

ctaLSTM_V1_20161220_fengzp_test001_Report

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
134987	39	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3261.8	1	14:51:49	CTP
134239	38	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3261.6	1	14:50:07	CTP
133879	37	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3262.0	1	14:49:46	CTP
132970	35	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3261.4	1	14:48:58	CTP
130208	36	IF1701	沪深300股指1701	多	平仓	3264.2	1	14:48:08	CTP
127829	26	IF1701	沪深300股指1701	空	开仓	3263.2	1	14:47:11	CTP
124304	32	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3258.4	1	14:39:07	CTP
123321	31	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3260.6	1	14:36:04	CTP
121421	30	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3258.0	1	14:32:25	CTP
119947	29	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3253.4	1	14:28:18	CTP
84096	25	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3278.0	1	11:29:02	CTP
81924	24	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3278.8	1	11:23:01	CTP
81111	1	IF1701	沪深300股指1701	空	开仓	3284.8	1	11:20:04	CTP
79801	23	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3282.8	1	11:16:01	CTP
79452	22	IF1701	沪深300股指1701	多	平仓	3279.0	1	11:15:01	CTP
79341	10	IF1701	沪深300股指1701	空	开仓	3279.0	1	11:14:41	CTP
78192	19	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3269.6	1	11:10:21	CTP
73194	18	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3269.4	1	10:57:08	CTP
72467	17	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3260.4	1	10:54:02	CTP
71379	16	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3264.2	1	10:50:21	CTP
68345	14	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3265.2	1	10:42:01	CTP
66986	13	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3270.0	1	10:38:01	CTP
64412	9	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3278.2	1	10:25:03	CTP
64394	8	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3280.4	1	10:22:05	CTP
64383	7	IF1701	沪深300股指1701	多	平仓	3280.2	1	10:20:09	CTP
64371	6	IF1701	沪深300股指1701	空	开仓	3280.0	1	10:19:01	CTP
64361	5	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3276.4	1	10:18:24	CTP
64316	4	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3274.8	1	10:15:01	CTP
62168	3	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3280.8	1	10:10:07	CTP
58411	2	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3279.0	1	10:06:01	CTP

二、所持资金截图：

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	1000000.0	996828.2836	212867.7796	1971.7164	391584.0	-1680.0	480.0	CTP

三、统计事项：

1.日交易次数：14 笔

详细交易过程：

- (1) 买多，胜 1.8 个点
- (2) 买多，胜 1.6 个点
- (3) 买空，输 0.2 个点
- (4) 买多，输 2.2 个点
- (5) 买多，输 4.8 个点
- (6) 买多，输 3.8 个点
- (7) 买多，胜 0.2 个点
- (8) 买空，持平
- (9) 买多，输 0.8 个点
- (10) 买多，胜 4.6 个点
- (11) 买多，输 2.2 个点
- (12) 买空，输 1.0 个点
- (13) 买多，胜 0.6 个点
- (14) 买多，胜 0.2 个点

2.日交易胜率：考虑到手续费，将不赢不亏的交易视为亏。14 笔中赢了 6 笔，胜率为 43%。

3.日内交易累积胜点数：9.0

日内交易累积败点数：15.0

日内交易点数总计：-6.0

四、行情交易过程：

因为程序中没有写保存数据和交易记录的代码，所以没有画图的依据。在“东方财富”网站上下载了今日的行情走势图如下。明天的交易报告中贴出交易记录图。



五、交易成败原因：

- 1.交易有些频繁。感觉是预测分类的结果问题，正常应该是预测平稳占大多数，但在平台上跑会有很多的大涨大跌趋势出现。
- 2.预测准确性不足，对上涨下跌趋势不能做出很好的判断。
- 2.代码编写不完善，出现了开多仓的问题，导致委托编号排序不正确，并且在 11:20 左右连开了三次仓。最后由于没有进行人工平仓，导致还持有两手仓。

六、优化和改进目标：

- 1.最主要解决的应该是预测模型的问题。增加训练样本，从时间跨度和合约种类等方面考虑，尤其是加入前面几天的 tick 数据，它们能对当前形势的判断产生较大的影响。同时在策略中能够实时显示预测准确度。
- 2.继续修改策略代码，解决开多仓和撤单的问题。
- 3.预测模型分成了五个，在紫金平台上无法上传多个支持文件。还需要将五分钟的预测合并为一个模型。