ForexRennen-Newsletter 5 – 08.04.2025

Liebe Leser,

es tut sich etwas.

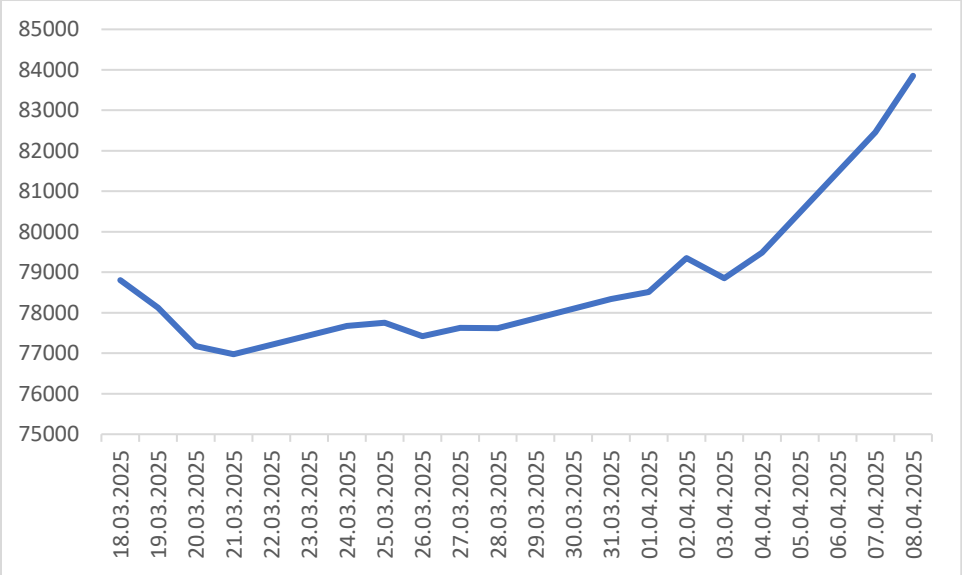
Wir fahren bei unserer Entwicklung zweigleisig. Erstens haben wir ein recht einfaches Programm in der Hoffnung, damit schnell ein erstes einsatzfähiges Modell zu bekommen. Und zweites gibt es das große Programm, das nach einer gründlichen Aufbereitung der Daten Schritt für Schritt erweitert wird.

Das einfache Modell scheint an seine Grenzen zu stoßen. Andere Parameter oder Verlustfunktionen (die Art, wie bei der Modellanpassung die Abweichungen zwischen Prognosen und zu prognostizierenden Werten berechnet werden) führen nicht mehr zu Verbesserungen in der Simulation.

Allerdings läuft das Demokonto seit dem letzten Update mit dem einfachen Modell am 18.03. schon ganz erfreulich, siehe unten. Insbesondere hatte das große Chaos an den Märkten keinerlei negative Auswirkungen auf den Handel, obwohl anzunehmen ist, dass sich die Kurse derweil nicht wie sonst meist verhalten haben.

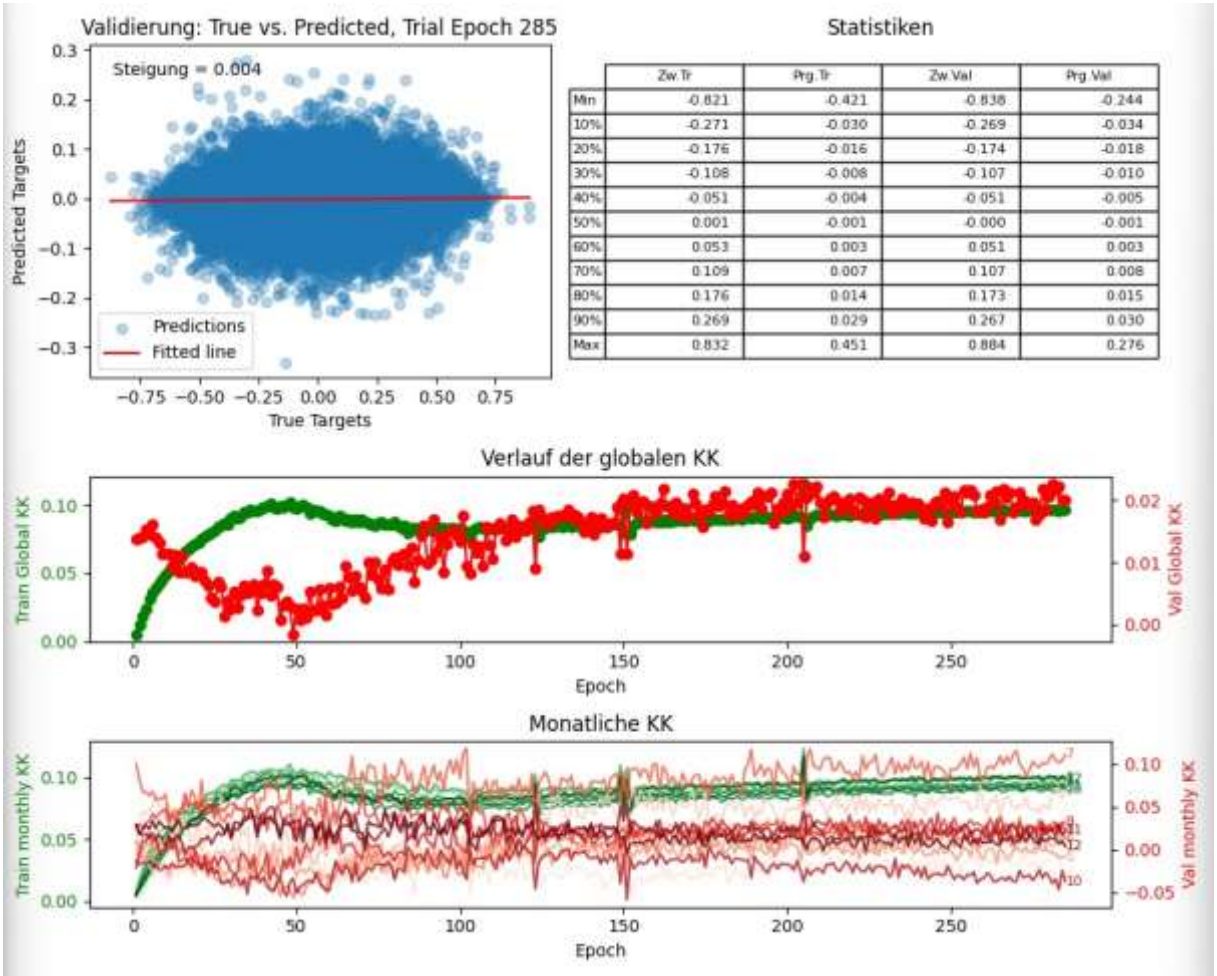
Im großen Programm ist nun schon einiges umgesetzt.
Die Trainingsdaten sind so sortiert, dass sie immer einen repräsentativen Querschnitt über die Zeiten und Währungspaare liefern. Das ist wichtig, weil das Training in kleinen Häppchen („Batches“) stattfindet.
Die gut 300 Merkmale werden danach aufgeteilt, ob sie die Kursrichtung oder die Volatilität vorhersagen. Da letztere nur die Marktsituation beschreiben, aber nicht die Kursentwicklung vorhersagen können, fließen sie nur moderierend in das eigentliche neuronale Netz ein, das aus den Richtungsmerkmalen besteht.
Weiterhin werden die Merkmale in Korrelationscluster eingeteilt. Ähnliche Merkmale bekommen jeweils weniger Gewicht um dem Modell nicht gleichartige Information mehrfach voll zu liefern, was es dann erst mühsam selbst feststellen müsste.
Und schließlich wird während des Trainings immer nur ein Teil der Daten betrachtet, nämlich die Monate, die in der Trainingsphase am schlechtesten prognostiziert werden. Hier ist das Ziel, über die Zeit möglichst ausgeglichene Prognosen zu bekommen.
Jetzt gab es auch mit diesem Modell erste Erfolge. Eine Korrelation der Vorhersage mit den vorherzusagenden Daten von 2% auf den Validierungsdaten (Daten, die im Training nicht berücksichtigt werden) ist zwar noch einiges vom Ziel entfernt, aber dennoch zeigt deren Simulation erfreuliche Entwicklungen, siehe unten. In der Simulation werden wöchentlich 1,3% Gewinn erwirtschaftet bei einem maximalen Zwischenverlust von gut 20% in dem simulierten Jahr 2022.
Hier steht jetzt als nächstes an, eine Schnittstelle zu programmieren um mit den Modellen aus dem großen Programm das Demokonto steuern zu können.
Danach geht es dann weiter mit den Punkten auf der langen Ideenliste, zunächst mit „Embeddings“, mit denen Währungspaare, Uhr- und Jahreszeiten einfließen können.

Demo-Konto (einfaches Modell):



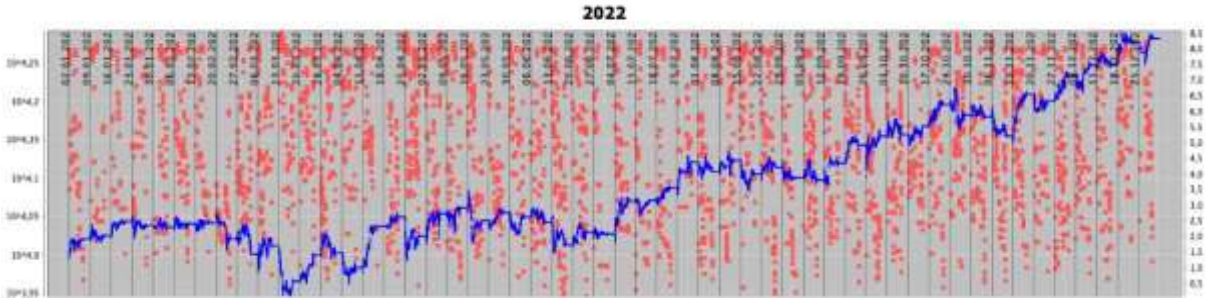
Großes Modell:

Verlauf des Trainings und Statistiken:



	Zw.Tr	Prg.Tr	Zw.Val	Prg.Val
Min	-0.821	-0.421	-0.838	-0.244
10%	-0.271	-0.030	-0.269	-0.034
20%	-0.176	-0.016	-0.174	-0.018
30%	-0.108	-0.008	-0.107	-0.010
40%	-0.051	-0.004	-0.051	-0.005
50%	0.001	-0.001	-0.000	-0.001
60%	0.053	0.003	0.051	0.003
70%	0.109	0.007	0.107	0.008
80%	0.176	0.014	0.173	0.015
90%	0.269	0.029	0.267	0.030
Max	0.832	0.451	0.884	0.276

Und die Simulation:



Interessant ist die Verteilung der Positionseröffnungen über die Uhrzeiten. In den frühen Morgenstunden wird eröffnet, dann laufen die Positionen im Schnitt gut 15 Stunden, werden also im Laufe des Tages geschlossen.
(Hour: Uhrzeit, Count: Anzahl Positionen, EpT: Ergebnis pro Position, Treffer: Trefferquote in Prozent)

Hour	Count	Ep T	Treffer	Volume
23	10	-9,68	23,02	139826
22	1	34,27	100,00	22458
21	5	40,61	100,00	100726
20	9	30,61	70,85	210334
19	3	25,88	100,00	55707
17	1	-18,89	0,00	15684
16	2	-34,58	0,00	61255
15	1	-32,06	0,00	10616
14	7	-19,36	30,31	82677
13	7	-0,70	43,62	63329
12	14	4,86	43,93	96504
11	13	-19,86	21,01	88335
10	8	5,99	74,57	117789
9	26	-0,22	42,47	308922
8	96	-0,93	48,03	903101
7	143	6,82	57,08	1575896
6	161	5,92	53,57	1911012
5	183	1,12	53,90	2507171
4	163	9,08	58,99	1967510
3	307	1,65	47,89	3038012
2	810	4,56	58,49	8841163
1	348	0,92	53,10	5062224
0	4	-7,54	79,30	52299