

## ctaLSTM\_V5\_20170110\_fengzp\_test012\_Report

## 一、交易日志截图：

委托编号	合约代码	名称	方向	开平	价格	委托数量	成交数量	状态	委托时间
21	IF1701	沪深300股指1701	多	平仓	3344.8	1	1	全部成交	14:58:00
20	IF1701	沪深300股指1701	空	开仓	3343.2	1	1	全部成交	14:57:01
19	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3344.4	1	1	全部成交	14:56:00
18	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3347.0	1	1	全部成交	14:37:00
17	IF1701	沪深300股指1701	多	平仓	3347.8	1	1	全部成交	14:36:01
16	IF1701	沪深300股指1701	空	开仓	3350.4	1	1	全部成交	14:33:01
15	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3349.6	1	1	全部成交	14:32:00
14	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3349.8	1	1	全部成交	14:27:00
13	IF1701	沪深300股指1701	多	平仓	3350.0	1	1	全部成交	14:26:00
12	IF1701	沪深300股指1701	空	开仓	3352.2	1	1	全部成交	14:22:01
11	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3351.2	1	1	全部成交	14:21:00
10	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3353.8	1	1	全部成交	14:18:00
9	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3353.4	1	1	全部成交	13:57:02
8	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3353.0	1	1	全部成交	13:52:01
6	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3352.2	1	1	全部成交	13:32:46
5	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3346.8	1	1	全部成交	10:20:00
4	IF1701	沪深300股指1701	多	平仓	3348.8	1	1	全部成交	10:17:01
3	IF1701	沪深300股指1701	空	开仓	3350.0	1	1	全部成交	10:04:01
2	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3349.2	1	1	全部成交	10:03:01
1	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3353.4	1	1	全部成交	09:56:00

## 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	979483.01	978496.3127	978076.3127	1406.6973		420.0		CTP

## 三、统计事项：

1.日交易次数：共 10 笔。

详细交易过程：

- (1) 买多，输 4.2 个点
- (2) 买空，赢 1.2 个点
- (3) 买多，赢 5.4 个点
- (4) 买多，赢 0.4 个点
- (5) 买多，输 2.6 个点
- (6) 买空，赢 2.2 个点
- (7) 买多，输 0.2 个点

(8) 买空，赢 2.6 个点

(9) 买多，输 2.6 个点

(10) 买空，输 1.6 个点

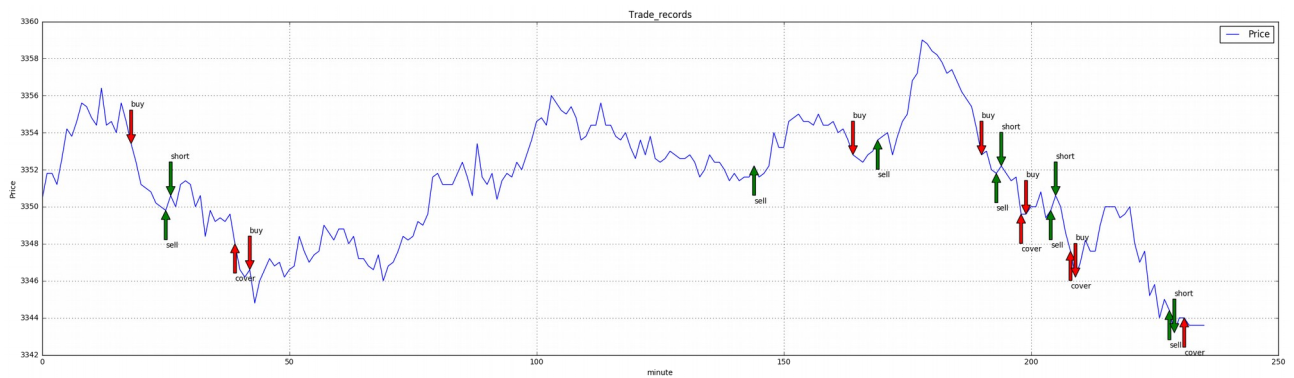
2. 日交易胜率：10 笔中赢了 5 笔，胜率为 50%.

3. 日内交易累积胜点数：11.8

日内交易累积败点数：11.2

日内交易点数总计：赢 0.6

#### 四、行情交易过程：



#### 五、交易成败原因：

比昨天的预测结果相差很多，趋势预测正确的只在一半左右。

#### 六、优化和改进目标：

因为用的是和昨天同样的策略，所以依然是训练分类过于主观，不够合理的问题。