

ctaLSTM_V5_20170109_fengzp_test011_Report

注：此次数据来源于 4 点之后的回测数据。

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
2296	12	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3341.4	1	19:37:58	CTP
2056	11	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3339.2	1	19:09:01	CTP
2049	10	IF1701	沪深300股指1701	多	平仓	3337.6	1	19:08:00	CTP
1985	9	IF1701	沪深300股指1701	空	开仓	3342.2	1	19:01:02	CTP
1976	8	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3335.8	1	19:00:00	CTP
1925	7	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3337.2	1	18:55:12	CTP
1906	6	IF1701	沪深300股指1701	多	平仓	3336.8	1	18:53:01	CTP
1859	5	IF1701	沪深300股指1701	空	开仓	3337.4	1	18:48:00	CTP
1843	4	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3337.8	1	18:47:00	CTP
905	3	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3336.8	1	17:37:00	CTP
830	2	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3342.2	1	17:31:02	CTP
578	1	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3338.4	1	17:11:00	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	981906.74	984305.4158	981065.4158	841.3242		3240.0		CTP

三、统计事项：

1.日交易次数：共 6 笔。

详细交易过程：

- (1) 买多，赢 3.8 个点
- (2) 买多，赢 1 个点
- (3) 买空，赢 0.6 个点
- (4) 买多，输 1.4 个点
- (5) 买空，赢 4.6 个点
- (6) 买多，赢 2.2 个点

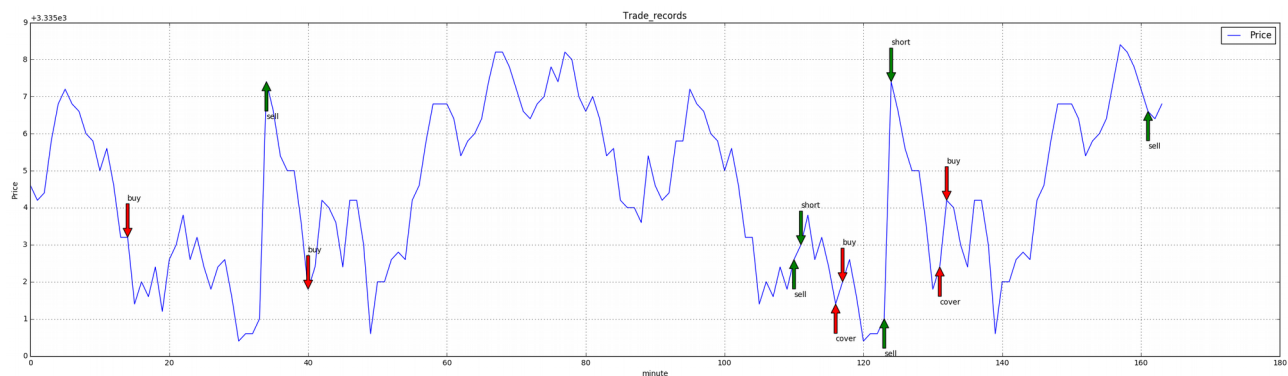
2.日交易胜率：6 笔中赢了 5 笔，胜率为 83%。

3.日内交易累积胜点数：12.2

日内交易累积败点数：1.4

日内交易点数总计：赢 10.8

四、行情交易过程：



五、交易成败原因：

多数的大涨大跌点都捕捉到了，开仓基本都在峰值处，所以盈利较多。

六、优化和改进目标：

虽然本次实盘跑的效果不错，但应用在紫金平台回测上效果不理想。分析是训练分类过于主观，不够合理。下一步利用移动平均线的预测作为分类标准，试试看效果如何。