

## ForexRennen-Newsletter 8 – 03.01.2026

Liebe Leser,

das Demokonto befindet sich nach einem Ausflug nach unten nun wieder auf dem Stand von Anfang August 2025. Der Verlauf ist unten zu sehen.

Gesteuert wird es noch immer mit einem Rechenkern des „einfachen Modells“, der allerdings am 29.10.2025 durch einen neuen Stand ersetzt wurde.

Wir nutzen für die Modelle acht Lernjahre, drei „Optimierungsjahre“ und ein Jahr „Holdout“. Auf den Lernjahren wird das neuronale Netz trainiert, in den Optimierungsjahren werden zum Modell passende Handelsparameter per Handelssimulation er getestet. Das Holdout bleibt unbenutzt um am Ende darauf einen echten Test durchführen zu können. Beim „einfachen Modell“ war auffällig, dass das Optimierungsverfahren in der Handelssimulation immer Parameter ausgegeben hat, die sehr wenig Handel bedeutet haben. Damit lief das Holdout 2025 dann miserabel. Die Ursache war sehr wahrscheinlich Überanpassung der Parameter auf den Optimierungszeitraum. Wir haben das geändert, so dass die Optimierung neben hohen Gewinnen einen Anreiz hat, mehr zu handeln. Jetzt kommen höhere Positionszahlen zustande, das Holdout ist leider noch immer nicht überzeugend.

Die nächsten Versuche sind die Mittelung mehrerer Modelle, also die Erzeugung von Prognosen mit mehreren Modellen um dann deren Mittelwert als relevante Prognose zu verwenden. Damit soll mehr Stabilität bei weniger Fehlprognosen gewährleistet werden.

Beim „große Programm“ ist die „handelsnahe Verlustfunktion“ in Arbeit, mit der die Prognosen direkt auf guten Handel trainiert werden sollen. Eine wesentliche Herausforderung ist es, das Modell so zu trainieren, dass sich damit nachher gut handeln lässt. Es benötigt ein Maß um dem neuronalen Netz zu sagen, was gut und was schlecht ist. Üblicherweise wird der Abstand des Vektors mit den Prognosen zu dem der Zielwerte (irgendwelche Kursentwicklungen) mit so einem Maß gemessen, beispielsweise mit einem Korrelationskoeffizienten oder der Summe der quadrierten Abstände. Dabei können durchaus gute Ergebnisse herauskommen, die dann aber im Handel überhaupt nicht funktionieren. Daraus resultiert der Gedanke, das Handelsergebnis direkt in der Verlustfunktion zu simulieren und darauf zu optimieren. Bislang kollabiert das Netz aber noch beim Versuch, mit dieser Verlustfunktion zu trainieren.

### Demo-Konto (einfaches Modell):

