ctaLSTM_V2_20161223_fengzp_test004_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
158990	8	IF1701	沪深300股指1701		开仓	3275.2	1	14:59:02	СТР
158752	7	IF1701	沪深300股指1701		平仓	3275.4	1	14:58:45	СТР
155510	6	IF1701	沪深300股指1701		开仓	3270.2	1	14:54:02	СТР
151366	5	IF1701	沪深300股指1701		平仓	3266.4	1	14:46:10	СТР
145413	4	IF1701	沪深300股指1701		开仓	3274.0	1	14:32:02	СТР
105231	2	IF1701	沪深300股指1701		平仓	3276.2	1	11:23:53	СТР
99273	1	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3283.0	1	11:11:06	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	995611.15	992954.161	599390.161	436.989	393024.0	-2760.0	540.0	СТР	

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

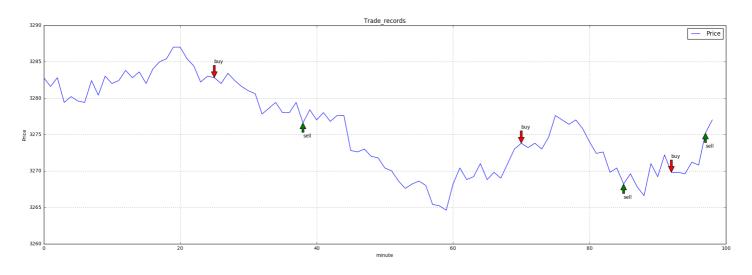
(3) 买多,胜5.2个点

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。