

## ForexRennen-Newsletter6 – 09.05.2025

Liebe Leser,

das Demokonto läuft recht stabil seit dem letzten Update am 18.03.2025, siehe unten.

Wir haben uns daher entschlossen, unsere Echtgeldkonten ab 12.05.2025 damit zu steuern, also den bisherigen Rechenkern durch das neuronale Netz zu ersetzen.

Es ist noch immer der mit dem „einfachen Modell“ erstellte Rechenkern. Mit dem komplexeren Modell konnten wir es noch nicht übertreffen.

Dort hat die Weiterentwicklung des eigentlichen Modells gestockt, da wir andere Arbeiten vorgezogen haben:

Wir haben ein weiteres Programm entwickelt, mit dem wir mit dem großen KI-Programm generierte Rechenkerne in die Handelssimulation und in die Endanwendung einbinden, also das Modell anwenden können.

Konkret nimmt das Anwendungsprogramm einen Datensatz mit Merkmalen (Indikatorwerten) einer Situation entgegen, normiert sie passend für das abgespeicherte Modell um, berechnet mit diesem Modell die Prognose und schickt sie als Ergebnis zurück.

Damit müssen wir nun nur noch die beim Training automatisch abgespeicherte Modell-Datei zur Berechnung der Handelssimulation oder für die Schnittstellen zu den Brokern austauschen.

Weiterhin gab es größere Aufräumarbeiten in dem komplexeren Programm, insbesondere haben wir den Austausch der Verlustfunktion flexibel gemacht. Bisher war alles auf den Korrelationskoeffizienten als Verlustfunktion zugeschnitten, was sich als begrenzt zielführend erwiesen hat. Nun kann problemlos durch Änderung eines Eintrags in der Konfigurationsdatei eine andere Verlustfunktion, beispielsweise der MSE („mean squared error“, mittlerer quadratischer Abstand) eingesetzt werden.

Die Verlustfunktion ist wesentlich, da sie das Optimierungsziel des Trainings beschreibt:

Es versucht, den Verlust, beim MSE beispielsweise den Abstand zwischen tatsächlichen und prognostizierten Werten, zu minimieren.

Wir konnten mit dem größeren Programm zwar bereits einen guten Handel für das Jahr 2022 produzieren, das nicht mit in den Trainingsdaten steckte (s.u., „2022 großes Programm“). Allerdings dient dieses Jahr bislang zur Validierung. Das hat zur Folge, dass wir über viele Trainingsläufe doch auf das Validierungsjahr optimieren.

Das Problem wird deutlich sichtbar, wenn wir die Simulation damit auch auf 2023 und 2024 ausdehnen (s.u., „2022-2024 großes Programm“). Dort wurden die „Handelsparameter“ auf 2022 und 2023 optimiert. Das verbleibende „echte Holdout“ 2024 verliert dann kräftig.

Die „Handelsparameter“ bestehen vor allem aus den Marken, bei deren über- oder unterschreiten Ein- oder Ausstiege erfolgen, aber auch aus Einstellungen für Positionsgrößen und weiteres.

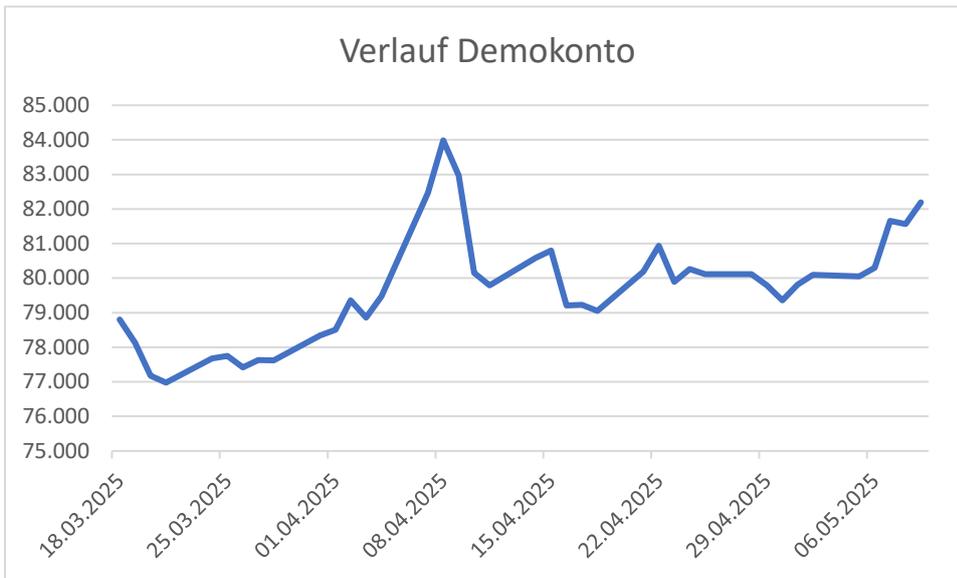
Ein „Holdout“ ist ein Teil der Daten, der zuvor noch gar nicht verwendet wurde. Nur damit lässt sich die tatsächliche Anwendung des Handels einigermaßen realistisch abschätzen.

Jetzt geht es dann weiter mit dem Einbau weiterer Verlustfunktionen und deren Test sowie dem Einprogrammieren weiterer Modellvarianten.

Weiterhin erweitern wir das Protokollieren von Größen während des Trainingsverlaufs mit dem Ziel, die Trainingsparameter damit gezielter anpassen zu können.

Sobald ein Trainingslauf ein überzeugendes Ergebnis bringt, ersetzen wir das Modell für den Handel durch dieses.

Demo-Konto (einfaches Modell):



2022 (großes Programm):

**Konfiguration**

Item:  | Date: 06.10.2022

Apply News: Apply Daily

Mindest Risiko Einlage-Potential: 655

Mindest Risiko-Potential zur SL-Erweiterung: -1.000

Höchstes Risiko-Potential zur Verengung des SL: -1.000

Maximale Ausstieg-Punktezahl: 63

Risiko-Limit (in %) des Verfügbaren Risikos pro Position: 1.875

Risiko-Crest-Limit (in %) des Verfügbaren Risikos pro Position: 18

Risiko-Beherrschung in 10mer-Dollar: 48

Maximalrisiko vom Höchstwert: 23.425

Commission: 23

Stop-Loss-Quantil: 52

Potential-Quantil: 100

SL-Factor: 0

Phi-Factor: 0,78

Bank-Factor: 0

D05 Vergabe der Einlage in 30k: 6

D22 Vergabe der Einlage in 20k: 38

D26 Vergabe der Einlage in 20k Logarithmische Aktien: 158

Randomisierte Einlage:

Autofangverlängerung:

Ausführungsmengenwachstum:

Stopps einrichten:

Risikobeherrschung:

Minimale Risikobeherrschung pro Währung: 14,3

Risikofaktor: 1

Kostenfaktor: 0

Instrumente:

Standard:

**Instrumenten Statistik**

Instrument	Count	Ep T	Trifter	Volume
USDJPY	236	3,21	62,21	6947366
EURUSD	236	3,91	51,19	6765891
GBPUSD	184	4,23	60,82	3200813
EURJPY	160	3,91	66,97	6688300
AUDJPY	147	11,65	32,81	3919987
USDCHF	134	4,97	52,69	1442756
AUDUSD	107	4,76	66,73	2851769
CADJPY	106	-3,42	49,18	2801836
GBPJPY	99	-8,87	62,77	1448658
USDCAD	86	1,39	36,86	2362445
KZJPY	79	6,86	55,02	1878710
USDCHF	76	-4,34	37,39	1342748
KZUSD	74	-4,24	38,83	1746803
EURAUD	61	3,07	49,27	1718624
CHFJPY	59	3,88	30,86	752277
USDNIN	54	-12,15	37,89	770276
EURGBP	53	-0,38	50,59	1588714
GBPUSD	51	-3,30	49,64	841882
EURCAD	49	3,34	44,29	898846
USDZAR	37	14,92	46,46	462330
USDJPY	36	-10,19	34,51	559632
GBPUSD	36	14,93	41,47	501181
GBPCHF	31	3,77	62,88	347274
AUDUSD	29	-7,42	65,82	693889
USDUSD	22	-8,84	34,31	676897

**Stunden Statistik**

Hour	Count	Ep T	Trifter	Volume
0	35	-1,24	59,50	2767452
1	37	-1,18	59,09	6787133
2	388	4,73	37,49	867381
3	124	11,39	62,17	2362502
4	19	6,42	62,21	1784180
5	85	6,78	51,35	1800795
6	97	-4,78	49,41	3191185
7	138	3,21	31,36	3842382
8	229	3,28	52,51	4122720
9	151	11,71	62,21	386662
10	74	8,11	53,30	1213091
11	91	3,08	56,35	1254946
12	67	1,04	32,79	1237754
13	106	13,10	63,16	1746803
14	116	-2,28	44,86	1892884
15	85	0,25	54,80	1348883
16	76	-25,84	39,46	1076747
17	46	0,23	47,26	87258
18	36	3,48	37,81	654364
19	36	8,78	72,35	362379
20	35	16,76	62,97	803067
21	23	17,42	61,02	894848
22	16	-14,73	44,38	398447
23	24	3,27	63,32	623458

**LS Statistik**

Is Long	Count	Ep T	Trifter	Volume
True	1387	5,33	58,78	28200717
False	1097	0,68	50,19	21284978

**WT Statistik**

Wt	Count	Ep T	Trifter	Volume
6	277	3,26	35,69	6174619
5	434	3,62	51,89	8772630
4	482	0,67	37,77	8850115
3	585	6,43	36,49	17301807
2	748	0,67	34,59	14873222

**Performance**

EqT: 0,0%

EqT+: 31,87%

EqT-: -33,63%

TC: 30%

EqW: 1,90%

ppW: 45 / 28

Drawup: 49

Drawd24: 2,06/03,06/71,30

MaxDD: 33,16 / 32,86 / 28,17 = 36,33%

EqWd: 1,05 / 1,01 Mo.

**Ausstieg**

CLOSE: 79,88%

REC\_REDUCE: 27,04%

SL\_SOFT: 0,00%

SL\_HARD: 0,10%

TP: 0,00%

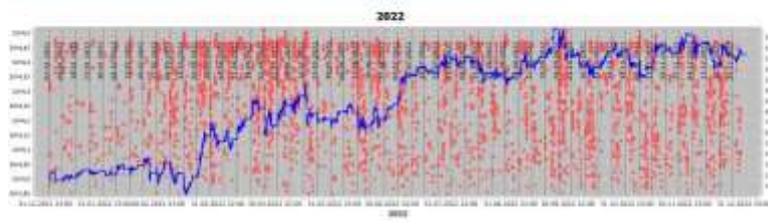
ENTRY\_CFP: 0,00%

Points: 6,91

Points Breakeven: 273,30

Swaps: 680,77

0,0204\_20250426\_202056



2022-2024 (großes Programm):

### Konfiguration

From:  To:

Apply News Apply Quality

Mindest Netto-Einstiegs-Potential: 33,3

Mindest Brutto-Potential zur SL-Erweiterung: 1.000

Höchstes Brutto-Potential zur Verengung des SL: 1.000

Maximale Ausstiegs-Punktzahl: -02

Risiko mittel (in %) des verfügbaren Risikos pro Position: 2,125

Risiko maximal (in %) des verfügbaren Risikos pro Position: 5

Risiko-Betrachtung in 10min Balken: 49

Maximumkriterium vom Höchstwert: 23,3

Commission: 25

StopLoss Quotient: 50

Potential Quotient: 100

SL Factor: 5

Hot Factor: 0,086

Scale Factor: 5

Q05 Vorgabe der Einstiege in 20h: 2

Q10 Vorgabe der Einstiege in 20h: 23

Q95 Vorgabe der Einstiege in 20h: 71

Logarithmische Achsen

Randomisierte Einstiege

Equitygleichung

Auführungskursgleichung

Swaps einrechnen

Risikodarstellung

Maximale Hebelwirkung pro Währung:

Risikofaktor: 1

Kursfaktor: 3

Instrumente:

### Instrumenten Statistik

Instrument	Count	Ep T	Trichter	Volume
USDJPY	405	5,16	58,67	1229489
EURUSD	381	5,24	57,86	1949599
EURJPY	227	5,86	55,31	608886
AUDJPY	219	3,59	56,11	891874
GBPUSD	209	-2,39	54,01	387196
CADJPY	159	-6,81	47,45	608838
AUDUSD	153	1,17	52,05	370038
USDMXN	153	0,81	57,12	304348
NZDJPY	157	-4,85	53,45	575939
GBPJPY	135	3,14	55,93	276812
USDCHF	121	2,34	53,53	390916
USDCAD	126	2,36	50,13	462106
USDCHF	121	0,86	60,58	384708
NZDUSD	119	5,82	63,16	600024
USDZAR	115	1,44	55,97	161562
EURGBP	86	0,44	55,74	327582
EURAUD	62	2,62	57,34	232472
USDNOK	67	-2,02	52,86	122486
CHFJPY	54	8,13	55,38	182782
EURNOK	56	-4,14	51,25	1120912
USDSEK	56	-3,38	58,29	108112
EURCAD	52	4,13	61,62	202188
GBPUSD	49	-4,10	50,37	147218
GBPCHF	46	-6,83	37,04	114982
EURNZD	37	5,35	69,02	124554

### Stunden Statistik

Hour	Count	Ep T	Trichter	Volume
22	24	-7,12	54,24	83684
22	27	3,22	56,46	112046
21	65	8,18	78,85	307292
20	79	0,10	57,18	304618
19	85	-11,28	93,24	2513457
18	42	2,15	60,57	1126007
17	45	4,27	61,06	864088
16	75	-14,88	53,42	2222727
15	136	-4,20	53,47	3887781
14	238	1,06	62,85	712679
13	196	-1,34	52,27	6891863
12	118	1,86	50,06	2760330
11	62	3,28	56,44	2375246
10	82	13,26	72,35	2560344
9	207	-1,22	61,23	5822188
8	384	2,28	67,13	16881389
7	384	-2,27	52,70	15880052
6	201	0,43	56,83	8020002
5	75	0,83	58,89	2594024
4	66	7,48	72,26	2466022
3	150	1,06	54,44	5882170
2	274	-1,04	56,71	11882140
1	232	-4,35	55,37	8367510
0	108	6,78	63,30	4178220

### L5 Statistik

In Long	Count	Ep T	Trichter	Volume
True	2001	-8,24	54,09	6300954
False	1639	8,71	56,92	52110862

### WT Statistik

Win	Count	Ep T	Trichter	Volume
0	446	-0,23	54,61	1485298
1	148	-0,88	57,18	2221045
4	717	1,08	65,58	22752607
3	676	1,38	68,86	22581963
2	1054	-0,58	55,13	22572263

### Performance

EpT: 5,14  
EpT+: 26,13  
EpT-: -33,57  
TQ: 58%  
EPW: -0,37%  
FPW: 22 / 17  
Duration: 64  
Etraced: 1.205.003420  
Max DD: 86,17 / 35,35 / 6,48 -> 69,17%  
W9W: 1,89 / 1,52 Mo.

### Ausstiege

CLOSE: 42,88%  
RSC\_REDUCE: 34,01%  
SL\_SOFT: 0,00%  
SL\_HARD: 3,23%  
TP: 0,00%  
ENTRY\_OPEN: 0,08%  
Panic: -4,43  
Points Bewertung: -7,14  
Stress: 22,21

optimize points optimize points half optimize points heuristic optimize points random optimize fix optimize CMAES optimize Weekly

2022 / 2024

2022 / 2024