701 F1701 F1701 PT701 PT701	108831	61	IF1701	沪深300股指1701		平仓	3309.8	1	14:59:00	СТР
F1701 沪深300股指1701 一中仓 3301.8 1 11:21:01 CTP 11:15:11 CTP 日本 11:15:11 日本 11:15:11 CTP 日本 11:15:11 日本 11:15:11 日本 11:15:11 CTP 日本 11:15:11 日本	98344	60	IF1701	沪深300股指1701		开仓	3303.4	1	14:35:42	СТР
F1701 沪深300股指1701 平仓 3302.6 1 11:15:11 CTP 11:4 42 F1701 沪深300股指1701 平仓 3300.8 1 11:13:01 CTP 11:4 42 F1701 沪深300股指1701 平仓 3303.4 1 11:08:18 CTP 11:04:01 CTP 下介7473 10 F1701 沪深300股指1701 平仓 3300.4 1 10:53:10 CTP 10:47:52 CTP 10:47:52 CTP 10:47:52 CTP 10:46:30 CTP 10:46:3	68179	46	IF1701	沪深300股指1701		平仓	3306.0	1	11:26:24	CTP
F1701 沪深300股指1701 一 平仓 3300.8 1 11:13:01 CTP 11:04:01 CTP 11:04:01 CTP では 3303.4 1 11:04:01 CTP では 3307.2 1 11:04:01 CTP では 3307.2 1 11:04:01 CTP 下では 3307.2 1 11:04:01 CTP 下では 3300.4 1 10:53:10 CTP 下では 3300.4 1 10:53:10 CTP 下では 3300.4 1 10:53:10 CTP 下では 3300.4 1 10:47:52 CTP 下では 3304.6 1 10:46:30 CTP 下では 3304.6 1 10:46:30 CTP 下では 3304.6 1 10:34:01 CTP 下では 3308.8 1 10:34:01 CTP 下では 3308.8 1 10:34:01 CTP 下では 3308.8 1 10:26:14 CTP 下では 330	66503	45	IF1701	沪深300股指1701		开仓	3301.8	1	11:21:01	СТР
F1701 沪深300股指1701 平仓 3303.4 1 11:08:18 CTP 11:04:01 CTP 11:04:01 CTP 11:04:01 CTP 11:04:01 CTP 11:04:01 CTP 下分 2300.4 1 10:53:10 CTP 25674 39 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3302.2 1 10:47:52 CTP 25285 38 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3304.6 1 10:46:30 CTP 250960 37 IF1701 沪深300股指1701 开仓 3308.8 1 10:34:01 CTP 248935 36 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3310.8 1 10:26:14 CTP 248914 33 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3311.8 1 10:25:06 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP 25897 2 IF1701 沪深300股指1701 2 IF1701	63739	44	IF1701	沪深300股指1701		平仓	3302.6	1	11:15:11	СТР
### 10:26:14 CTP 10:26:35 CTP 10:26:36 CTP	62703	43	IF1701	沪深300股指1701		开仓	3300.8	1	11:13:01	СТР
57473 40 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3300.4 1 10:53:10 CTP 55674 39 IF1701 沪深300股指1701 开仓 3302.2 1 10:47:52 CTP 55285 38 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3304.6 1 10:46:30 CTP 50960 37 IF1701 沪深300股指1701 开仓 3308.8 1 10:34:01 CTP 48935 36 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3310.8 1 10:26:14 CTP 48914 33 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3311.8 1 10:25:06 CTP 45897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP	61134	42	IF1701	沪深300股指1701		平仓	3303.4	1	11:08:18	СТР
55674 39 IF1701 沪深300股指1701 开仓 3302.2 1 10:47:52 CTP 55285 38 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3304.6 1 10:46:30 CTP 50960 37 IF1701 沪深300股指1701 开仓 3308.8 1 10:34:01 CTP 48935 36 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3310.8 1 10:26:14 CTP 48914 33 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3311.8 1 10:25:06 CTP 45897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP	60021	41	IF1701	沪深300股指1701		开仓	3307.2	1	11:04:01	СТР
55285 38 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3304.6 1 10:46:30 CTP 50960 37 IF1701 沪深300股指1701 开仓 3308.8 1 10:34:01 CTP 48935 36 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3310.8 1 10:26:14 CTP 48914 33 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3311.8 1 10:25:06 CTP 45897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP	57473	40	IF1701	沪深300股指1701		平仓	3300.4	1	10:53:10	СТР
50960 37 IF1701 沪深300股指1701 开仓 3308.8 1 10:34:01 CTP 48935 36 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3310.8 1 10:26:14 CTP 48914 33 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3311.8 1 10:25:06 CTP 45897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP	55674	39	IF1701	沪深300股指1701		开仓	3302.2	1	10:47:52	СТР
48935 36 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3310.8 1 10:26:14 CTP 48914 33 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3311.8 1 10:25:06 CTP 45897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP	55285	38	IF1701	沪深300股指1701		平仓	3304.6	1	10:46:30	СТР
48914 33 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3311.8 1 10:25:06 CTP 45897 2 IF1701 沪深300股指1701 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP	50960	37	IF1701	沪深300股指1701		开仓	3308.8	1	10:34:01	СТР
45897 2 IF1701 沪深300股指1701 多 平仓 3303.8 1 10:06:35 CTP	48935	36	IF1701	沪深300股指1701		平仓	3310.8	1	10:26:14	СТР
	48914	33	IF1701	沪深300股指1701		平仓	3311.8	1	10:25:06	СТР
45565 1 JE1701 沪深300股指1701 开仓 3298.6.1 10:05:02 CTP	45897	2	IF1701	沪深300股指1701		平仓	3303.8	1	10:06:35	СТР
45505 I IIIII // // // // // // // // // // /	45565	1	IF1701	沪深300股指1701	空	开仓	3298.6	1	10:05:02	СТР

(2) 非正常交易(代码有误,导致开仓之后立即平仓,已改正)

70109	59	IF1701	沪深300股指1701		平仓	3306.4 1	13:23:14	CTP
70107	58	IF1701	沪深300股指1701		开仓	3306.4 1	13:23:02	CTP
70105	57	IF1701	沪深300股指1701		平仓	3307.0 1	13:22:54	СТР
70092	56	IF1701	沪深300股指1701		开仓	3307.0 1	13:21:01	СТР
70048	55	IF1701	沪深300股指1701		平仓	3306.0 1	13:15:33	СТР
70023	54	IF1701	沪深300股指1701		开仓	3309.4 1	13:13:01	СТР
70002	53	IF1701	沪深300股指1701		平仓	3308.6 1	13:10:02	СТР
70001	52	IF1701	沪深300股指1701		开仓	3309.0 1	13:10:01	СТР
69997	51	IF1701	沪深300股指1701		平仓	3308.6 1	13:09:07	СТР
69961	50	IF1701	沪深300股指1701		开仓	3308.6 1	13:03:01	СТР
69945	49	IF1701	沪深300股指1701		平仓	3308.6 1	13:01:01	СТР
69943	48	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3308.6 1	13:00:59	СТР

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	996828.3	996113.6769	994973.6769	1854.6231		1140.0		СТР

三、统计事项:

1.日交易次数: 只统计正常交易的,并且不包括平昨天的仓,共7笔。

详细交易过程:

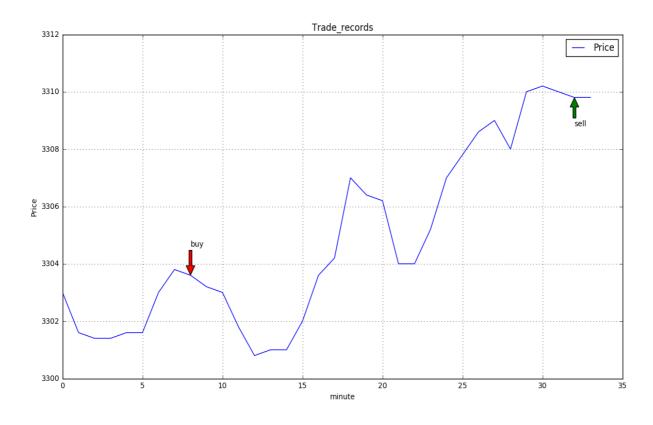
- (1) 买空,输5.2个点
- (2) 买空,胜4.2个点
- (3) 买多,输1.8个点
- (4) 买多,输3.8个点
- (5) 买多,胜1.8个点
- (6) 买多,胜4.2个点
- (7) 买多, 胜 6.4 个点

2.日交易胜率: 7 笔中赢了 4 笔, 胜率为 57.1%.

3.日内交易累积胜点数: 16.6 日内交易累积败点数: 10.8 日内交易点数总计: 胜 5.8

四、行情交易过程:

上午程序中保存数据和交易记录的代码有问题,直到交易不正常强制停止策略时才发现。修复后只有一笔交易产生,所以只获得了今天的部分数据。明天的交易报告中贴出全部的交易记录图。



五、交易成败原因:

止盈策略编写的有错误,更新止盈指数的方向反了,以至于到后面开仓即止盈。现在持仓时间提高了 一些,也不会有持多仓和交易失败的情况了。

六、优化和改进目标:

其他方面已没有重大问题出现,下一步只要能够优化预测模型,提高预测精度,策略就可以用了。 已重新选取数据并做好了数据处理,明天进行训练集和测试集的选取,做训练。在代码中加入直观显 示预测准确性和当前涨跌情况的部分。