

一、交易日志截图：

(1)正常交易（包含两笔平昨天的仓）

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
108831	61	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3309.8	1	14:59:00	CTP
98344	60	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3303.4	1	14:35:42	CTP
68179	46	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3306.0	1	11:26:24	CTP
66503	45	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3301.8	1	11:21:01	CTP
63739	44	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3302.6	1	11:15:11	CTP
62703	43	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3300.8	1	11:13:01	CTP
61134	42	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3303.4	1	11:08:18	CTP
60021	41	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3307.2	1	11:04:01	CTP
57473	40	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3300.4	1	10:53:10	CTP
55674	39	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3302.2	1	10:47:52	CTP
55285	38	IF1701	沪深300股指1701	多	平仓	3304.6	1	10:46:30	CTP
50960	37	IF1701	沪深300股指1701	空	开仓	3308.8	1	10:34:01	CTP
48935	36	IF1701	沪深300股指1701	多	平仓	3310.8	1	10:26:14	CTP
48914	33	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3311.8	1	10:25:06	CTP
45897	2	IF1701	沪深300股指1701	多	平仓	3303.8	1	10:06:35	CTP
45565	1	IF1701	沪深300股指1701	空	开仓	3298.6	1	10:05:02	CTP

(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	多	平仓	3306.4	1	13:23:14	CTP
70107	58	IF1701	沪深300股指1701	空	开仓	3306.4	1	13:23:02	CTP
70105	57	IF1701	沪深300股指1701	多	平仓	3307.0	1	13:22:54	CTP
70092	56	IF1701	沪深300股指1701	空	开仓	3307.0	1	13:21:01	CTP
70048	55	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3306.0	1	13:15:33	CTP
70023	54	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3309.4	1	13:13:01	CTP
70002	53	IF1701	沪深300股指1701	多	平仓	3308.6	1	13:10:02	CTP
70001	52	IF1701	沪深300股指1701	空	开仓	3309.0	1	13:10:01	CTP
69997	51	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3308.6	1	13:09:07	CTP
69961	50	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3308.6	1	13:03:01	CTP
69945	49	IF1701	沪深300股指1701	空	平仓	3308.6	1	13:01:01	CTP
69943	48	IF1701	沪深300股指1701	多	开仓	3308.6	1	13:00:59	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	996828.3	996113.6769	994973.6769	1854.6231		1140.0		CTP

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%.

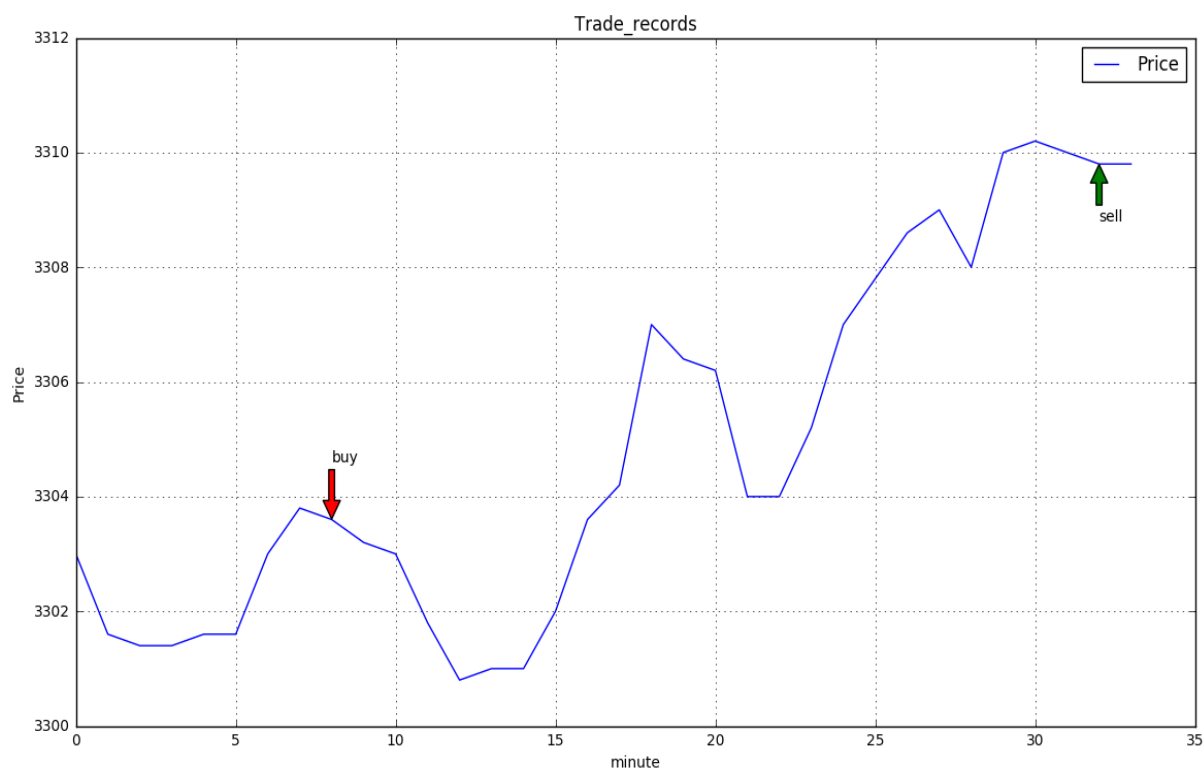
3.日内交易累积胜点数：16.6

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。