模型调试中发现的一些问题

2010-01-21 MorGold Data Analysis Team Huang, Peng

在模型调试过程中对模型的细致分析，发现了以下一些问题：

1 止盈出场的表现：

* 如果2档止盈加保单出场，一笔盈利如果回撤到保单，则止盈出场。(合理)。
* 如果以收盘价判断模型是否出场，此震荡可能被忽略。

2 固定时间突破：

* 同一分钟内如果震荡较大，有可能导致同一时间点上同时出现B和S信号，模型设计时对于此种情况采用不进场的方式，实际操作中需要分析有可能出现的冲突点。

3 波幅突破

* 存在多次进场和一次进场的问题。
* 存在进场点唯一，容易被大幅震荡影响。

上述问题1、2是由于1分钟k线包含信息的局限性造成的。