

Zwei-Stufen-XGBoost – Experiment-Report

Experiment-ID: hp_long_eod_final_yahoo_13

Dieses Dokument fasst die wichtigsten Parameter, Datenquellen und Metriken eines Zwei-Stufen-XGBoost-Experiments zusammen.

Stufe 1 (Signal): neutral vs. Bewegung ('move'). Stufe 2 (Richtung): down vs. up – nur an Bewegungstagen.

Label-Parameter:

- horizon_days: 4
- up_threshold: 0.005
- down_threshold: -0.005
- strict_monotonic: False
- max_adverse_move_pct: 0.005
- price_source: eodhd
- drop_weekends: True
- hit_within_horizon: True (True = Schwelle reicht, wenn sie irgendwo im Horizont erreicht wird)
- first_hit_wins: True (nur relevant bei hit_within_horizon=True: entscheidet nach erstem Treffer)

Datensatz & Splits:

- dataset_path:

data/processed/datasets/eurusd_news_training__hp_long_eod_final_yahoo_13.csv
- test_start: 2025-01-01
- train_frac_within_pretest: 0.8
- feature_mode: price_only

Entscheidungsgrenzen (Modelle):

- SIGNAL_THRESHOLD (Stufe 1 – move vs. neutral): 0.5 (höher → höhere Precision, niedrigerer Recall).
- SIGNAL_THRESHOLD_TRADE (Stufe 1 – Trading): 0.625 (höher → weniger Trades, tendenziell höhere Qualität).
- DIRECTION_THRESHOLD (Stufe 2 – down vs. up, für Metriken): 0.44 (niedriger → mehr up, höher → weniger up).

Legende & Begriffe (Kurzüberblick)

Zielvariablen:

- label: 3-Klassen-Ziel auf Basis des 4-Tage-Lookaheads (neutral / up / down).
- signal: 0 = neutral, 1 = Bewegung (up oder down).
- direction: 0 = down, 1 = up; nur definiert, wenn signal == 1.

Wichtige Metriken:

- precision: Anteil der vorhergesagten positiven Fälle, die wirklich positiv sind.
- recall: Anteil der tatsächlichen positiven Fälle, die erkannt wurden.
- f1: harmonischer Mittelwert aus precision und recall (Balance beider Größen).
- support: Anzahl der Beobachtungen in der jeweiligen Klasse.

Feature-Abkürzungen (Auswahl, nicht vollständig – vollständige Liste siehe Seite 'Verwendete

Features'):

- article_count: Anzahl News-Artikel pro Tag.
- avg_polarity / avg_neg / avg_neu / avg_pos: durchschnittliche Sentiment-Werte.
- pos_share / neg_share: Anteil positiver bzw. negativer Sentiment-Komponente.
- intraday_range_pct: (High - Low) / Close – relative Tages-Spanne (Volatilität).
- upper_shadow / lower_shadow: obere/untere Dochte der Kerzen (High/Low vs. Körper).
- month / quarter: Kalendermonat und Quartal.

Modell-Parameter (XGBoost)

Signal-Modell (Stufe 1):

- objective: binary:logistic
- max_depth: 3
- learning_rate: 0.05
- n_estimators: None
- subsample: 0.9
- colsample_bytree: 0.9
- scale_pos_weight: 0.255781359495445

Richtungs-Modell (Stufe 2):

- objective: binary:logistic
- max_depth: 3
- learning_rate: 0.05
- n_estimators: None
- subsample: 0.9
- colsample_bytree: 0.9
- scale_pos_weight: 1.0

Verwendete Features (FEATURE_COLS)

| # | feature_name | description |
|----|--------------------------------------|--|
| 0 | intraday_range_pct | $(\text{High} - \text{Low}) / \text{Close}$ – relative Tagesvolatilität. |
| 1 | upper_shadow | Oberer Kerzendocht: $\text{High} - \max(\text{Open}, \text{Close})$. |
| 2 | lower_shadow | Unterer Kerzendocht: $\min(\text{Open}, \text{Close}) - \text{Low}$. |
| 3 | price_close_ret_1d | Relativer Schlusskurs-Return gegenüber Vortag: $\text{Close}_t / \text{Close}_{\{t-1\}} - 1$. |
| 4 | price_close_ret_5d | Schlusskurs-Return über 5 Tage: $\text{Close}_t / \text{Close}_{\{t-5\}} - 1$. |
| 5 | price_range_pct_5d_std | Standardabweichung der intraday_range_pct über 5 Tage (Volatilität). |
| 6 | price_body_pct_5d_mean | Durchschnittlicher Kerzenkörper-Prozentsatz über 5 Tage. |
| 7 | price_close_ret_30d | Schlusskurs-Return über 30 Tage: $\text{Close}_t / \text{Close}_{\{t-30\}} - 1$. |
| 8 | price_range_pct_30d_std | Standardabweichung der intraday_range_pct über 30 Tage. |
| 9 | price_body_pct_30d_mean | Durchschnittlicher Kerzenkörper-Prozentsatz über 30 Tage. |
| 10 | month | Kalendermonat (1–12). |
| 11 | quarter | Kalenderquartal (1–4). |
| 12 | cal_dow | Wochentag (0 = Montag, 6 = Sonntag). |
| 13 | cal_day_of_month | Kalendertag im Monat. |
| 14 | cal_is_monday | Flag: 1 wenn Montag, sonst 0. |
| 15 | cal_is_friday | Flag: 1 wenn Freitag, sonst 0. |
| 16 | cal_is_month_start | Flag: 1 wenn Monatsanfang, sonst 0. |
| 17 | cal_is_month_end | Flag: 1 wenn Monatsende, sonst 0. |
| 18 | hol_is_us_federal_holiday | Flag: 1 wenn US-Feiertag, sonst 0. |
| 19 | hol_is_day_before_us_federal_holiday | Flag: 1 wenn Tag vor US-Feiertag. |
| 20 | hol_is_day_after_us_federal_holiday | Flag: 1 wenn Tag nach US-Feiertag. |

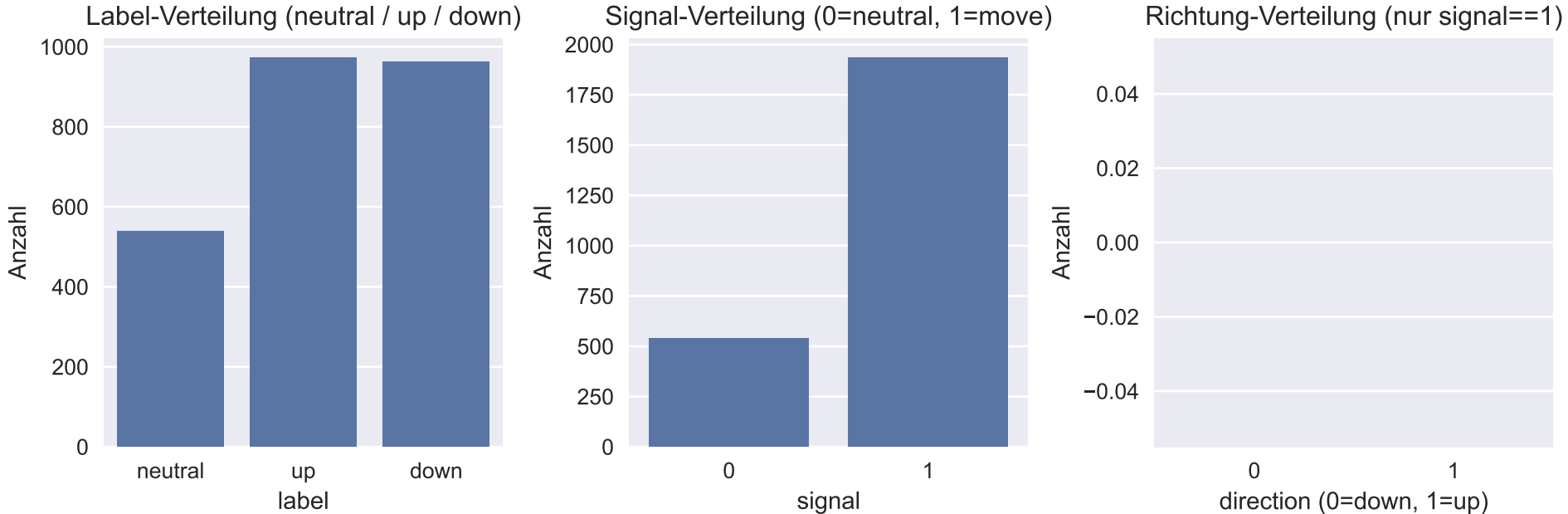
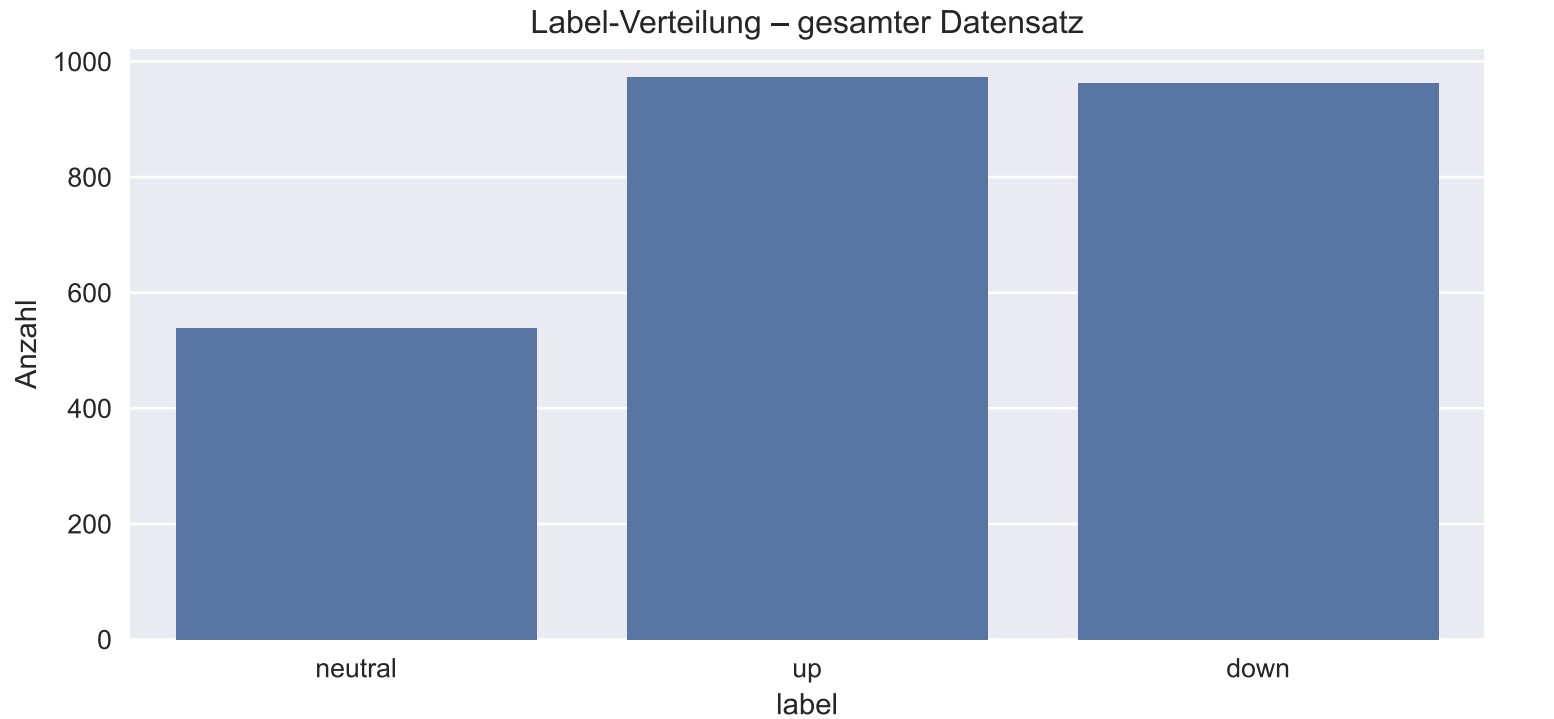


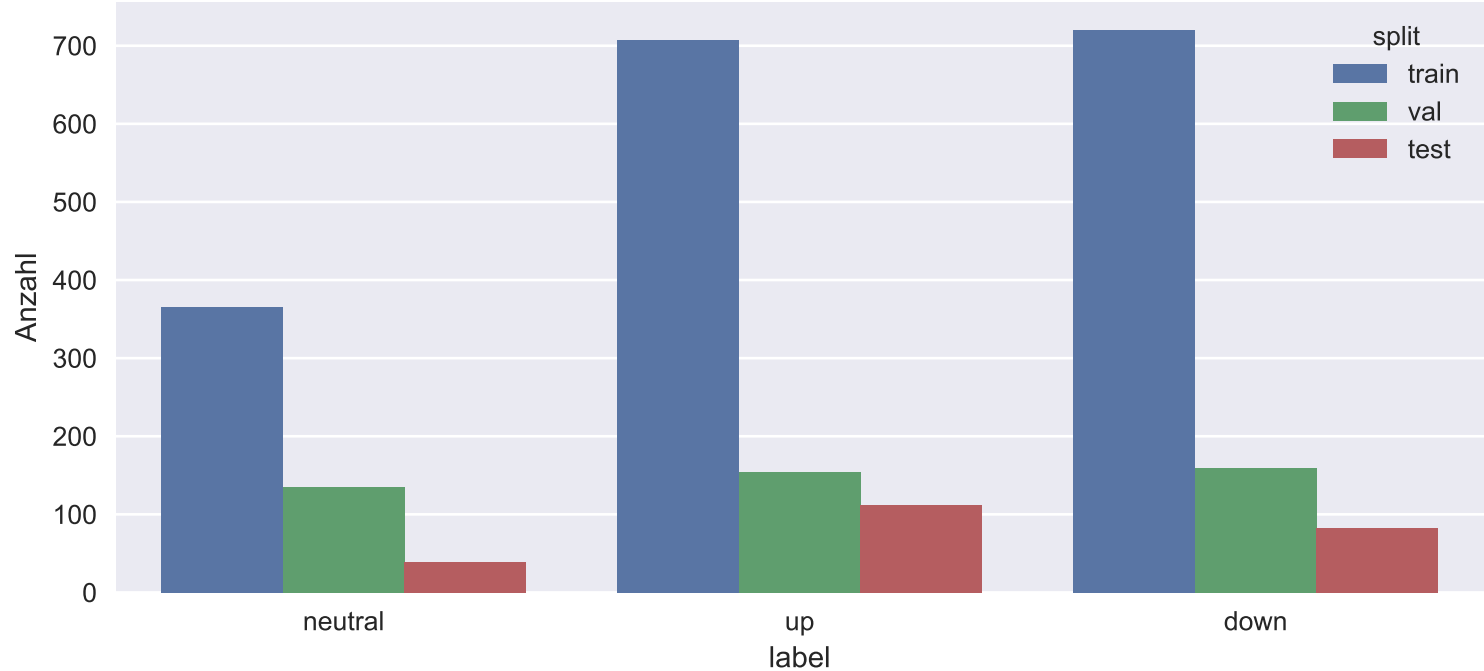
Abbildung: Klassenverteilungen für label, signal und direction im vollständigen Trainingsdatensatz.



| label | count |
|---------|-------|
| neutral | 539 |
| up | 973 |
| down | 962 |

Abbildung/Tabelle: Verteilung der Zielvariable 'label' (neutral/up/down) im gesamten Datensatz.

Label-Verteilung nach Splits (train/val/test)



| split | neutral | up | down |
|-------|---------|-----|------|
| train | 365 | 707 | 720 |
| val | 135 | 154 | 159 |
| test | 39 | 112 | 83 |

Abbildung/Tabelle: Label-Verteilung getrennt nach Trainings-, Validierungs- und Test-Split.

EURUSD-Zeitreihe mit Train/Val/Test-Bereichen

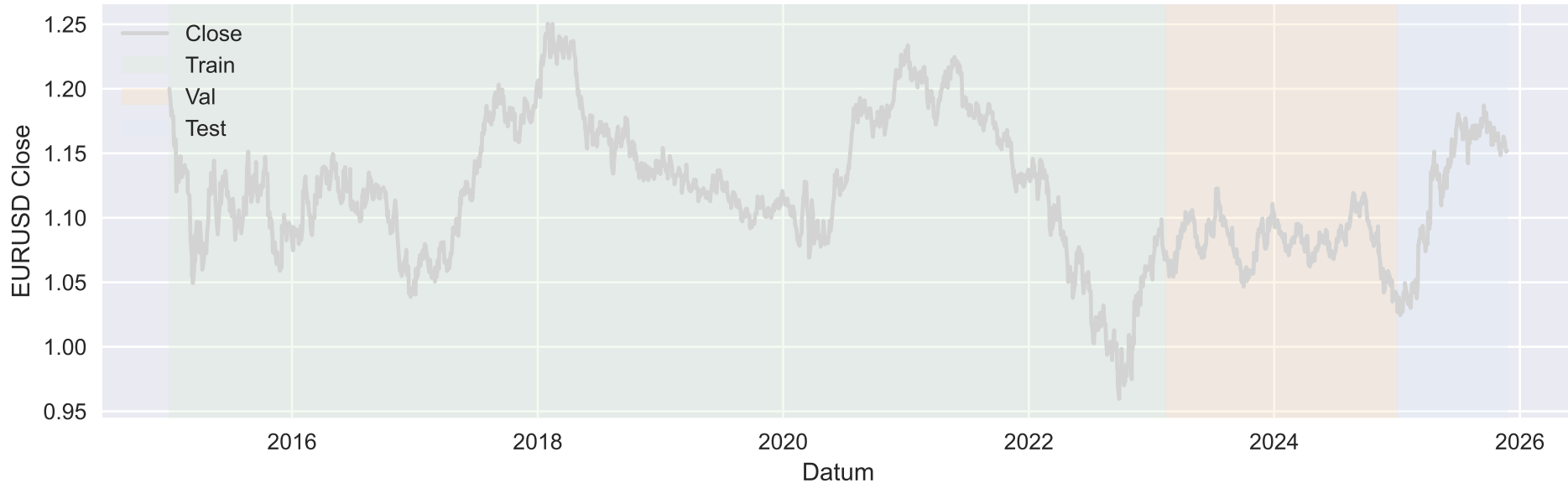


Abbildung: EURUSD-Schlusskurs über den gesamten Zeitraum mit farblich markierten Trainings-, Validierungs- und Testphasen.

EURUSD-Zeitreihe mit hervorgehobenen up/down-Tagen (ab 2020)

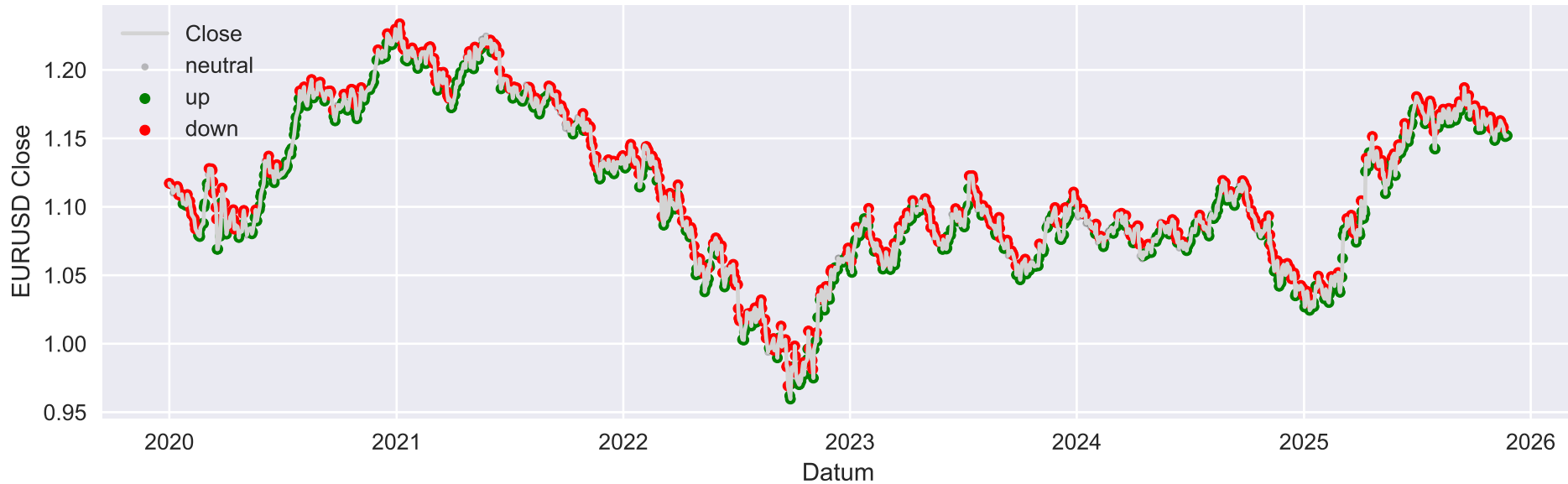


Abbildung: EURUSD-Schlusskurs mit markierten up-/down-Tagen im betrachteten Zeitraum.

EURUSD-Segmente mit label='up' (Test-Split) – Seite 1/5

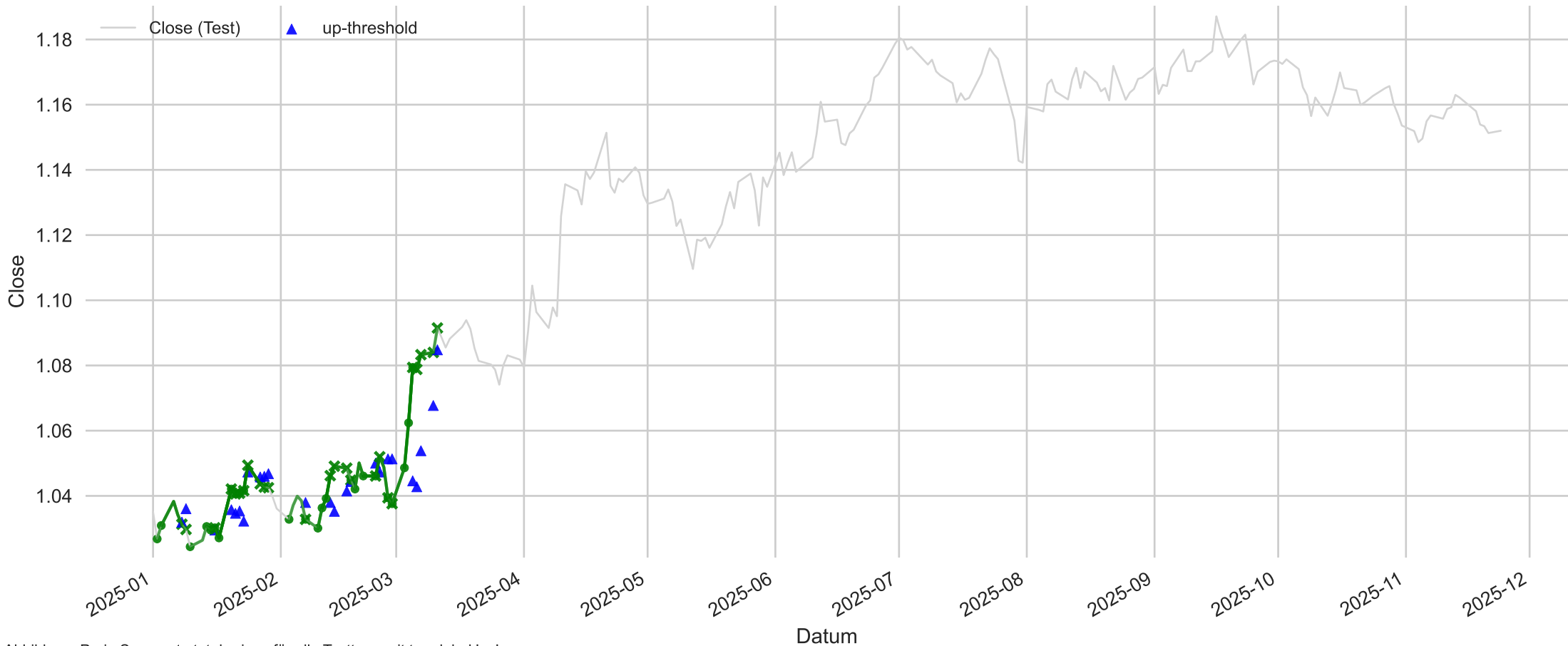


Abbildung: Preis-Segmente $t..t+\text{horizon}$ für alle Testtage mit true label 'up'.

EURUSD-Segmente mit label='up' (Test-Split) – Seite 2/5

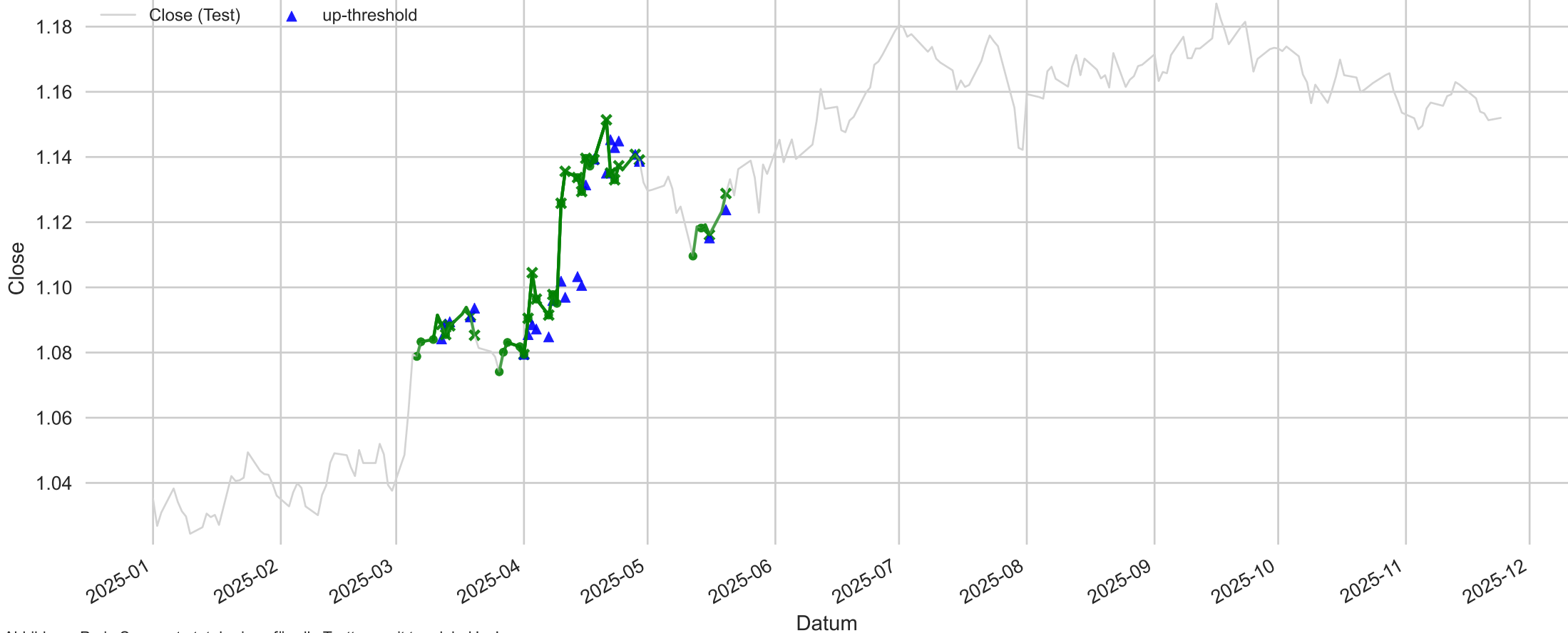
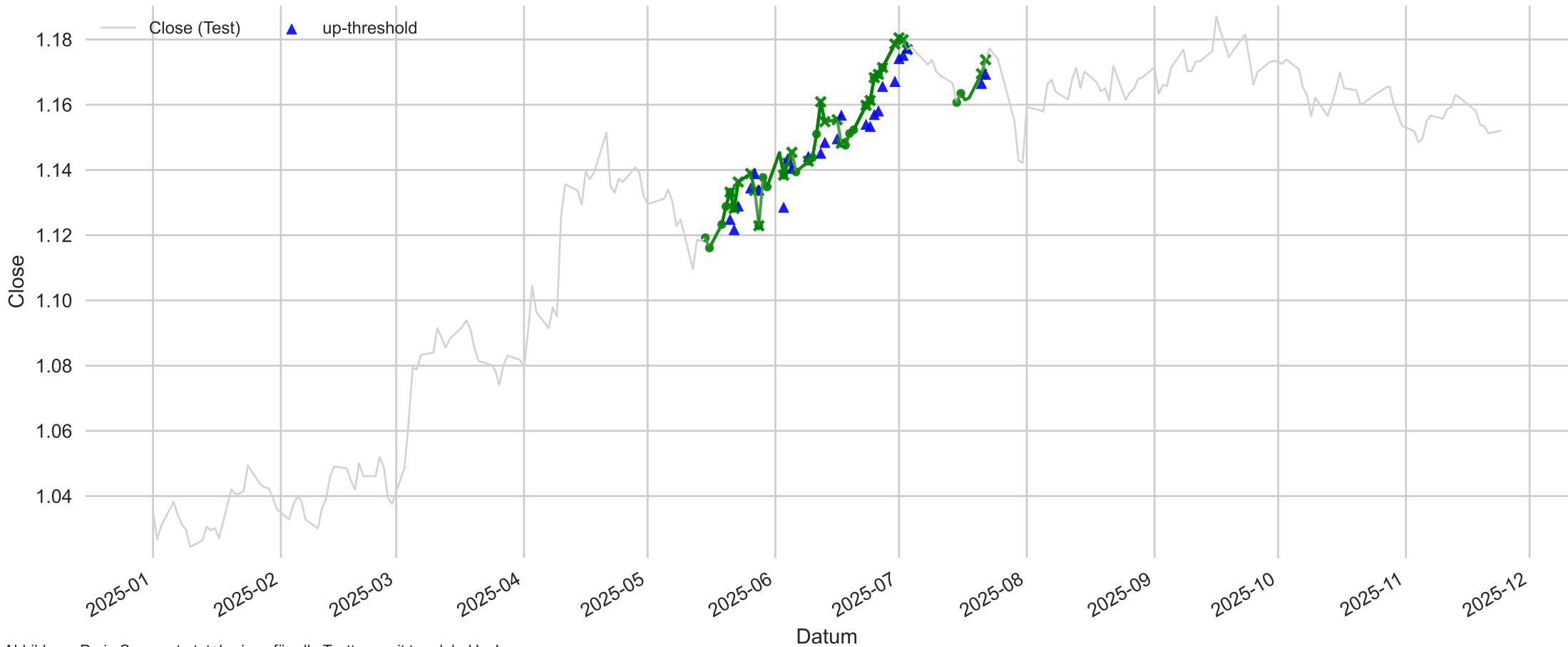


Abbildung: Preis-Segmente $t..t+\text{horizon}$ für alle Testtage mit true label 'up'.



EURUSD-Segmente mit label='up' (Test-Split) – Seite 4/5

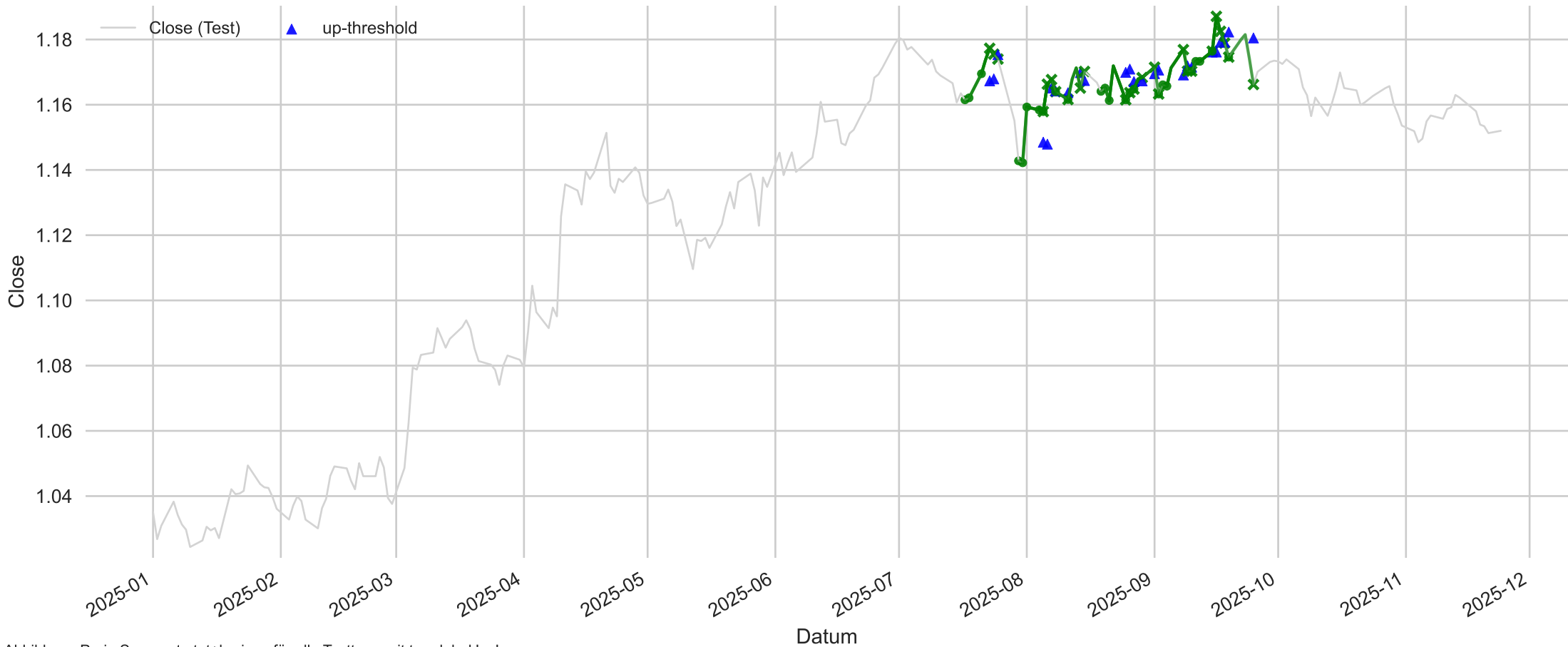


Abbildung: Preis-Segmente $t..t+\text{horizon}$ für alle Testtage mit true label 'up'.

EURUSD-Segmente mit label='up' (Test-Split) – Seite 5/5

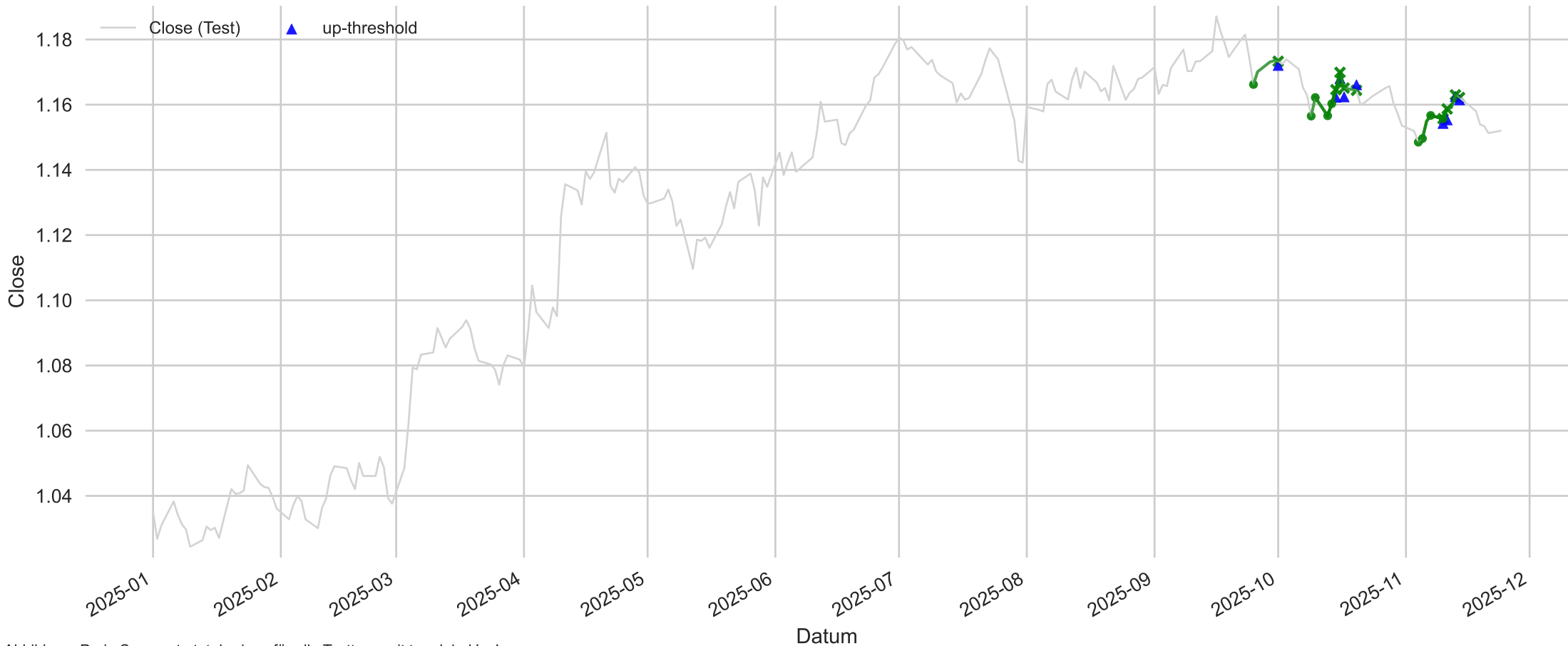


Abbildung: Preis-Segmente $t..t+\text{horizon}$ für alle Testtage mit true label 'up'.

Relativer Verlauf der Segmente (label='up') – Seite 1

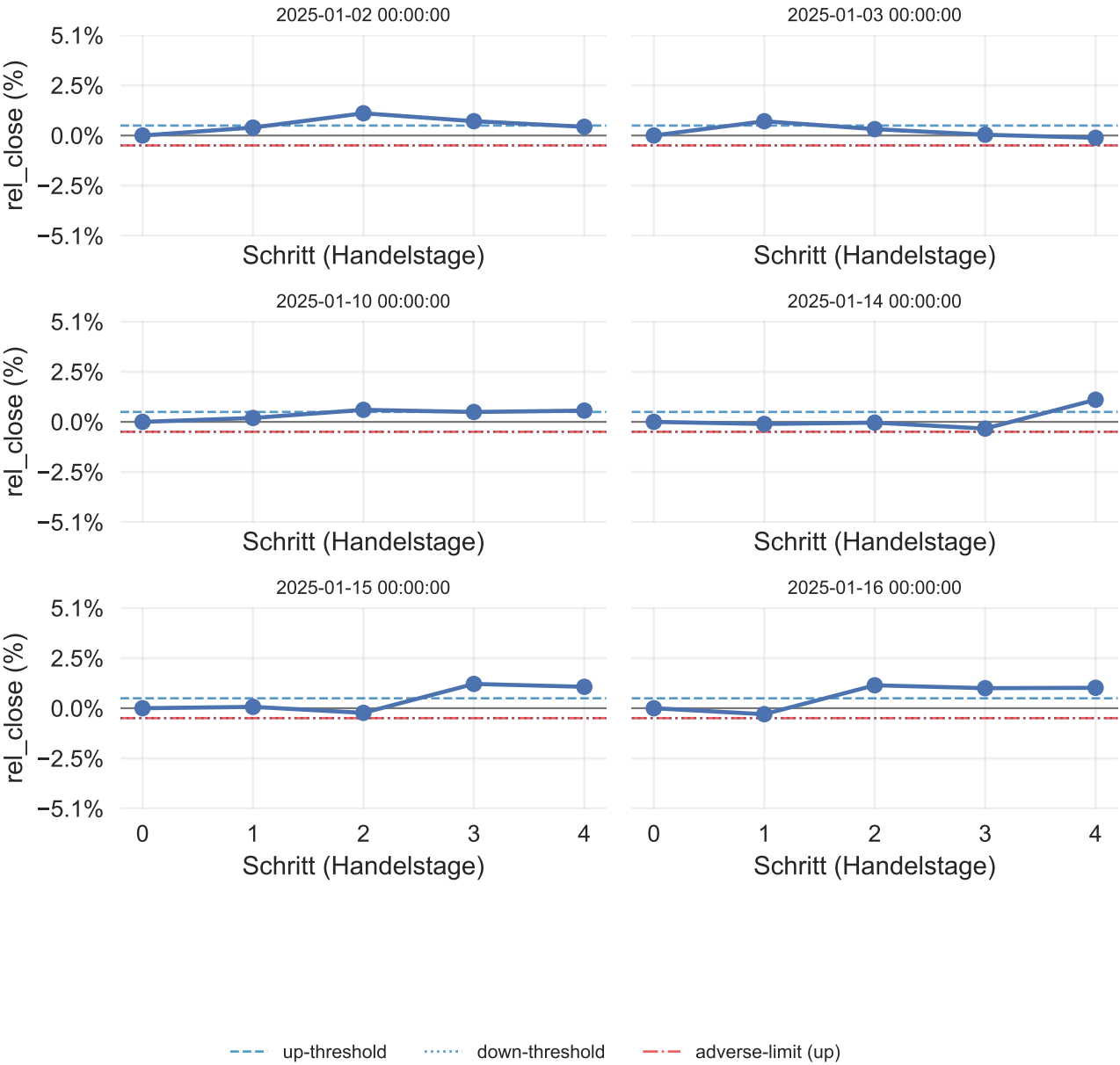


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.

Relativer Verlauf der Segmente (label='up') – Seite 2

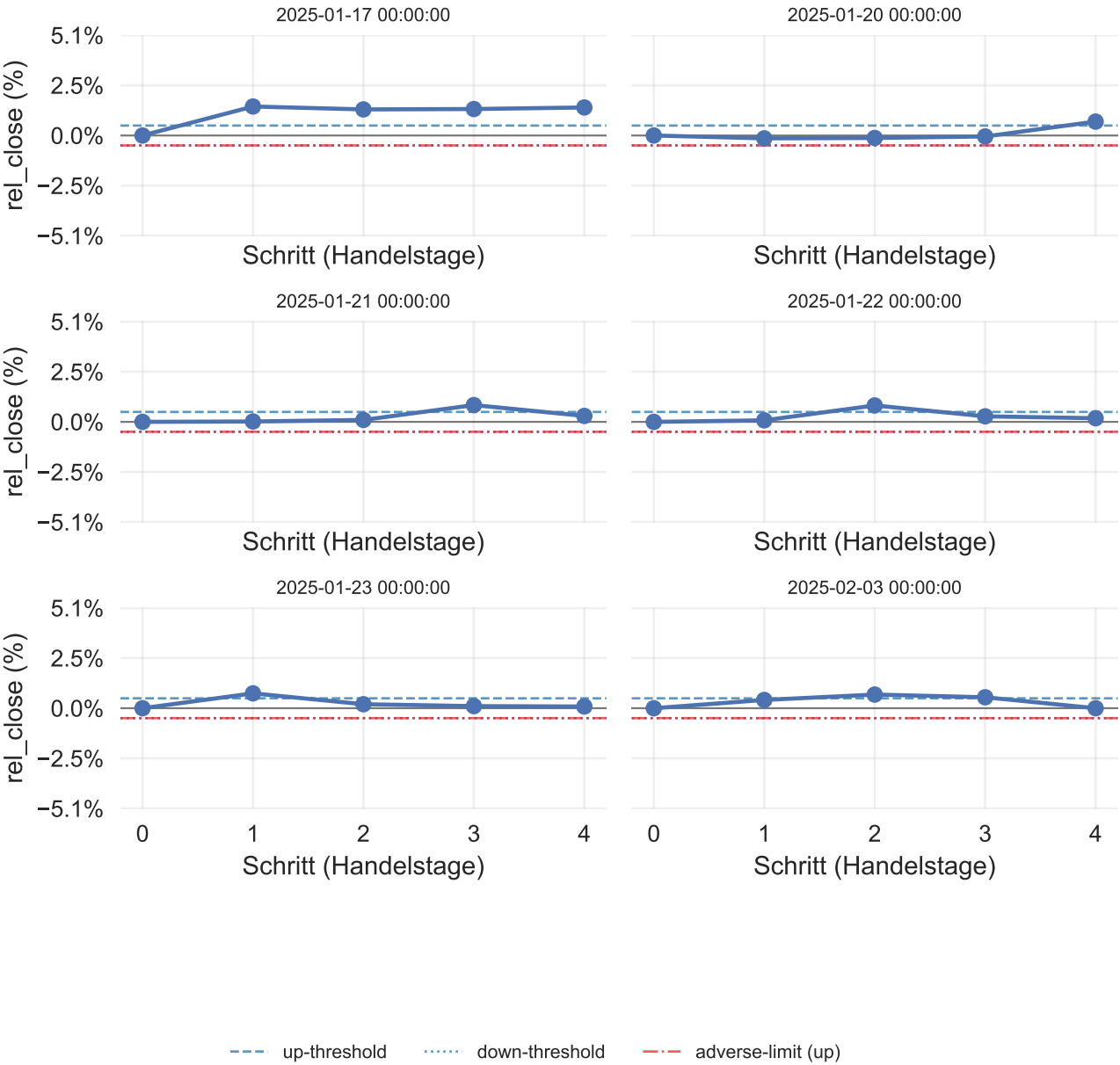


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.

Relativer Verlauf der Segmente (label='up') – Seite 3

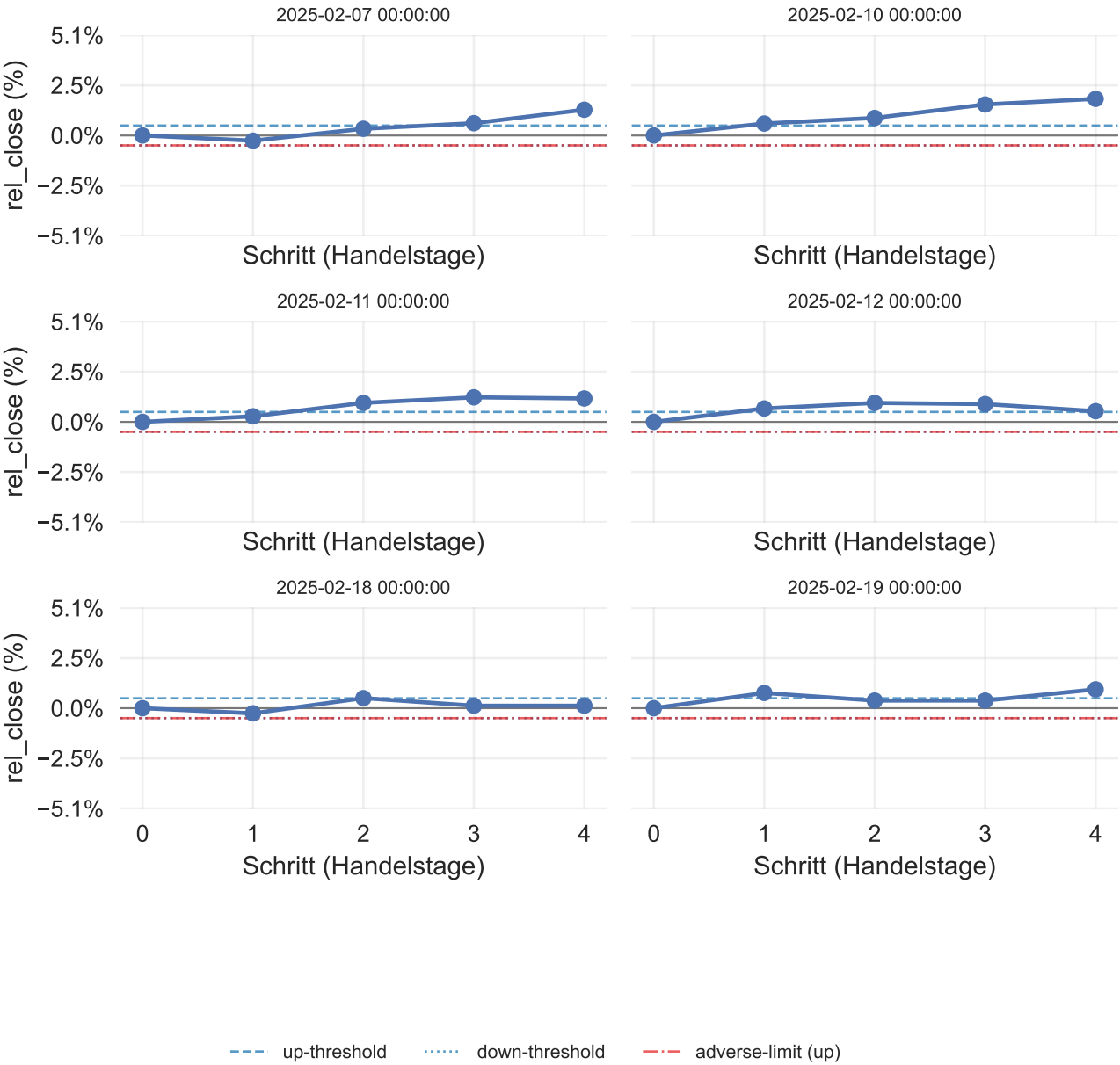


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.

Relativer Verlauf der Segmente (label='up') – Seite 4

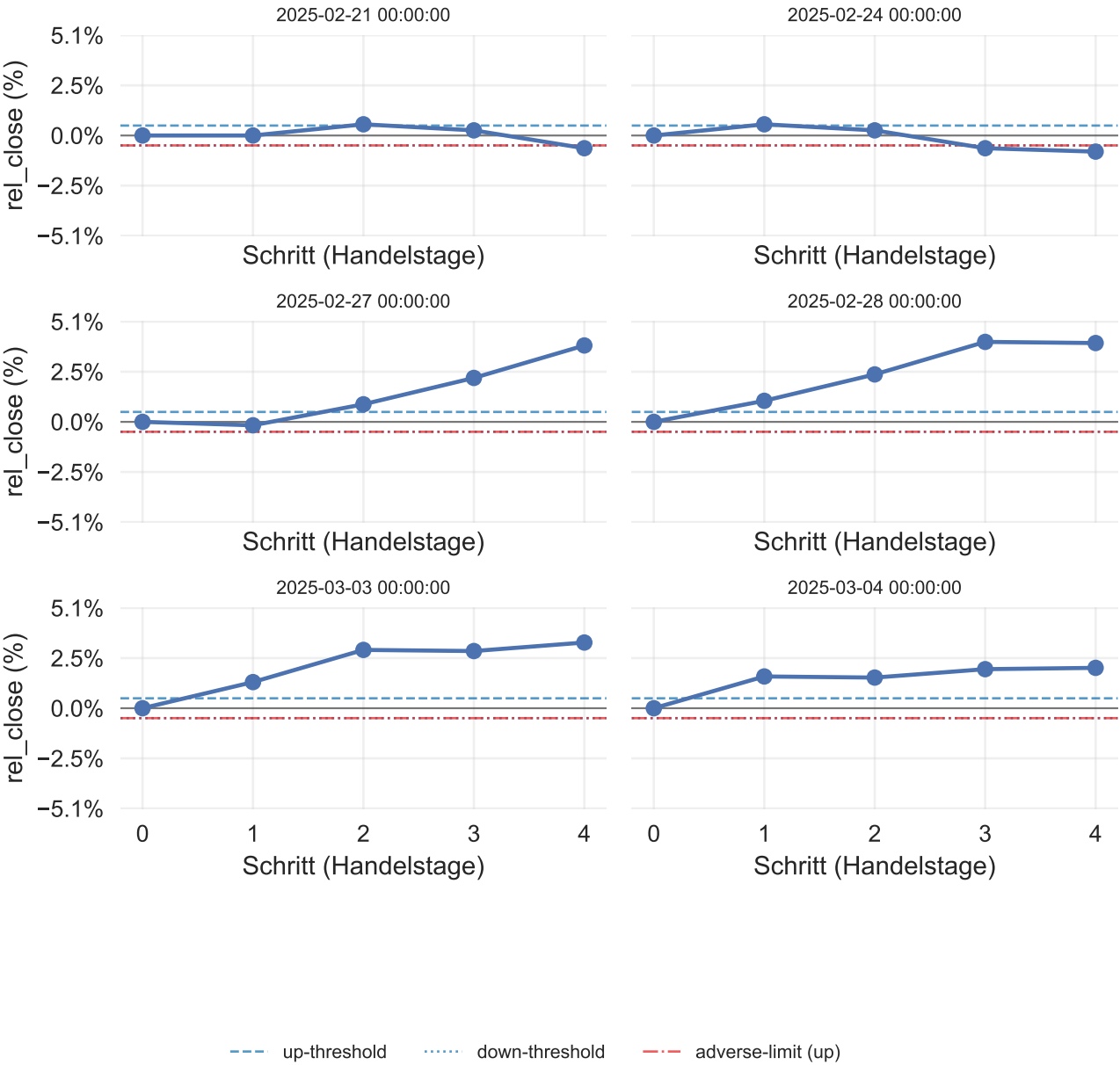


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.

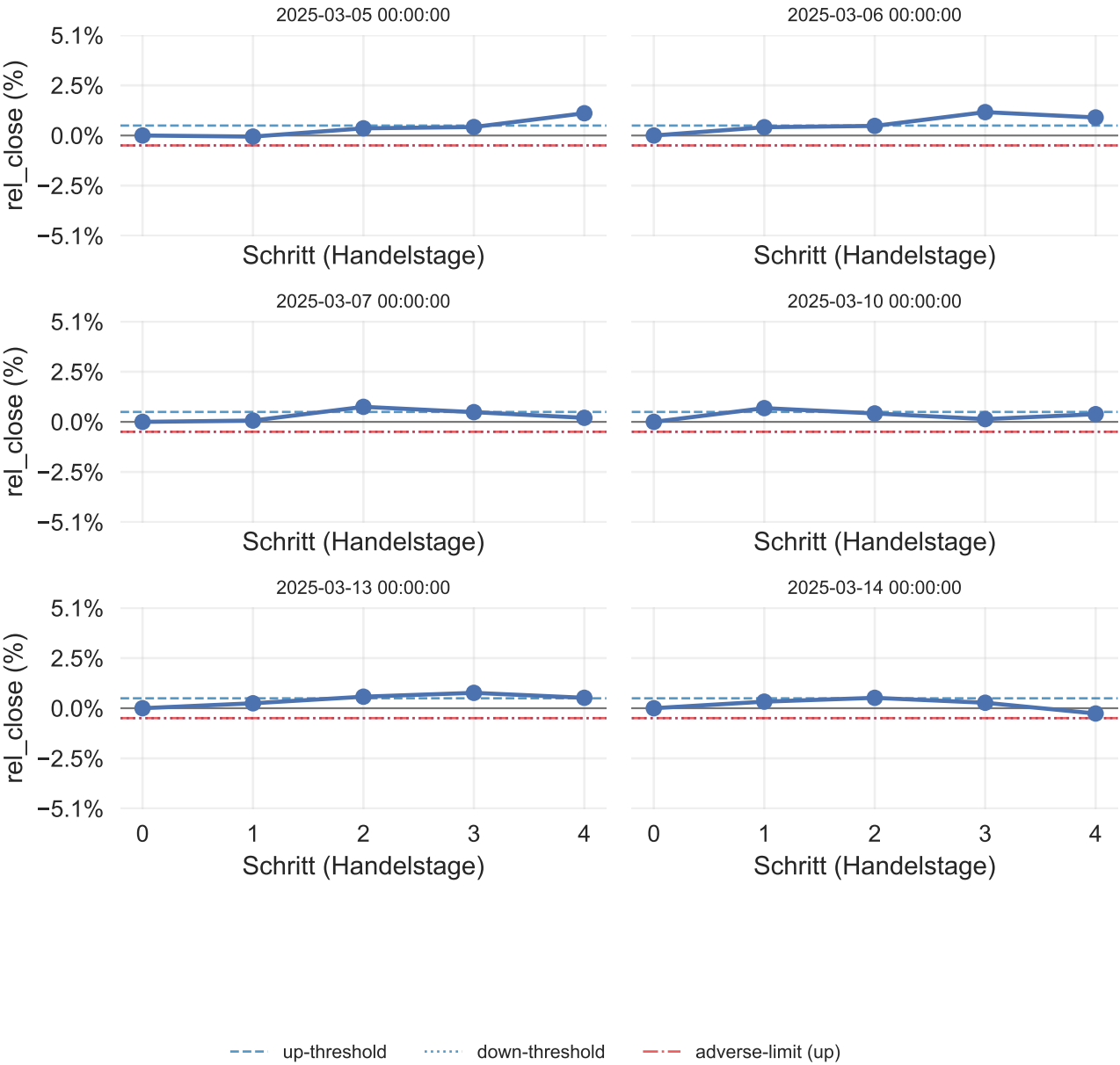


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.

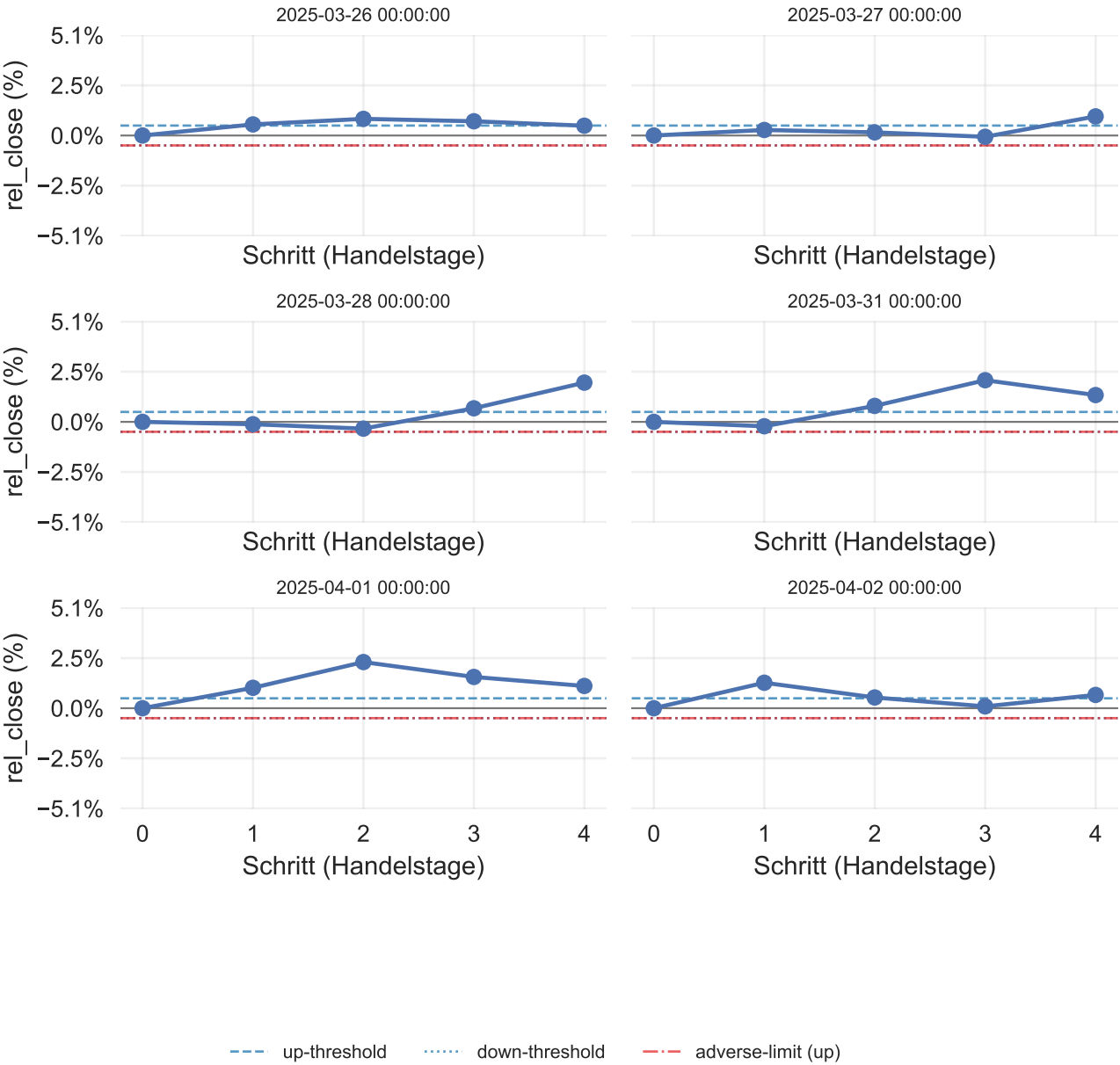


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.

Relativer Verlauf der Segmente (label='up') – Seite 7

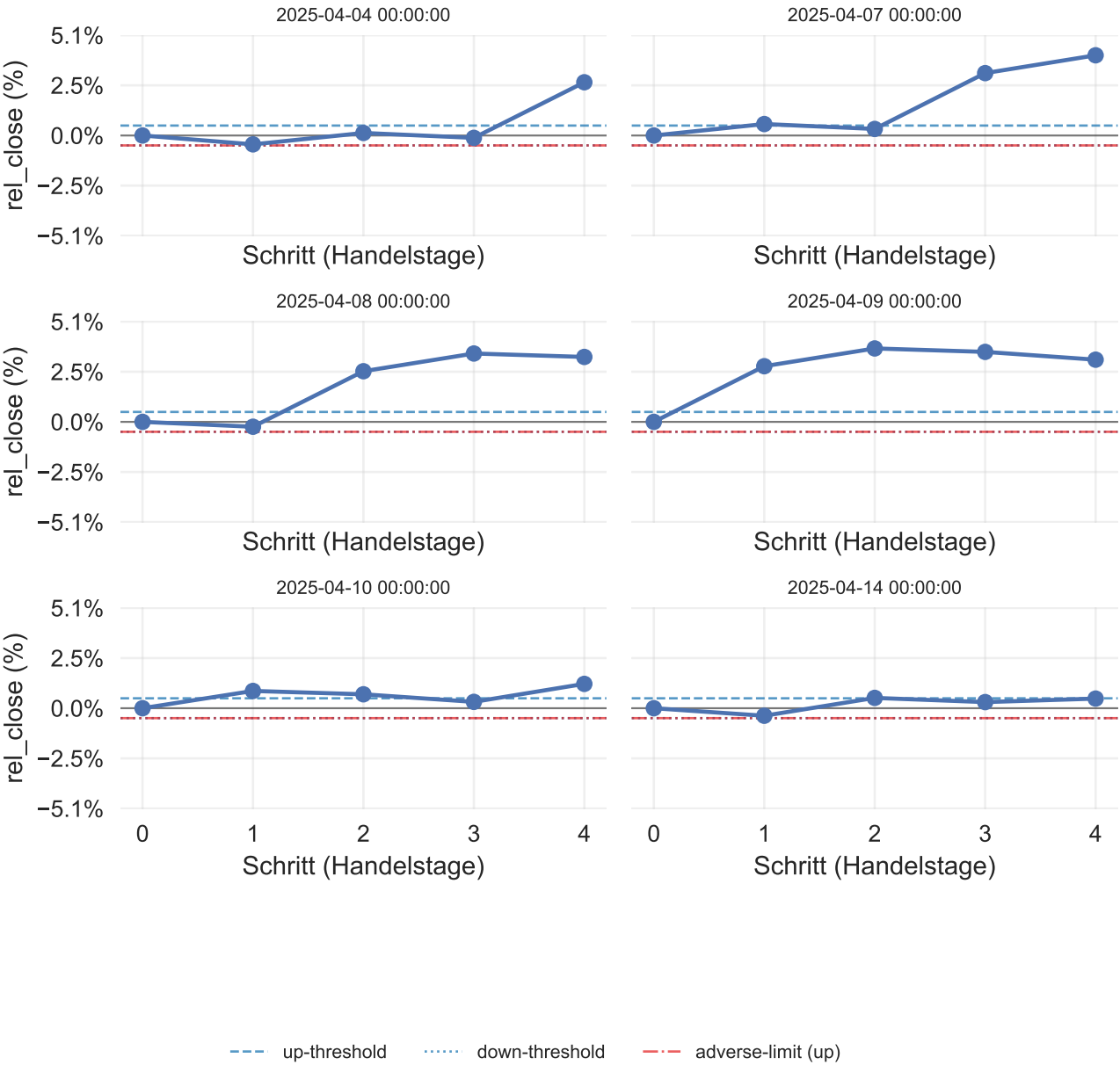


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.

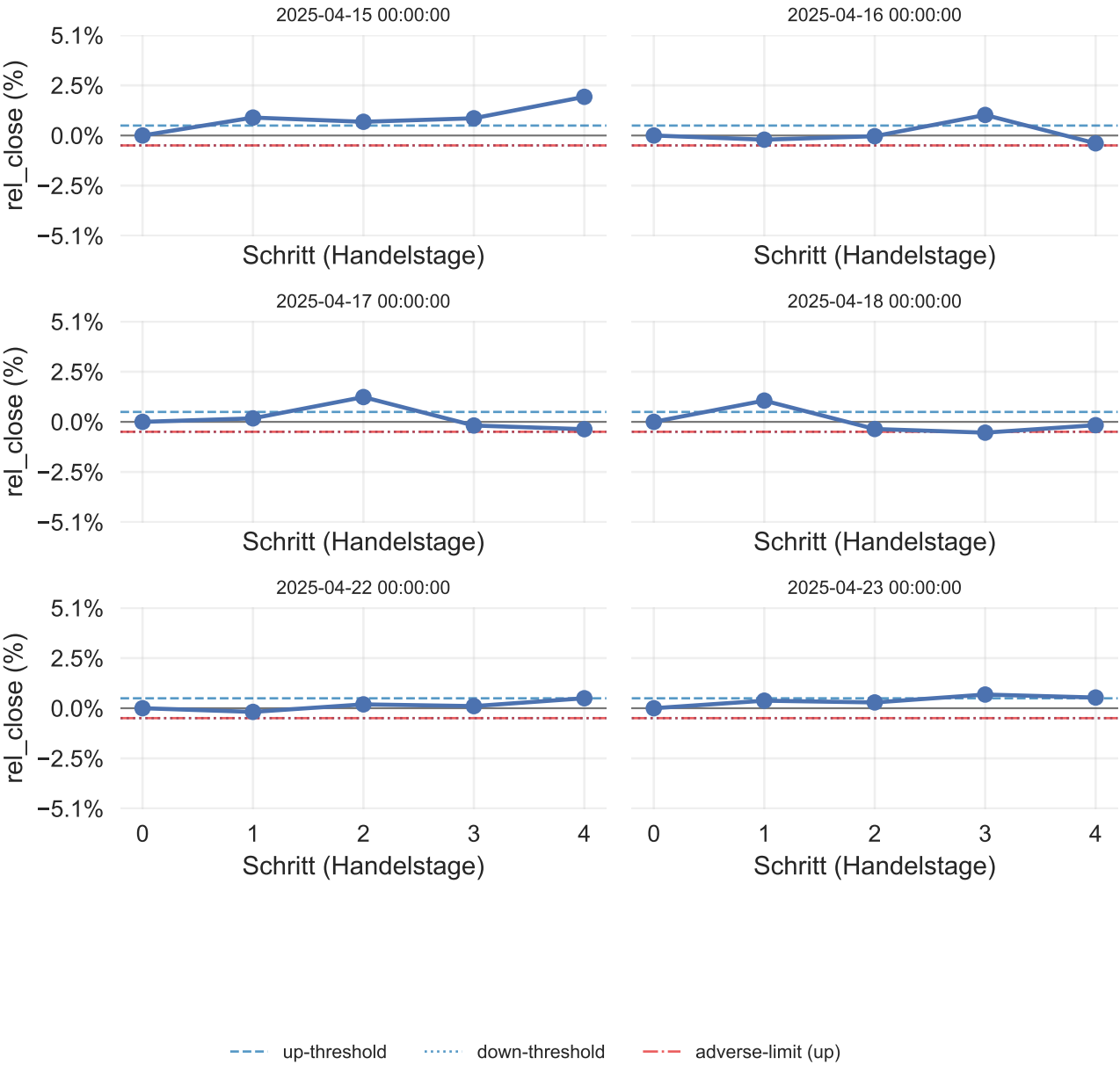


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.

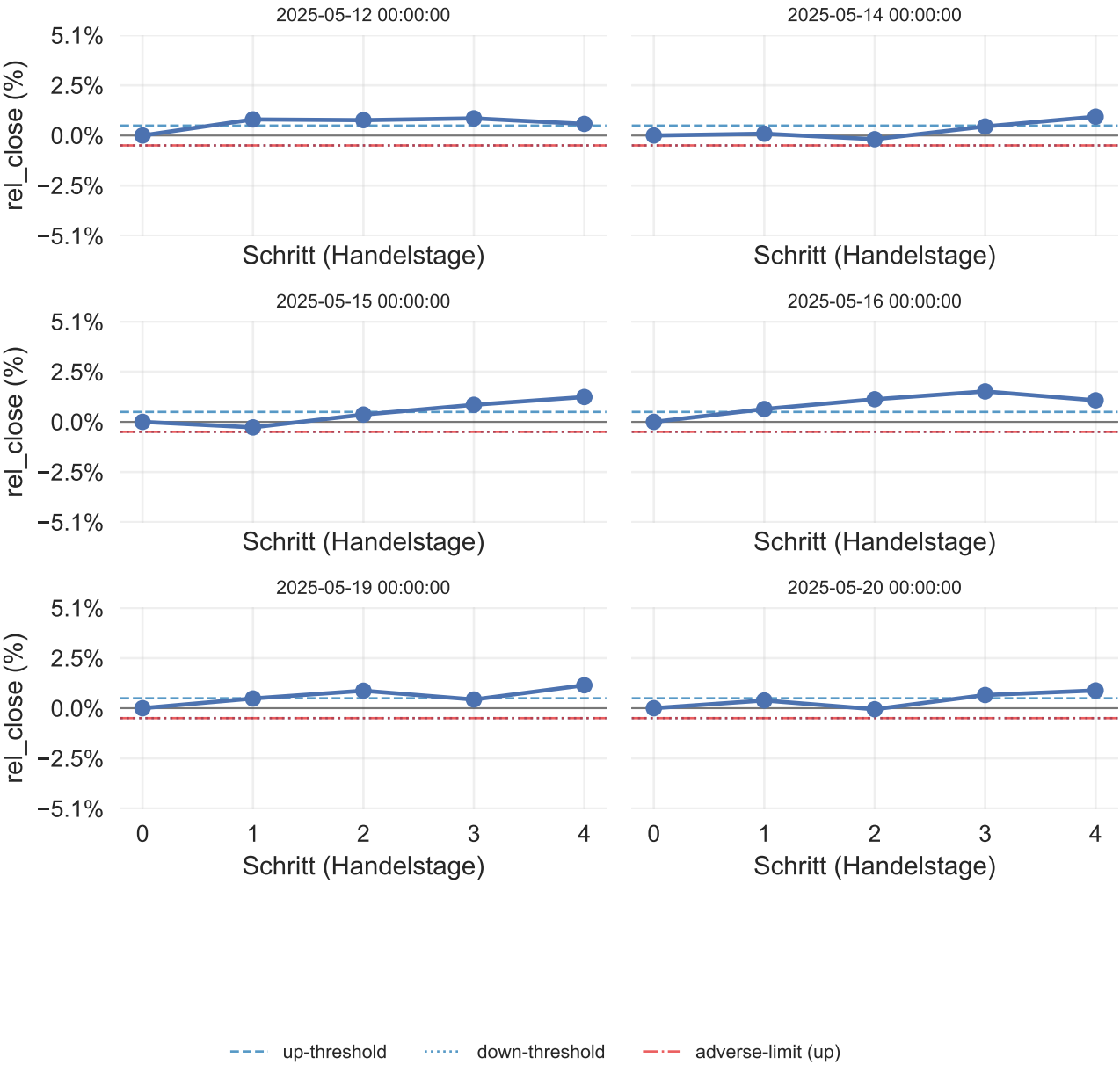


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.

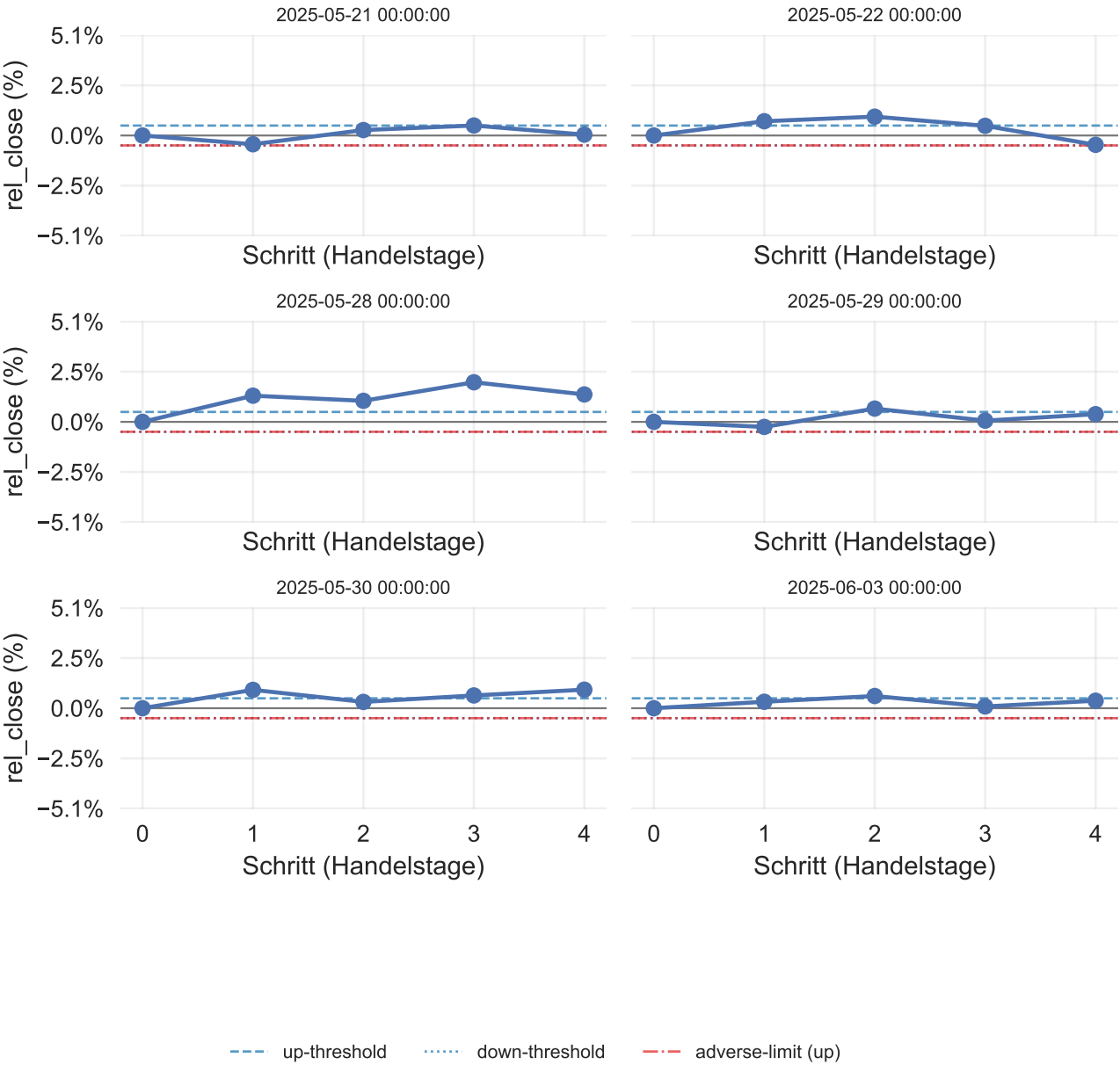


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.

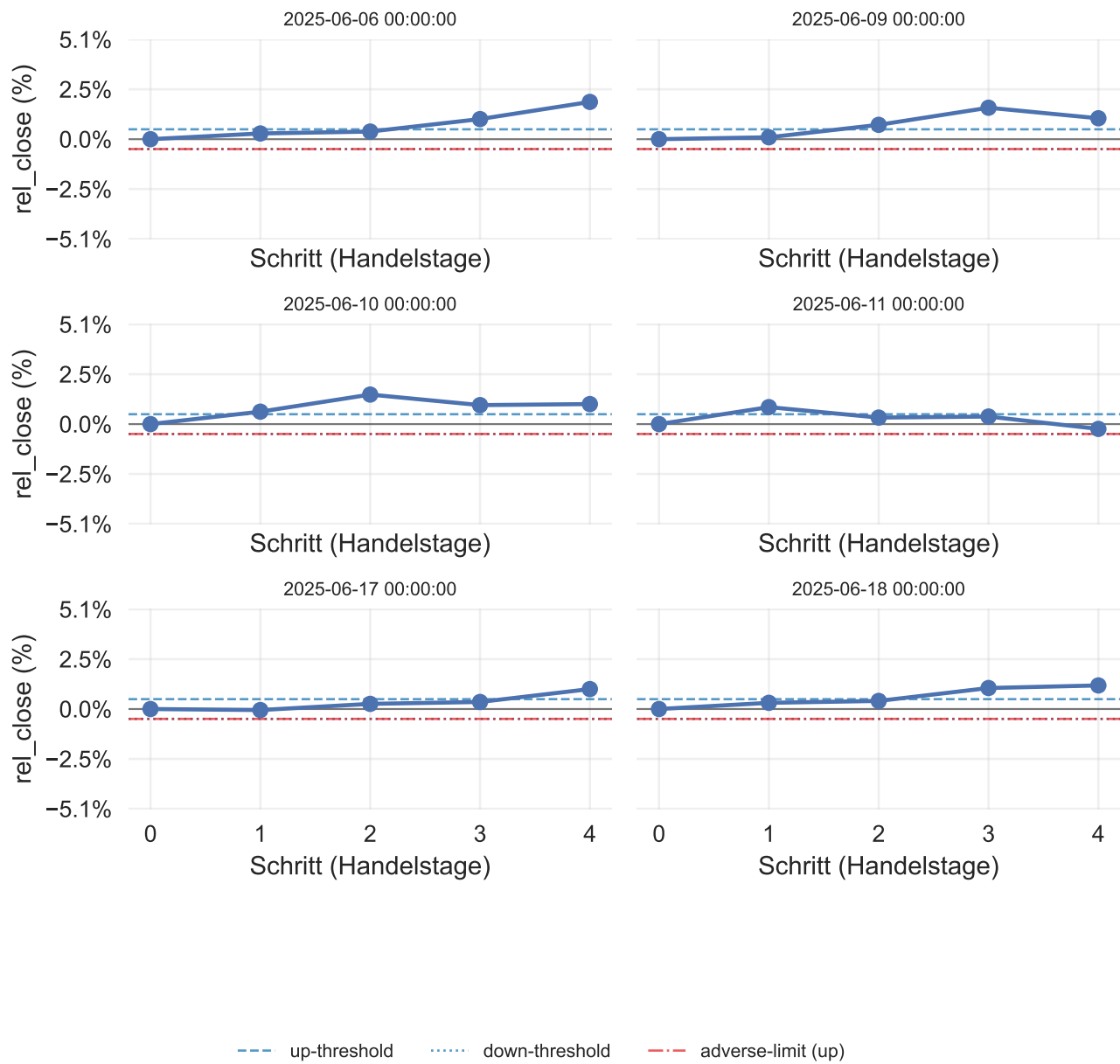


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.

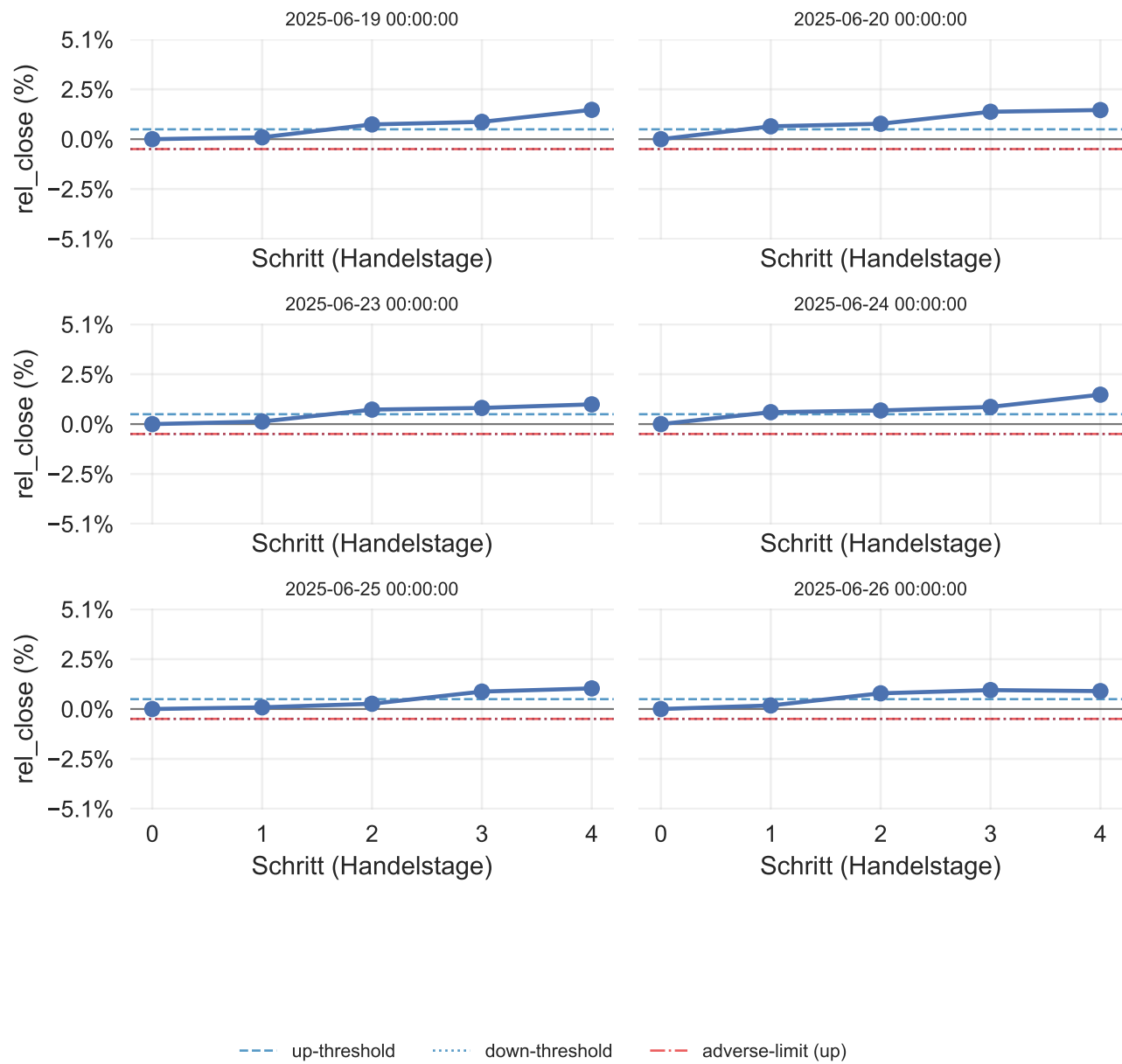


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.

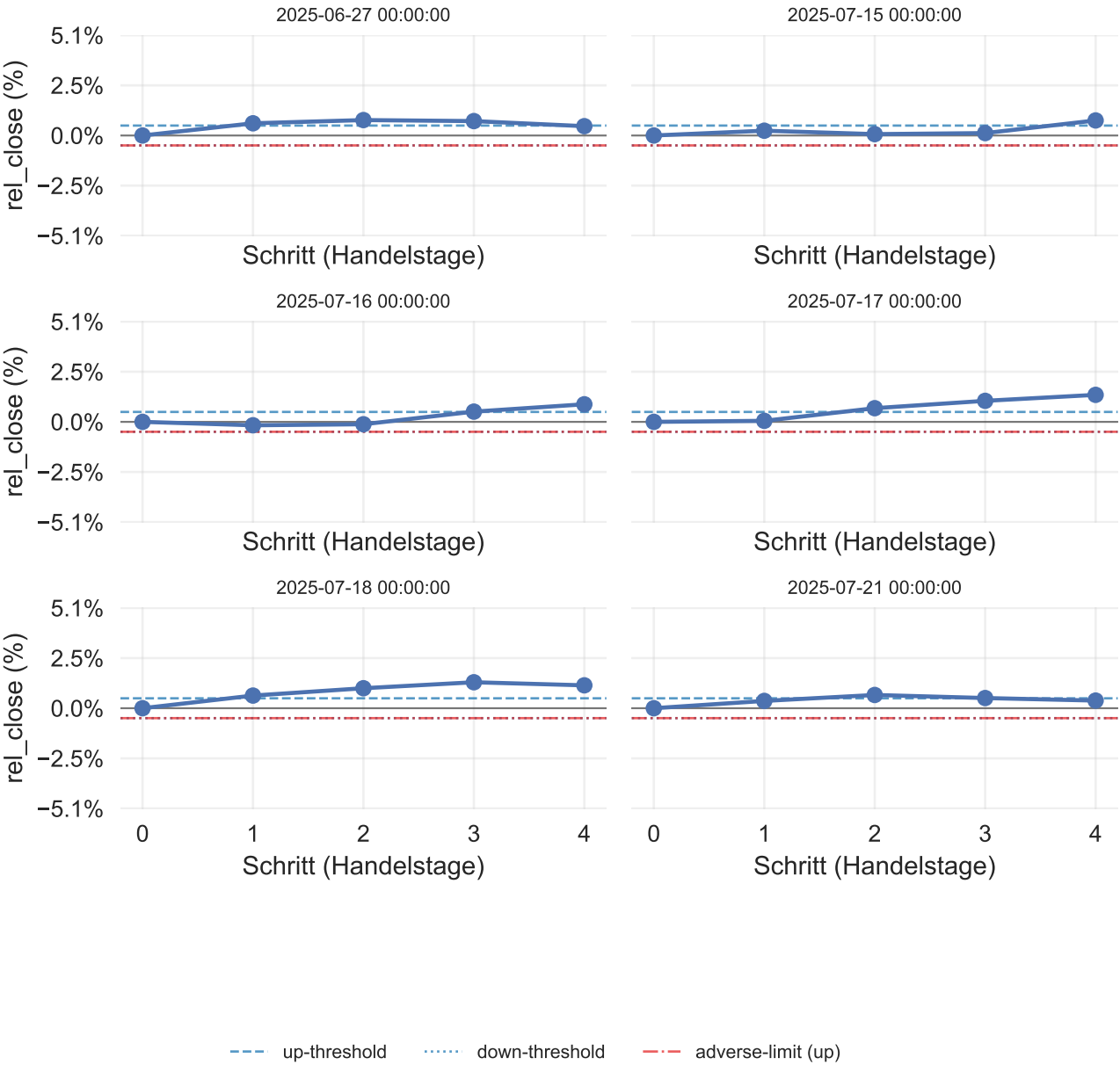


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.

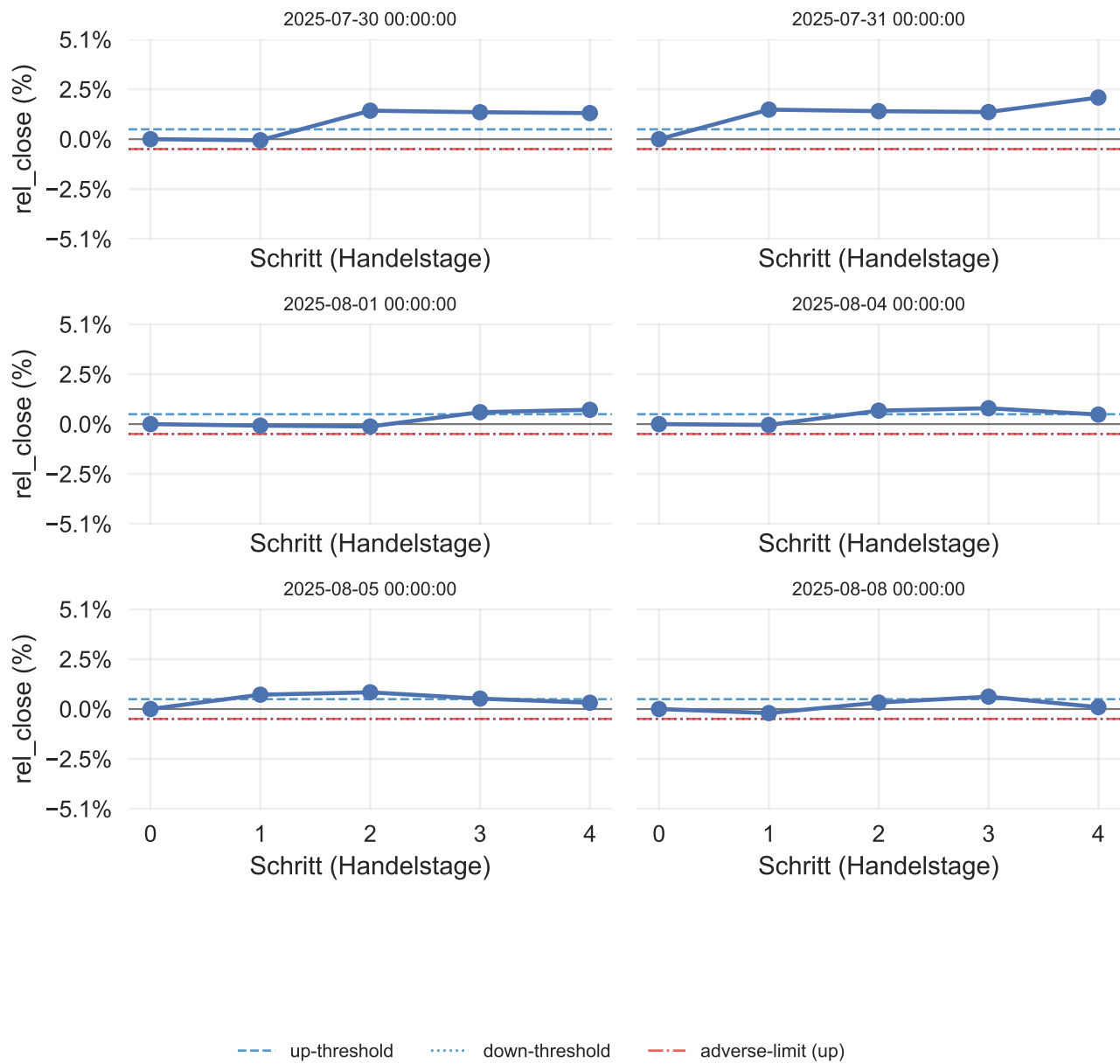


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.

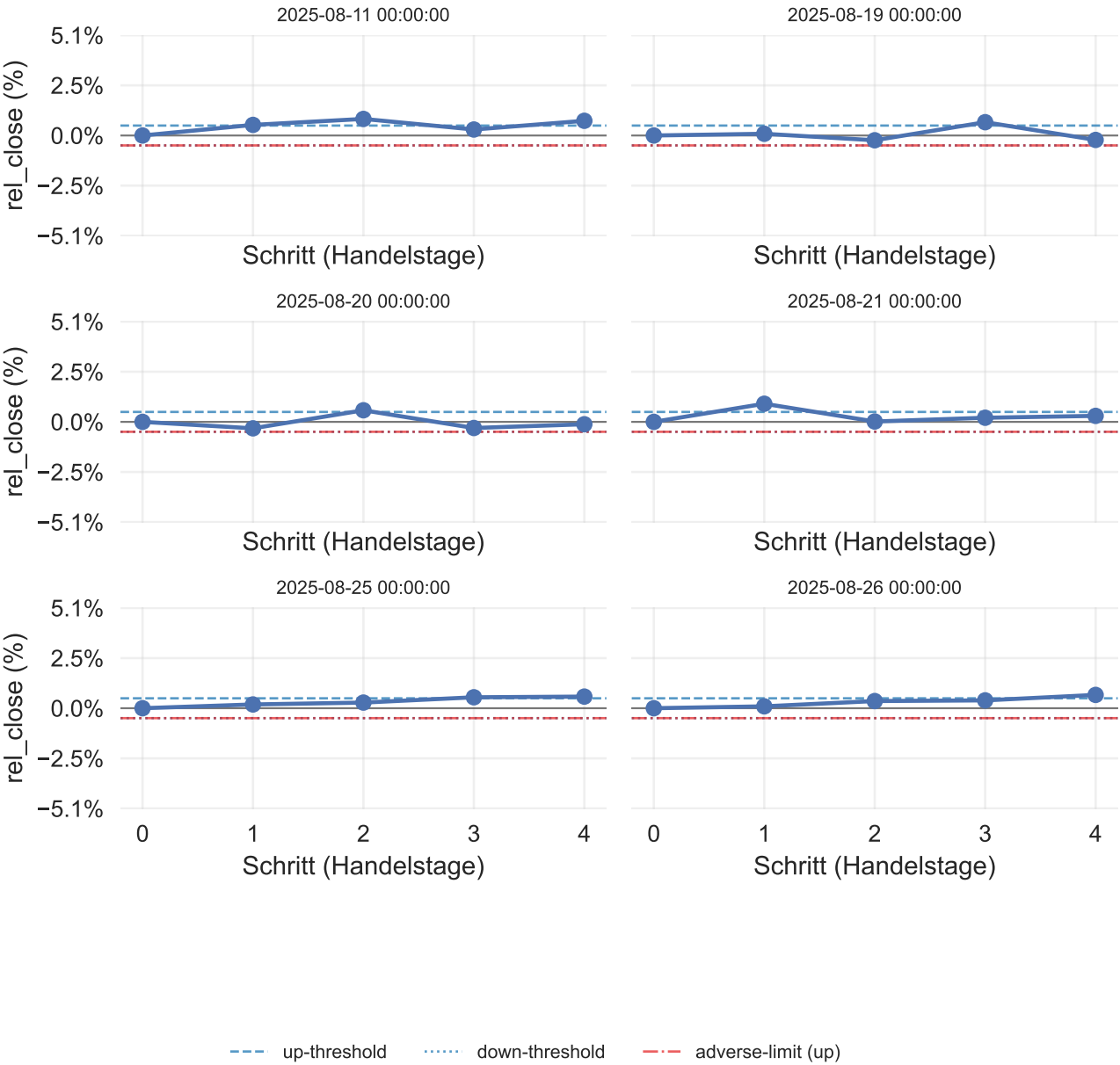


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.

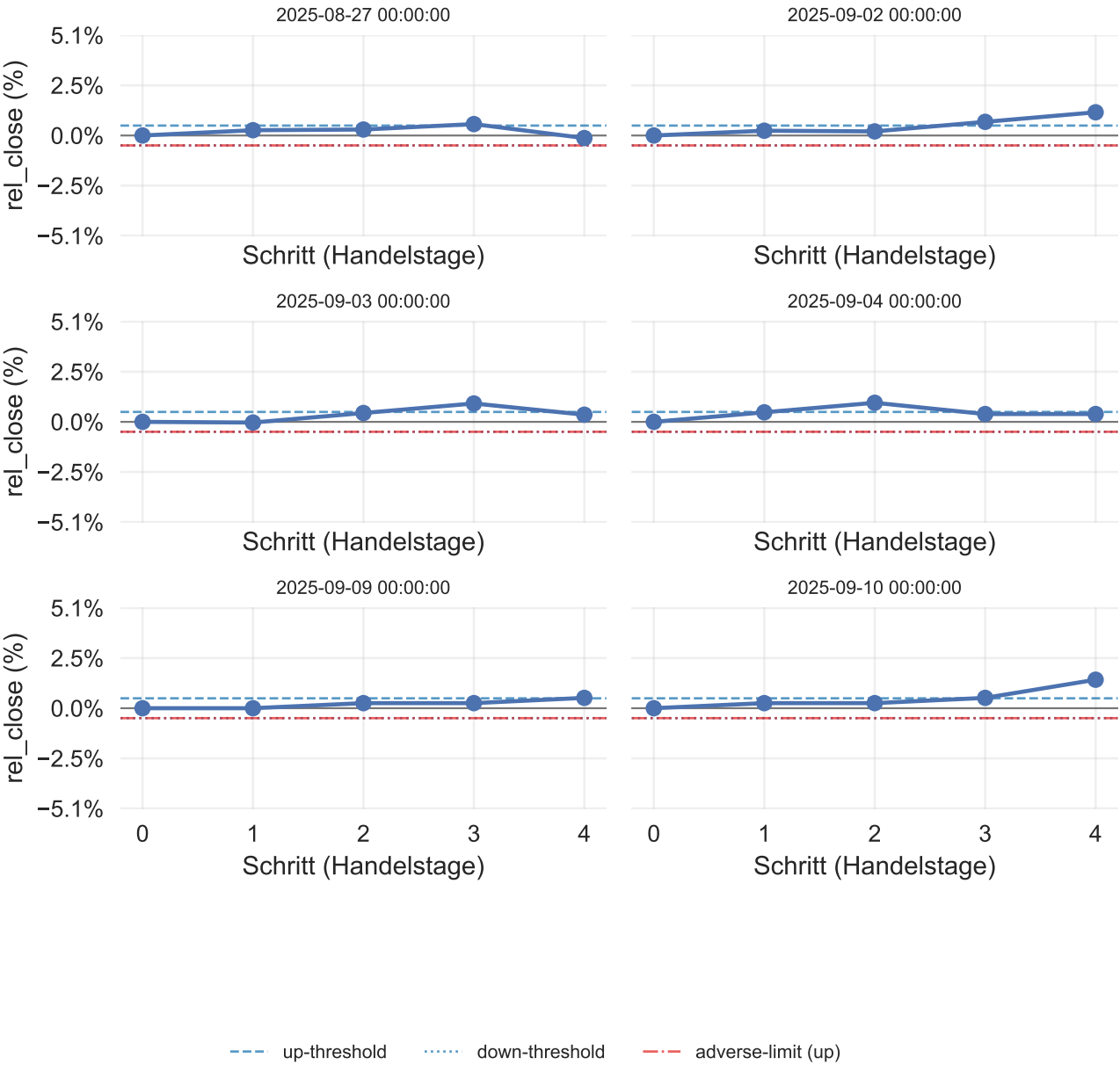


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.

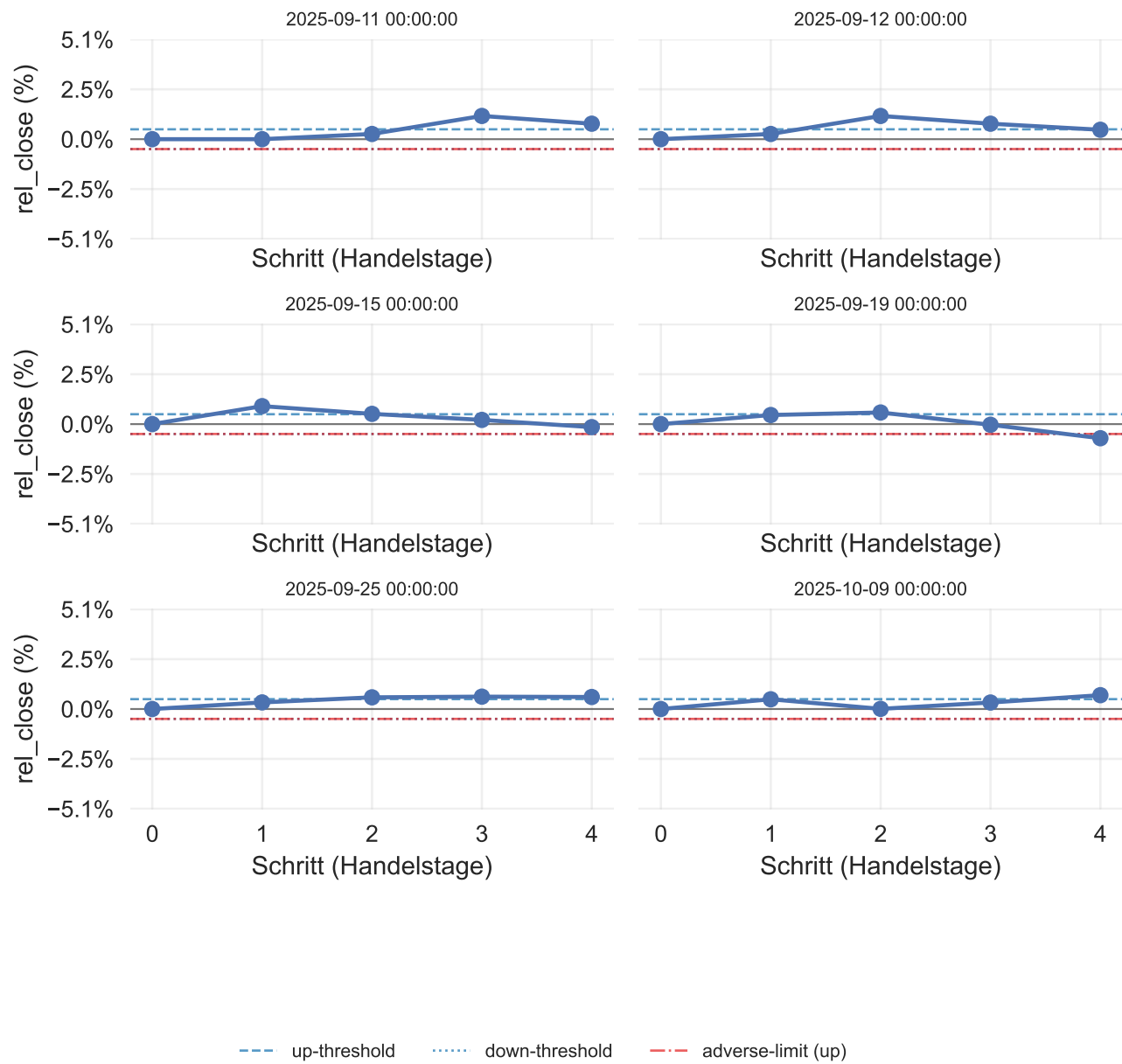


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.

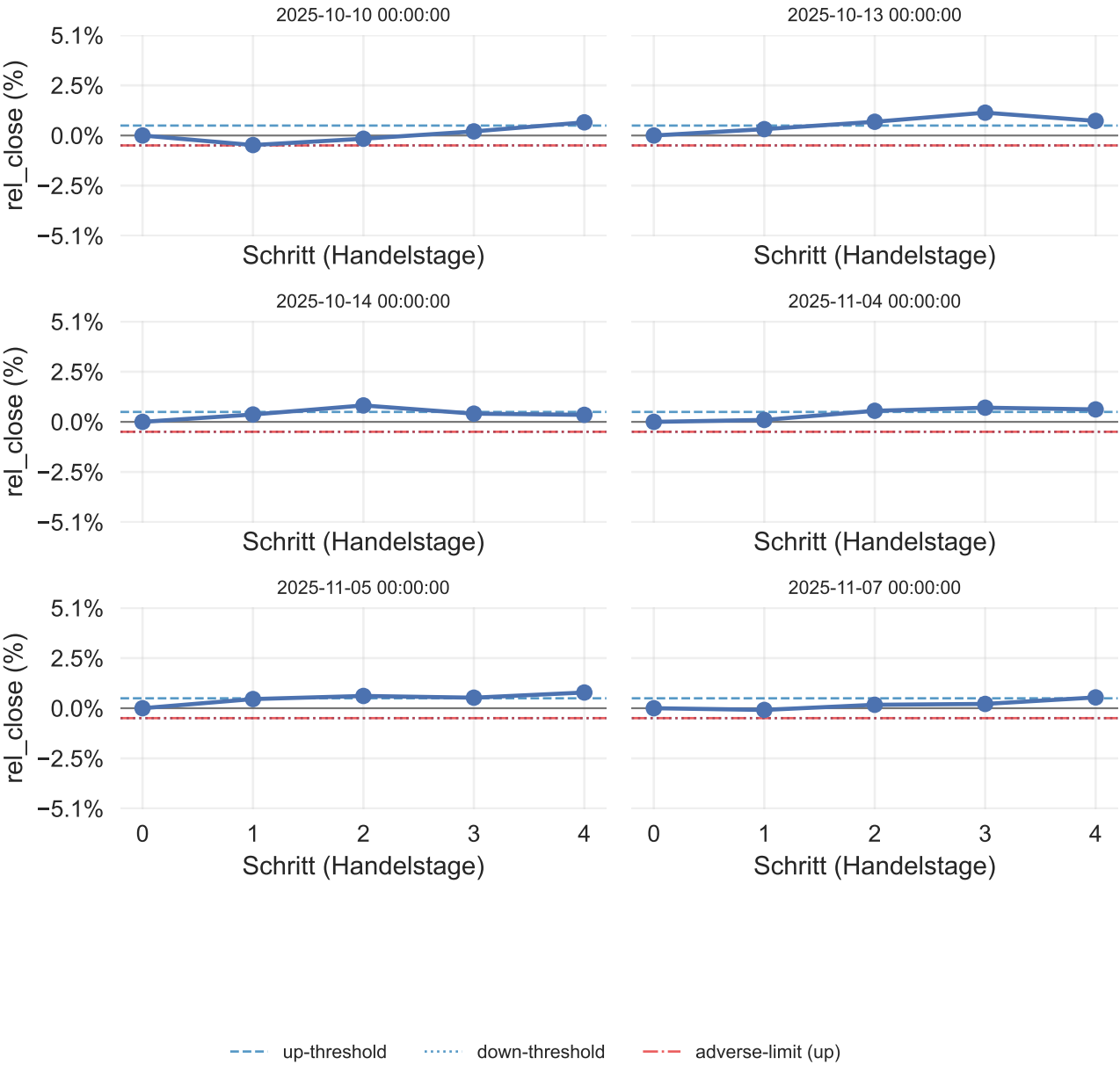


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.



Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'up'.

EURUSD-Segmente mit label='down' (Test-Split) – Seite 1/4

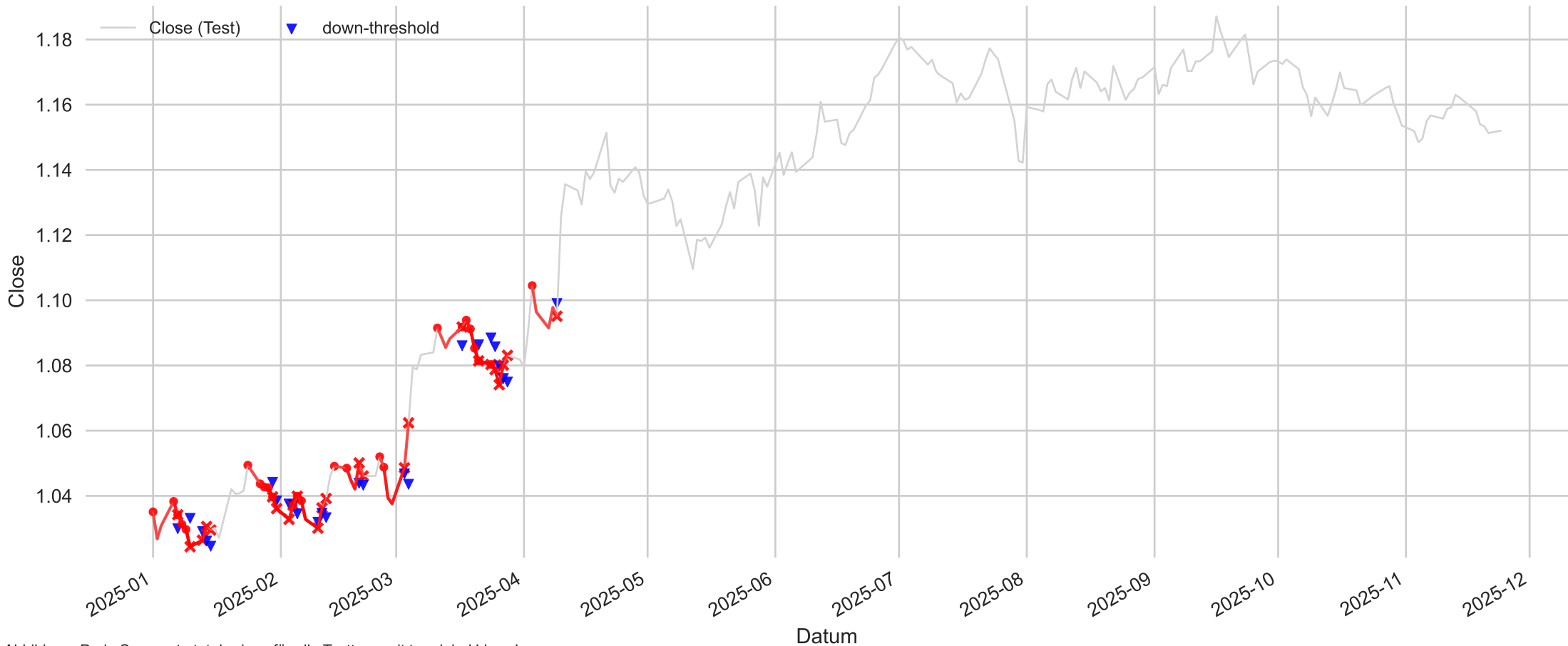


Abbildung: Preis-Segmente $t..t+\text{horizon}$ für alle Testtage mit true label 'down'.

EURUSD-Segmente mit label='down' (Test-Split) – Seite 2/4

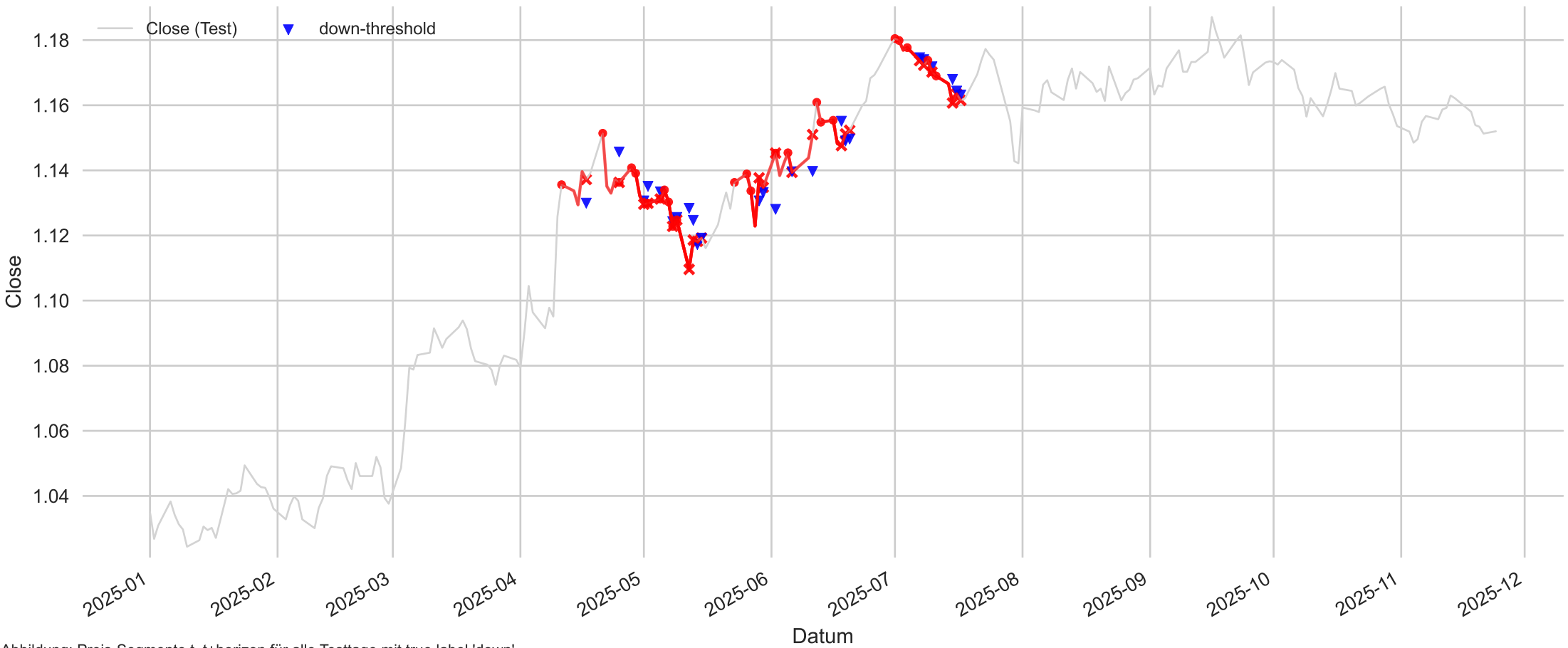


Abbildung: Preis-Segmente $t..t+\text{horizon}$ für alle Testtage mit true label 'down'.

EURUSD-Segmente mit label='down' (Test-Split) – Seite 3/4

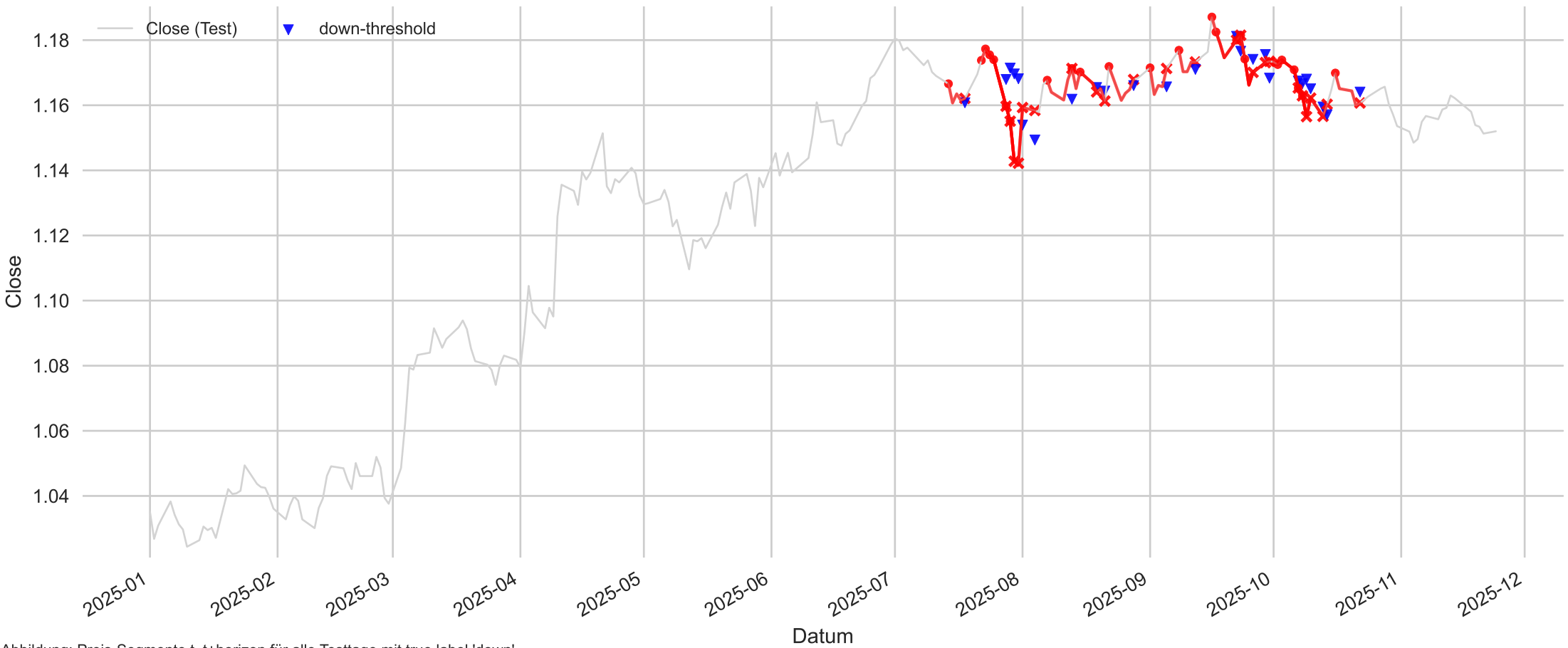


Abbildung: Preis-Segmente $t..t+\text{horizon}$ für alle Testtage mit true label 'down'.

EURUSD-Segmente mit label='down' (Test-Split) – Seite 4/4

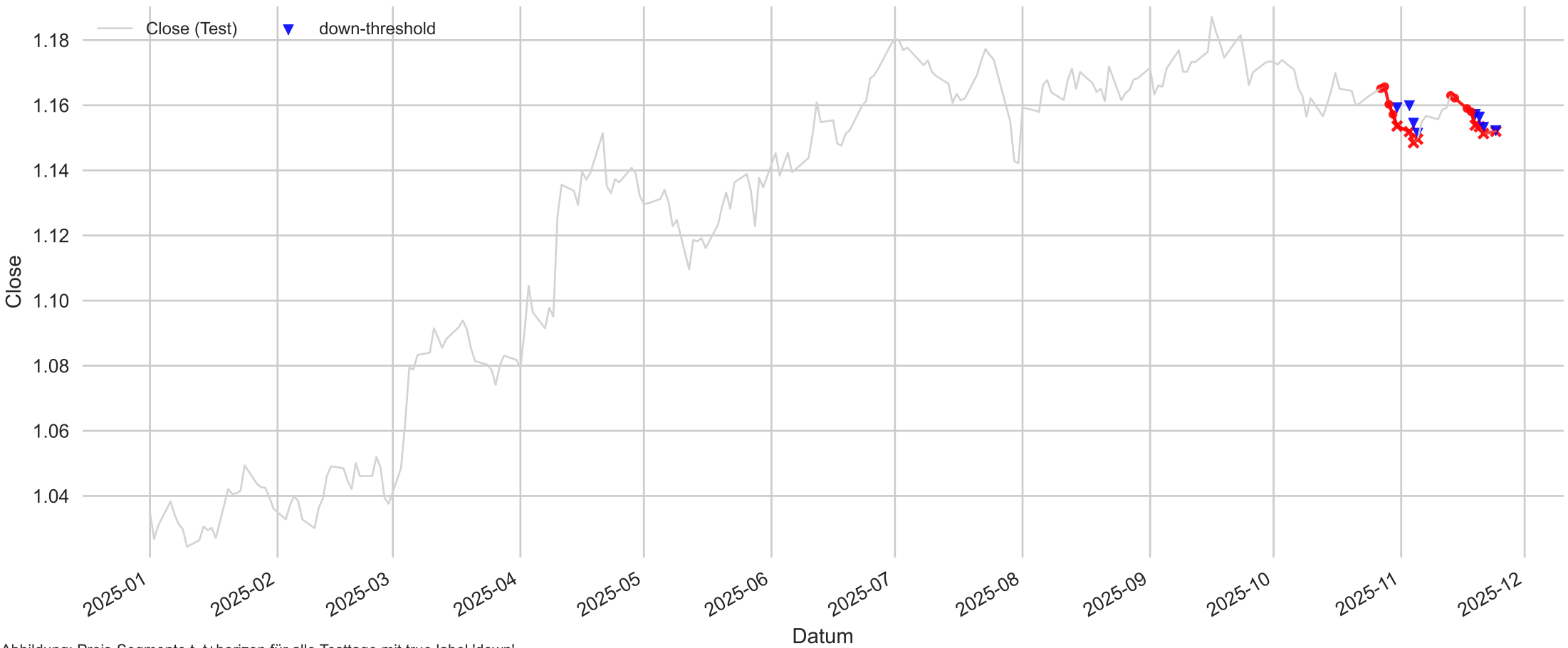


Abbildung: Preis-Segmente $t..t+\text{horizon}$ für alle Testtage mit true label 'down'.

Relativer Verlauf der Segmente (label='down') – Seite 1

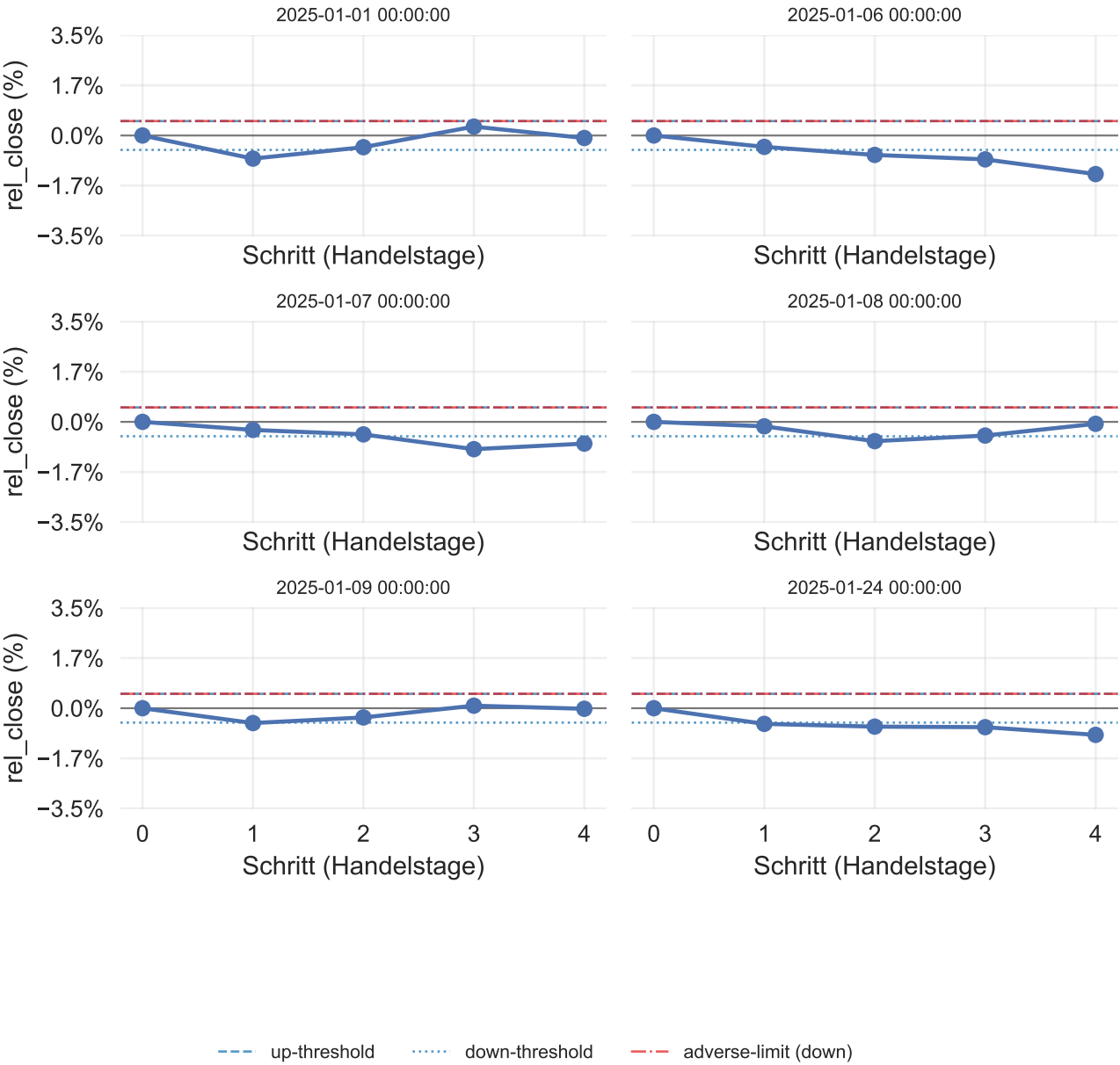


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'down'.

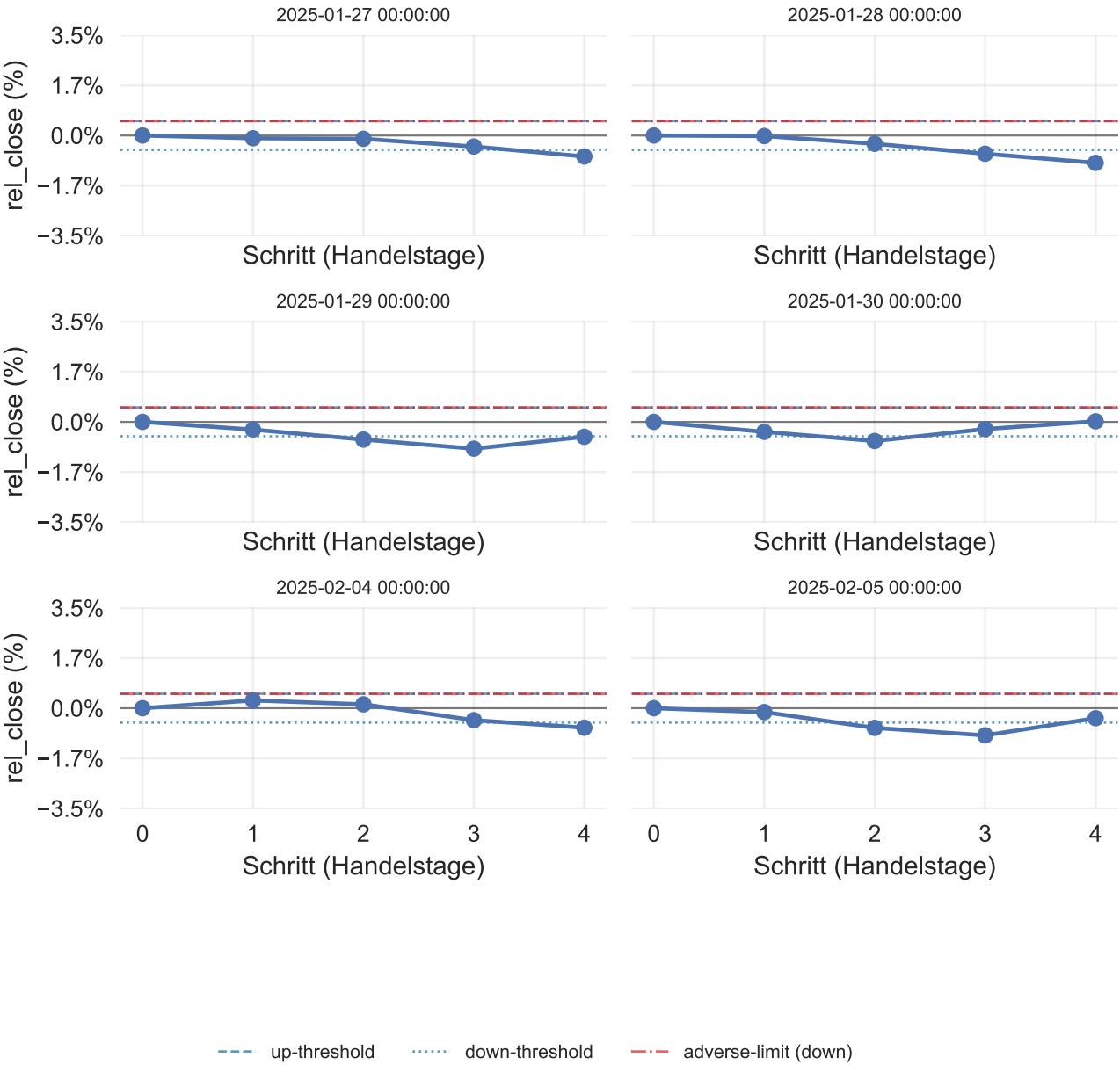


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'down'.

Relativer Verlauf der Segmente (label='down') – Seite 3

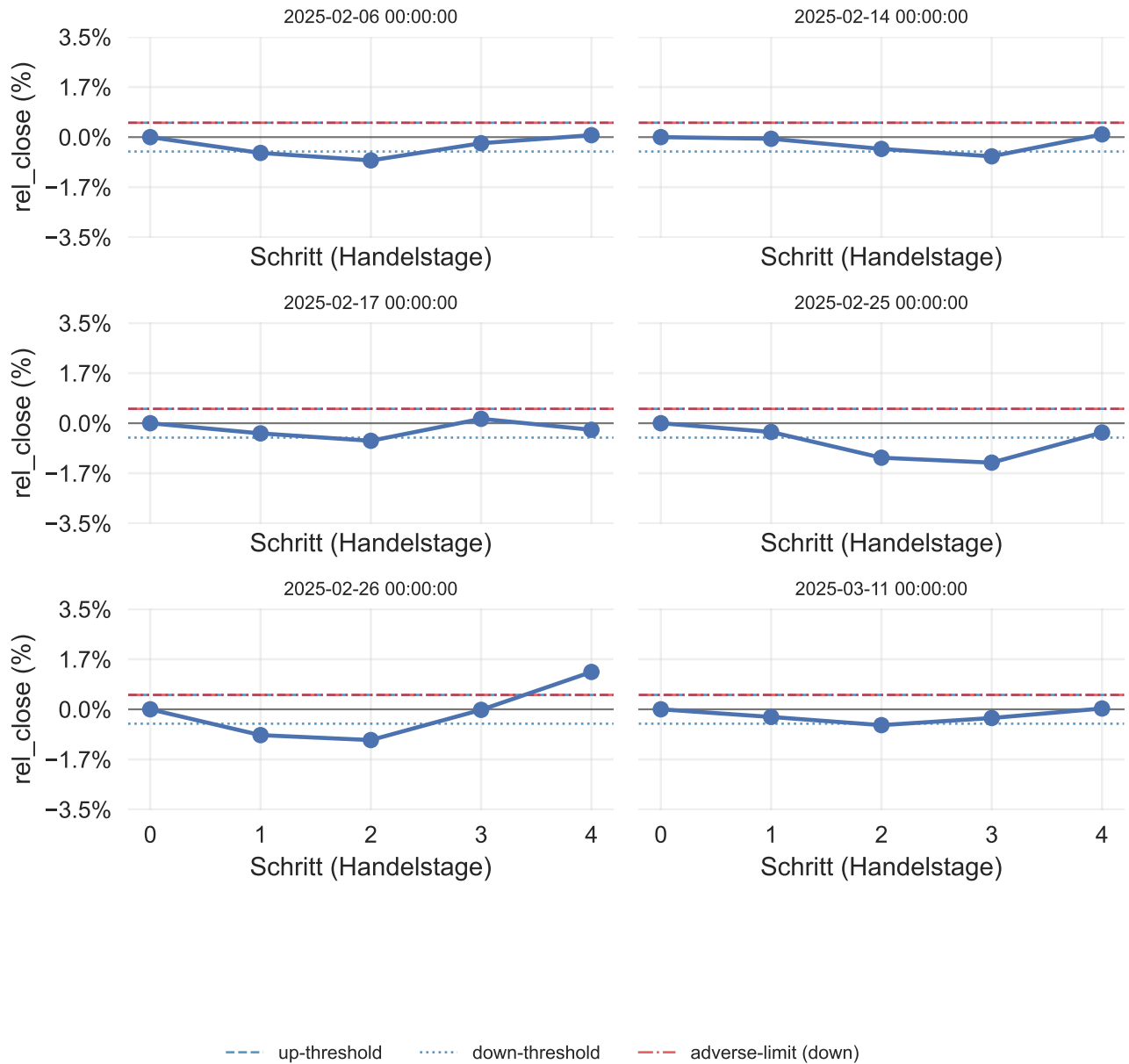


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'down'.

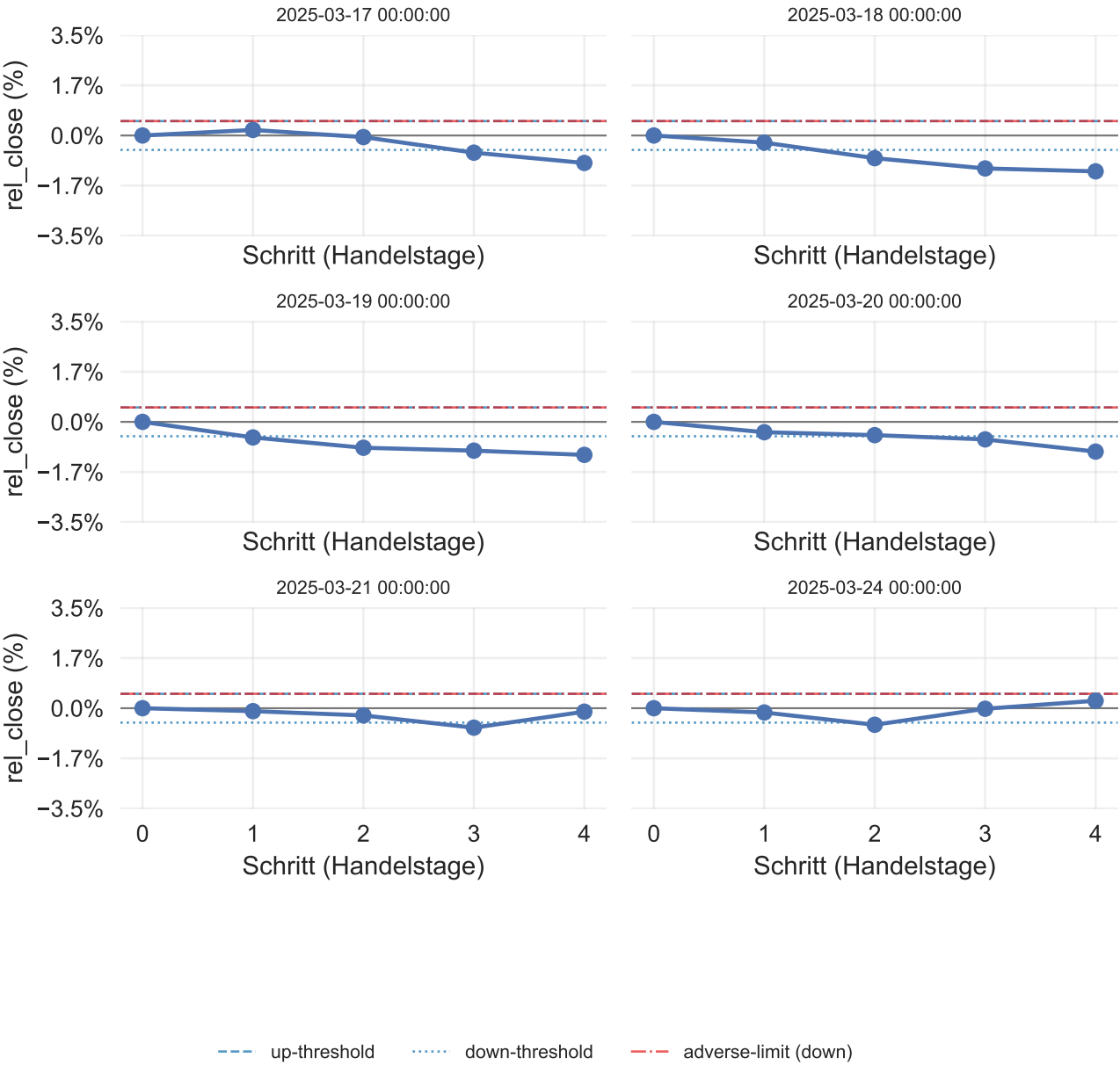


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'down'.

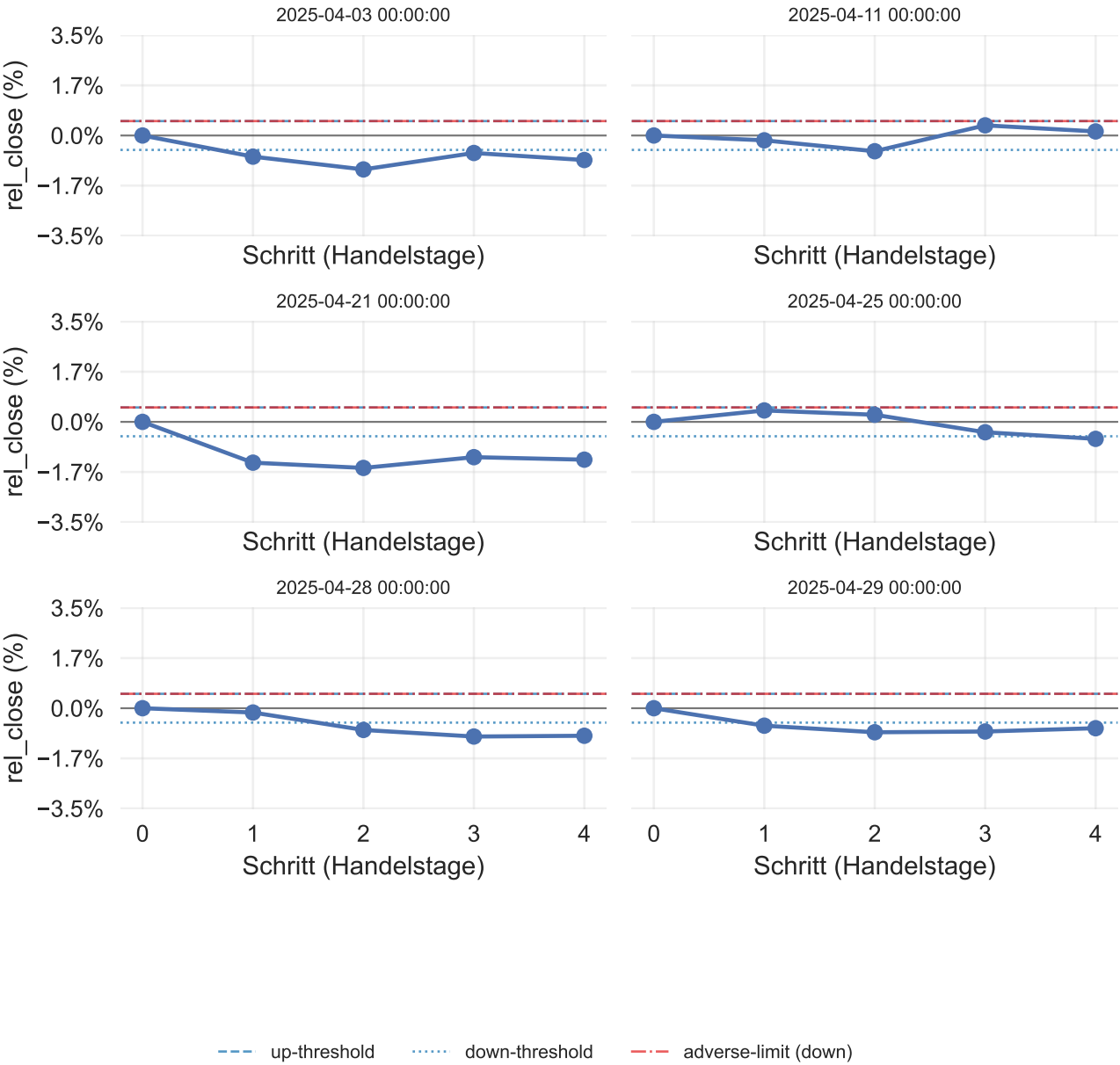


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'down'.

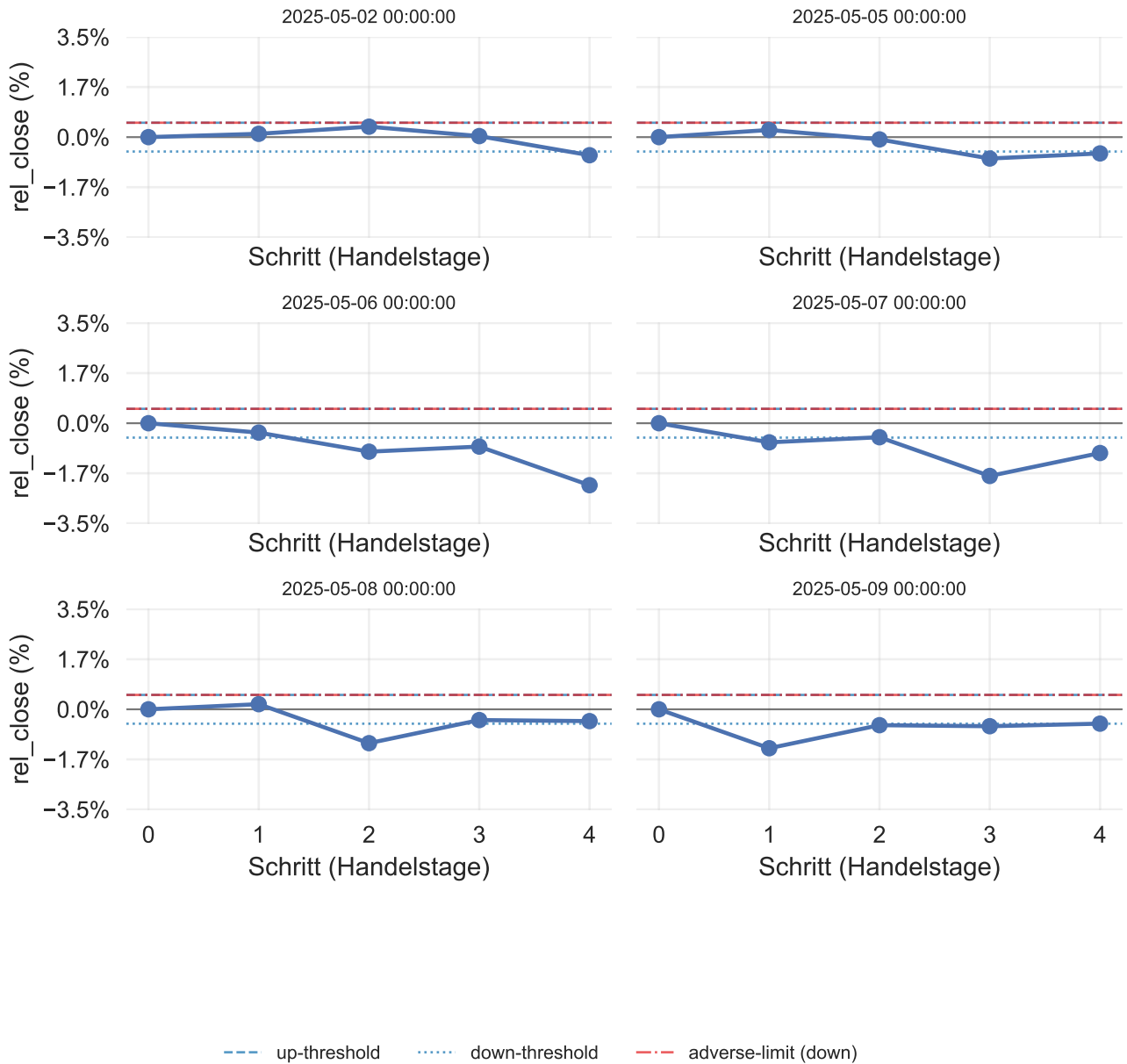


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'down'.

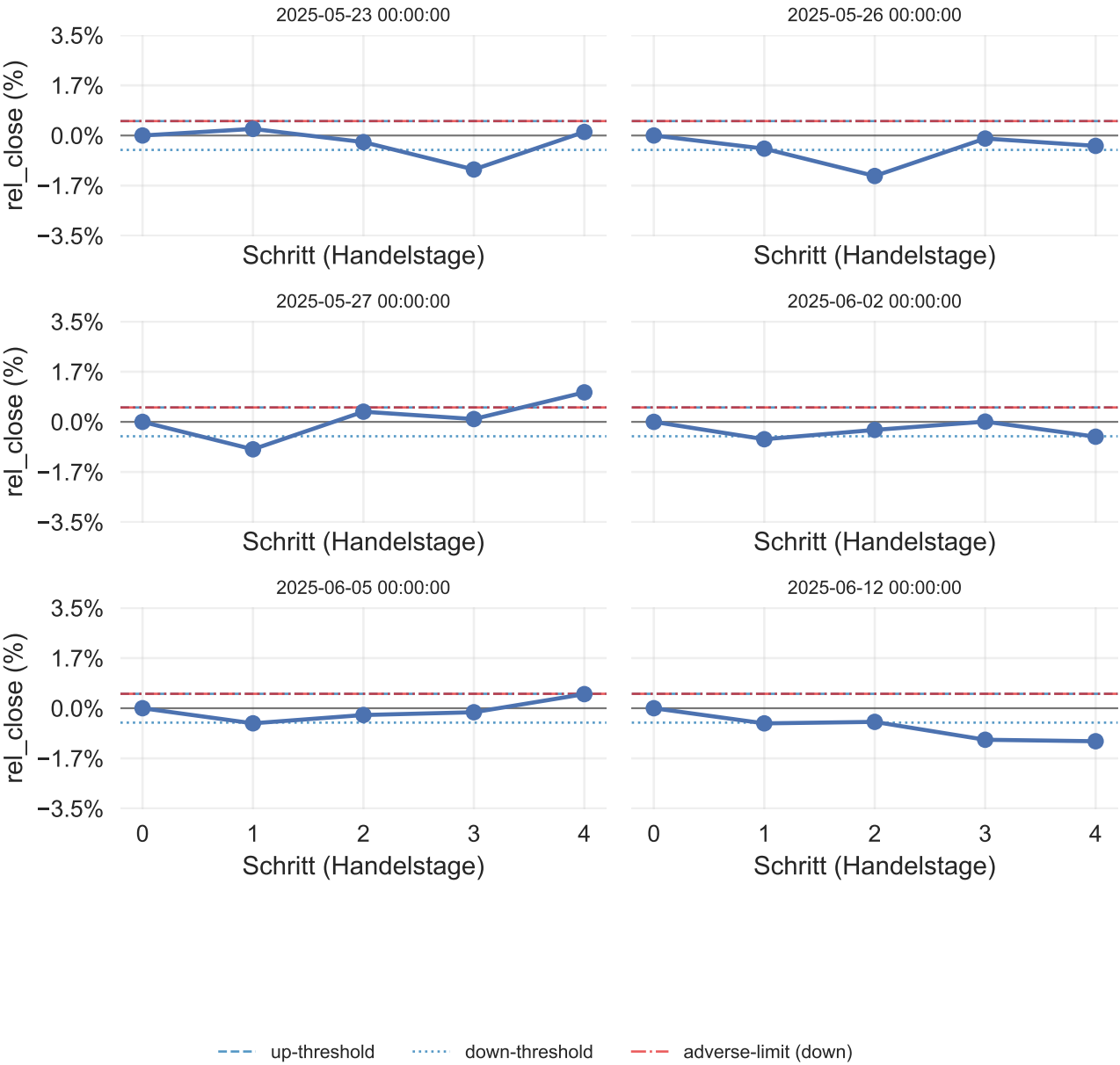


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'down'.

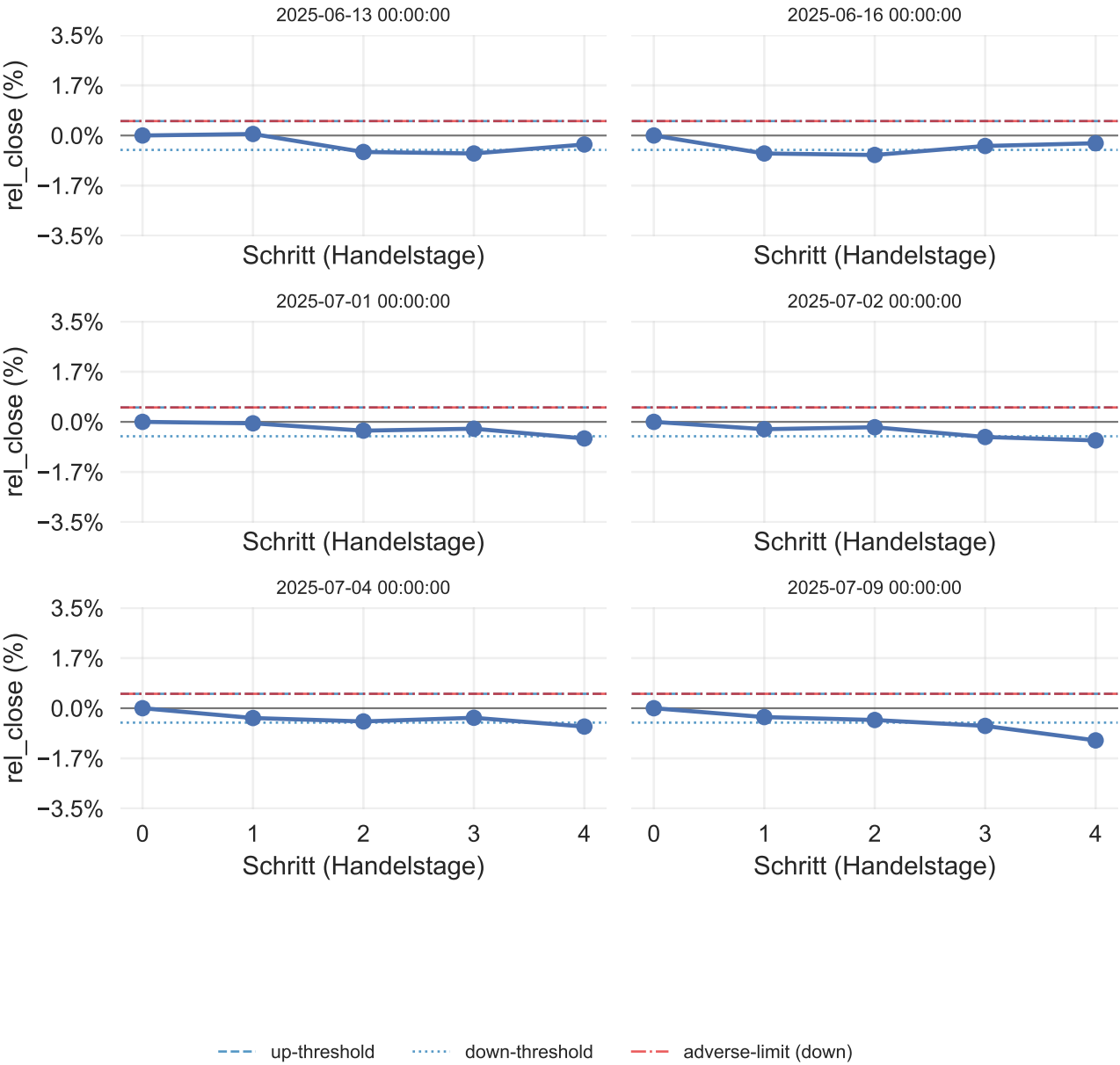


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'down'.

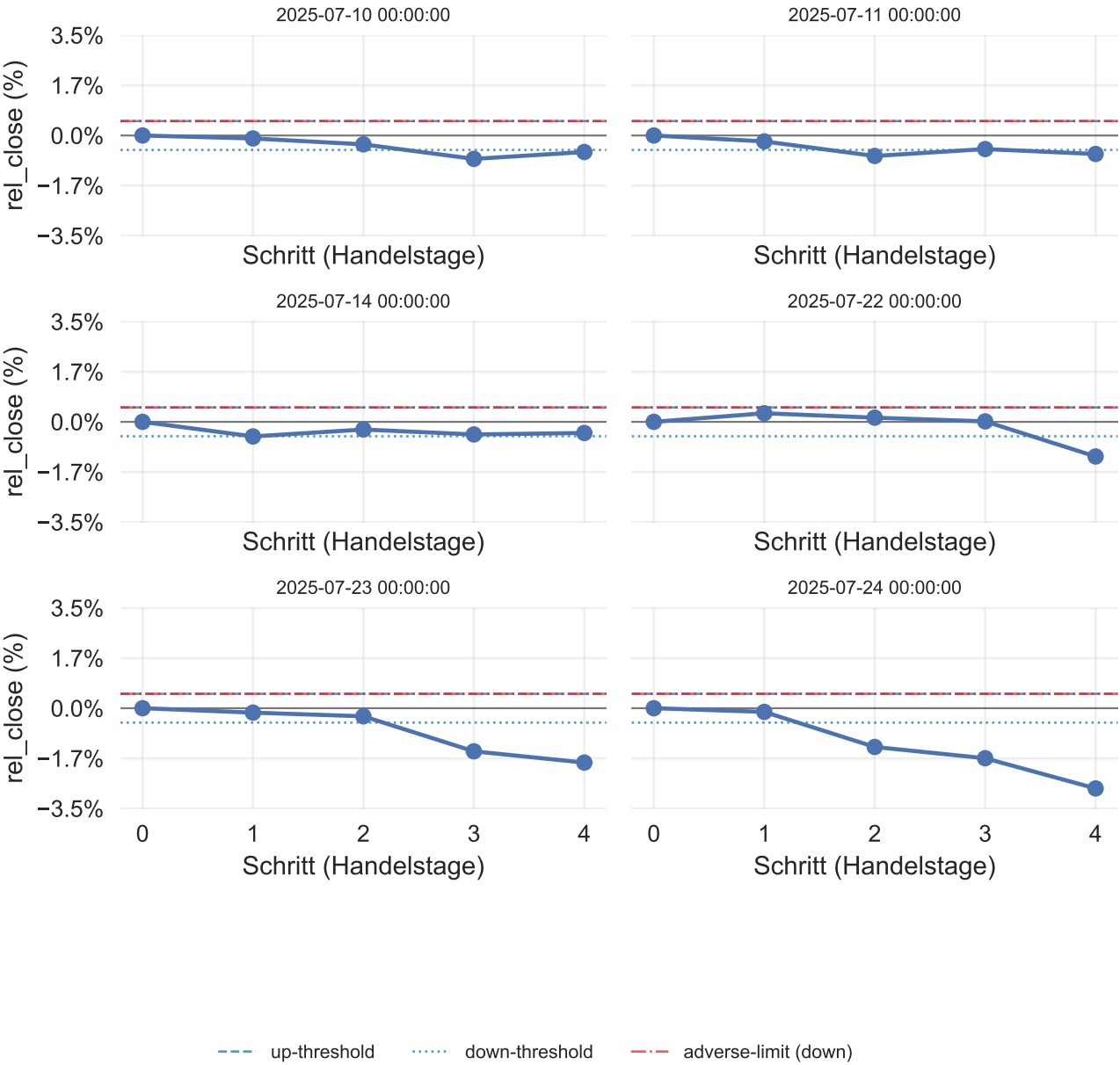


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'down'.

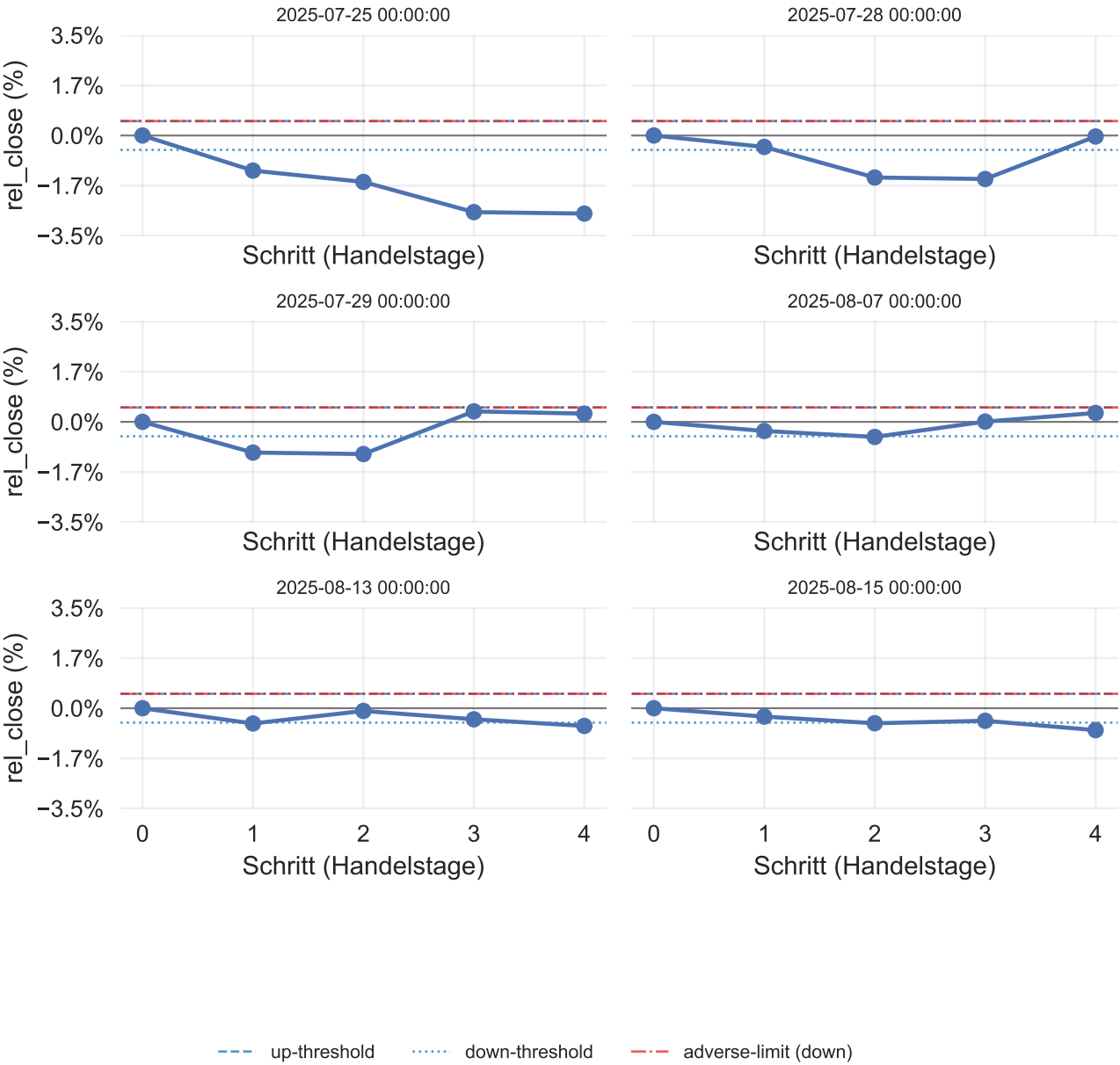


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'down'.

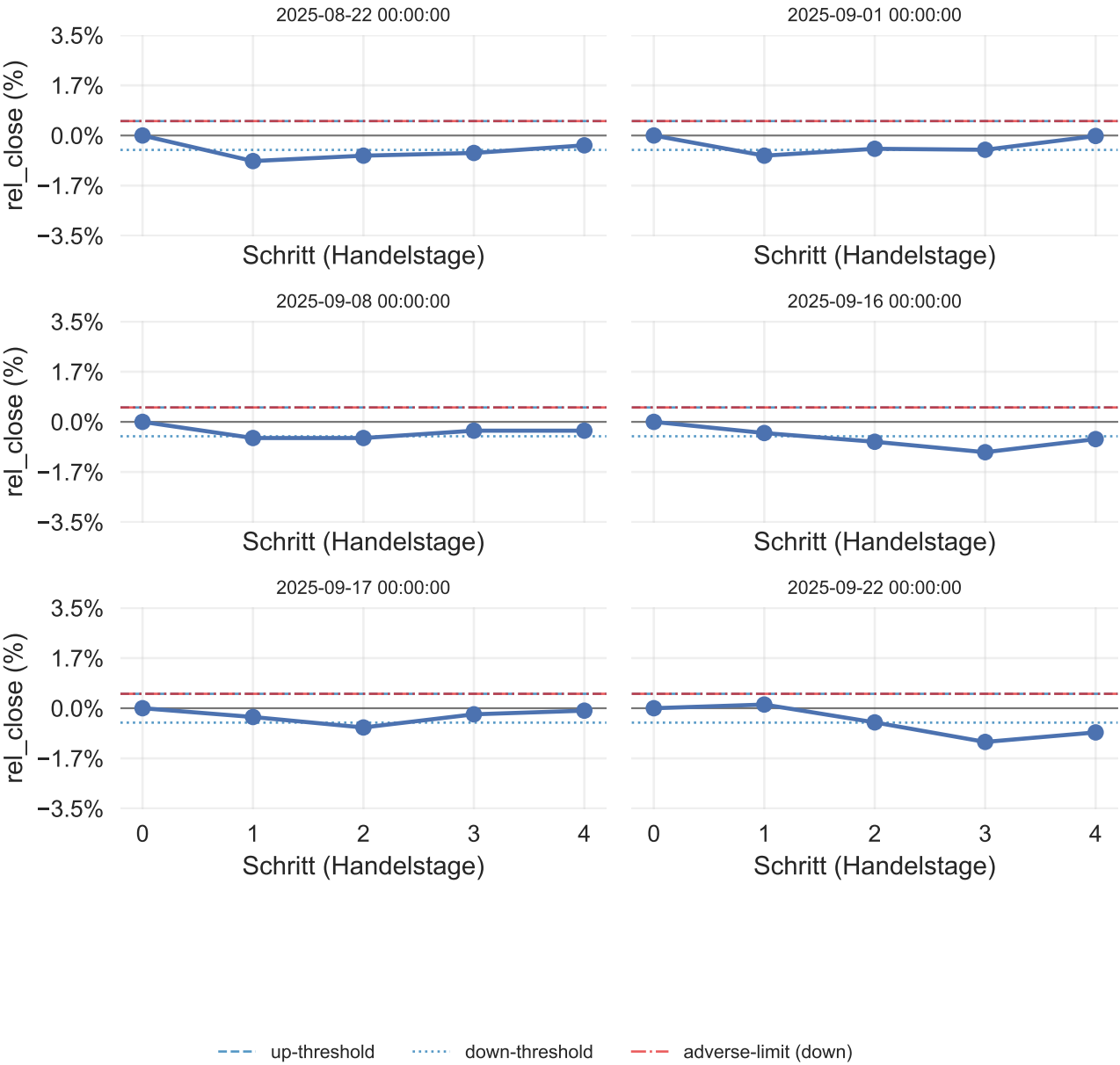


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'down'.

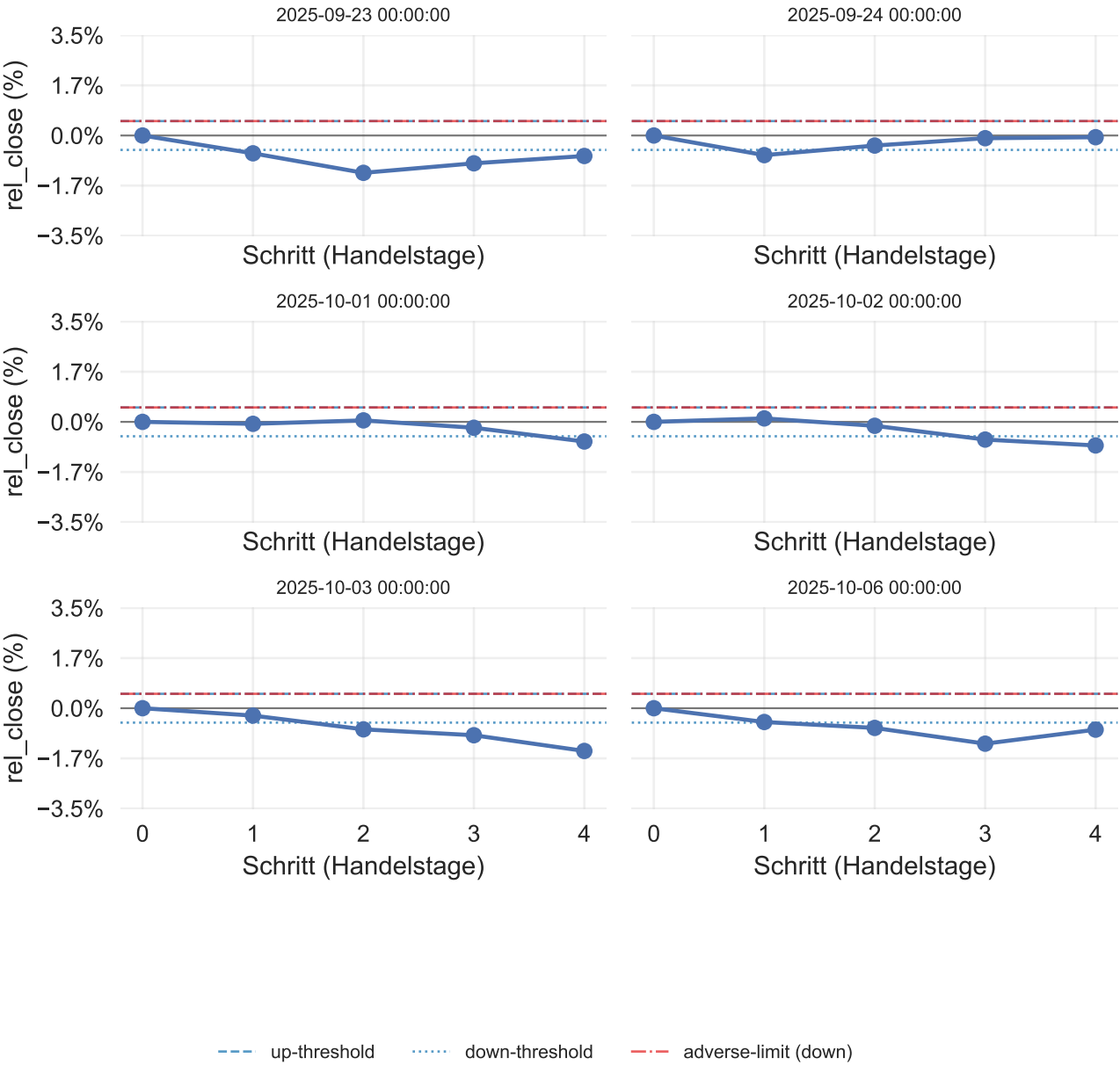


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'down'.

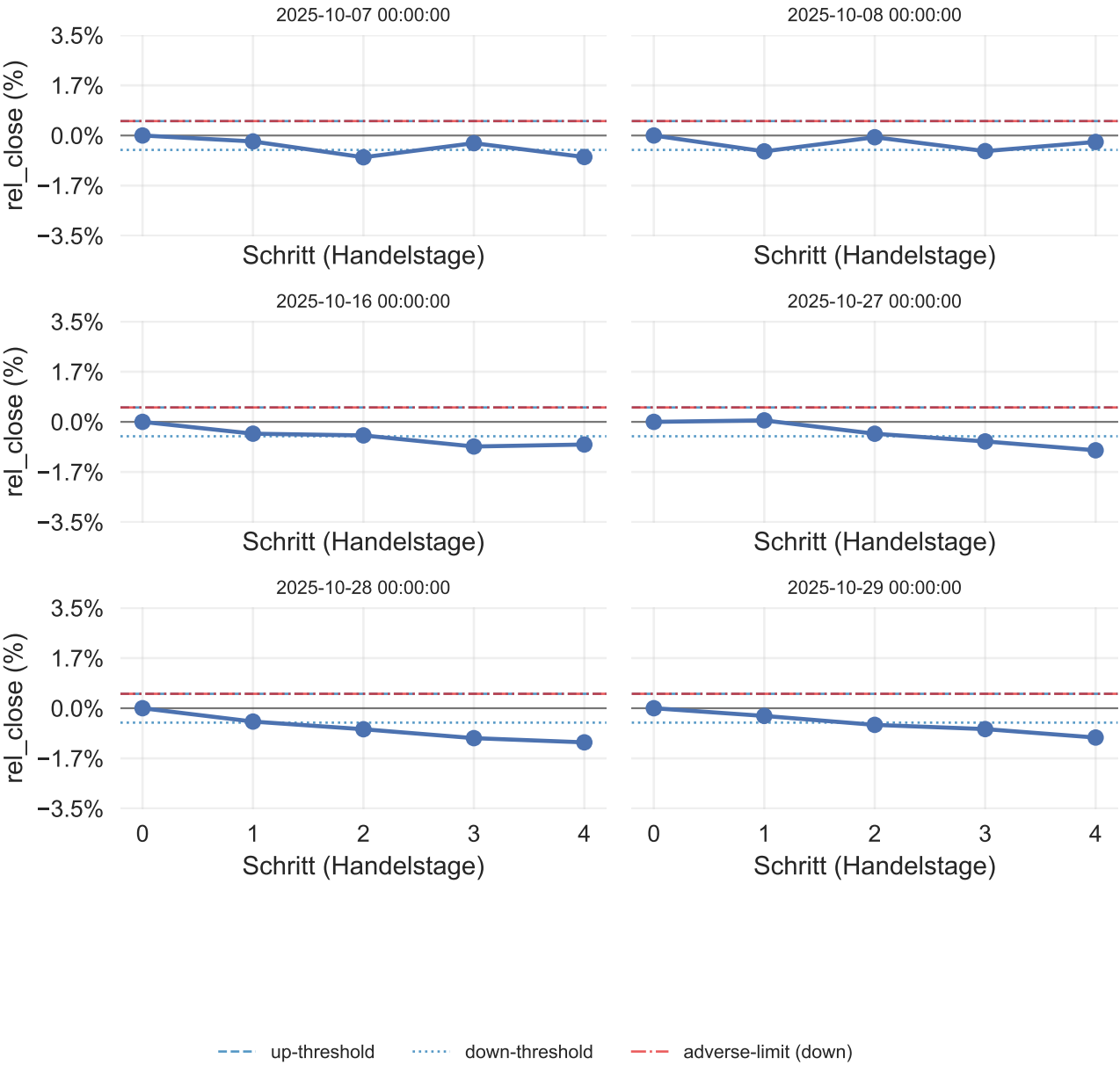


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'down'.

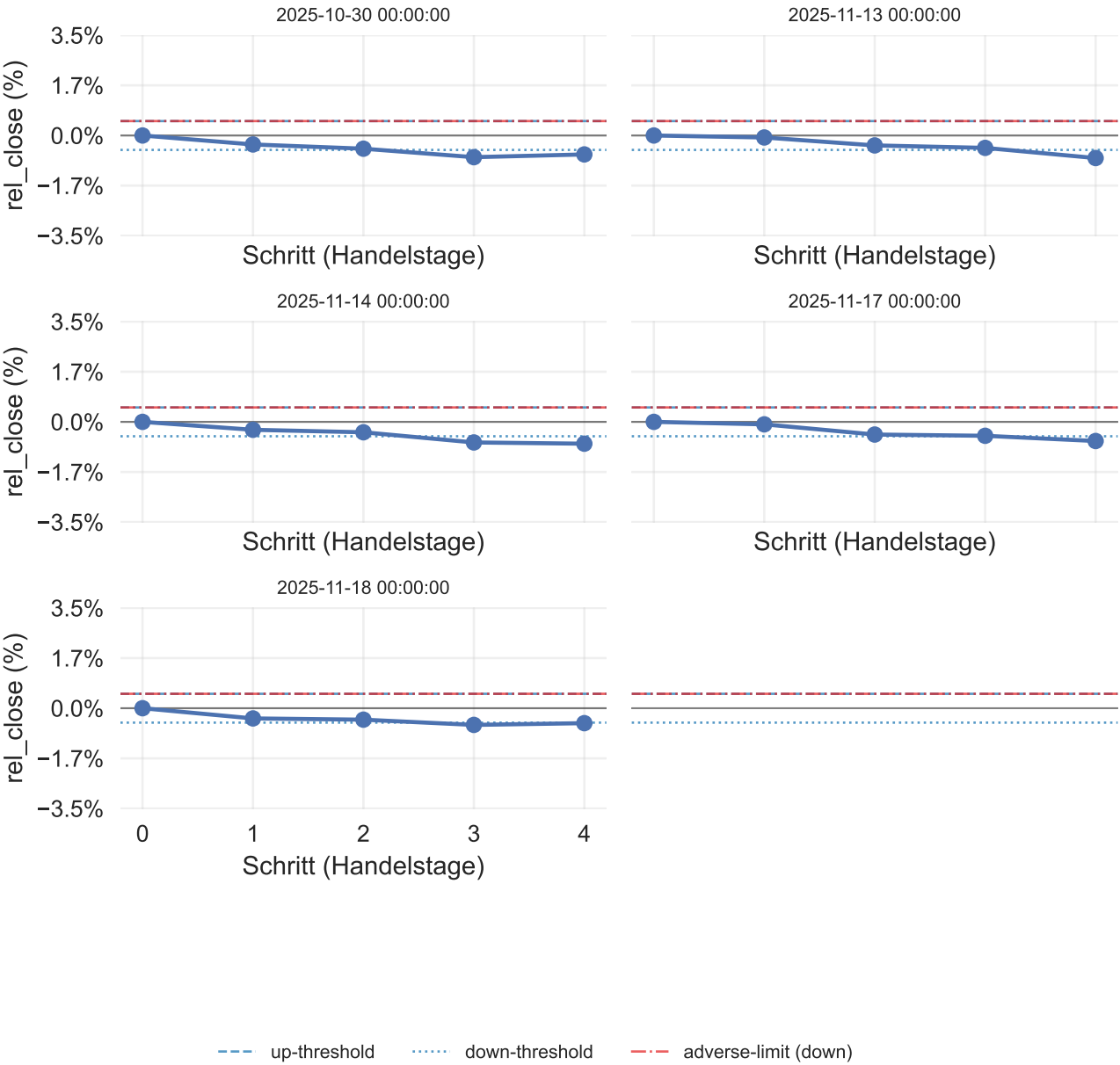


Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'down'.

Signal-Modell – Kennzahlen für Klasse 'move' (train/val/test, thr=0.50)

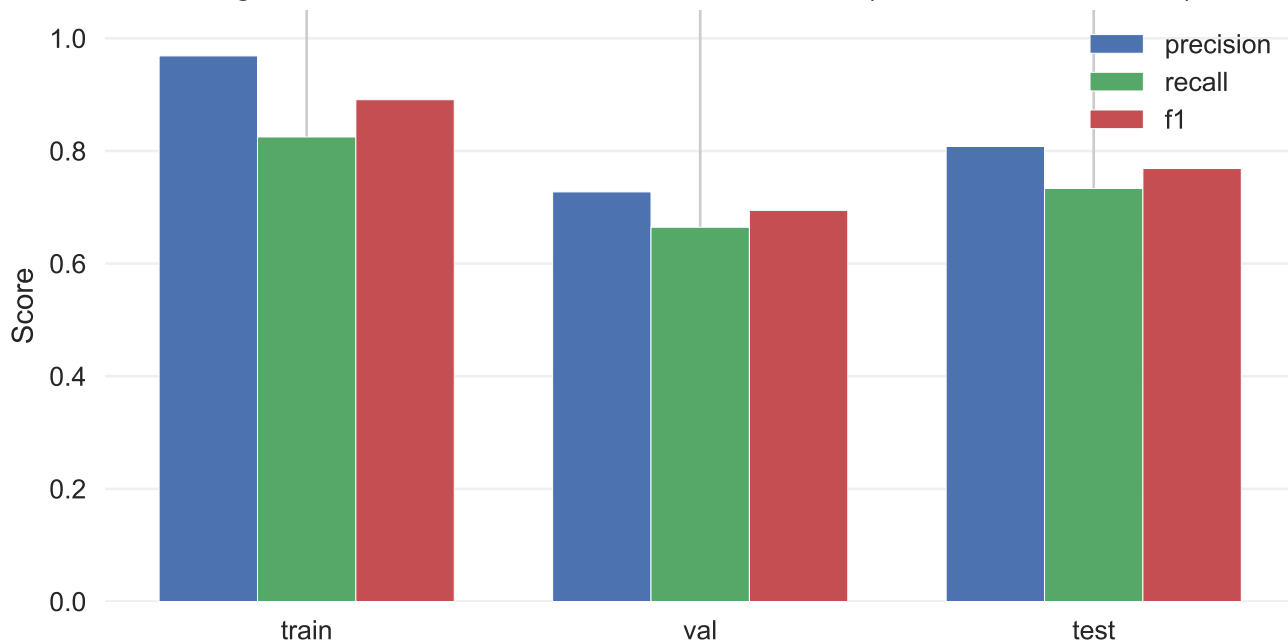


Abbildung: Precision, Recall und F1 der positiven Klasse je Split (train/val/test).

Signal-Modell – Tabelle (Klasse 'move', thr=0.50)

| split | precision | recall | f1 | support |
|-------|-----------|--------|-------|----------|
| train | 0.969 | 0.825 | 0.891 | 1427.000 |
| val | 0.727 | 0.665 | 0.694 | 313.000 |
| test | 0.808 | 0.733 | 0.769 | 195.000 |

Tabelle: Kennzahlen der positiven Klasse (precision/recall/F1/support) für train/val/test.

Richtungs-Modell – Kennzahlen für Klasse 'up' (train/val/test)

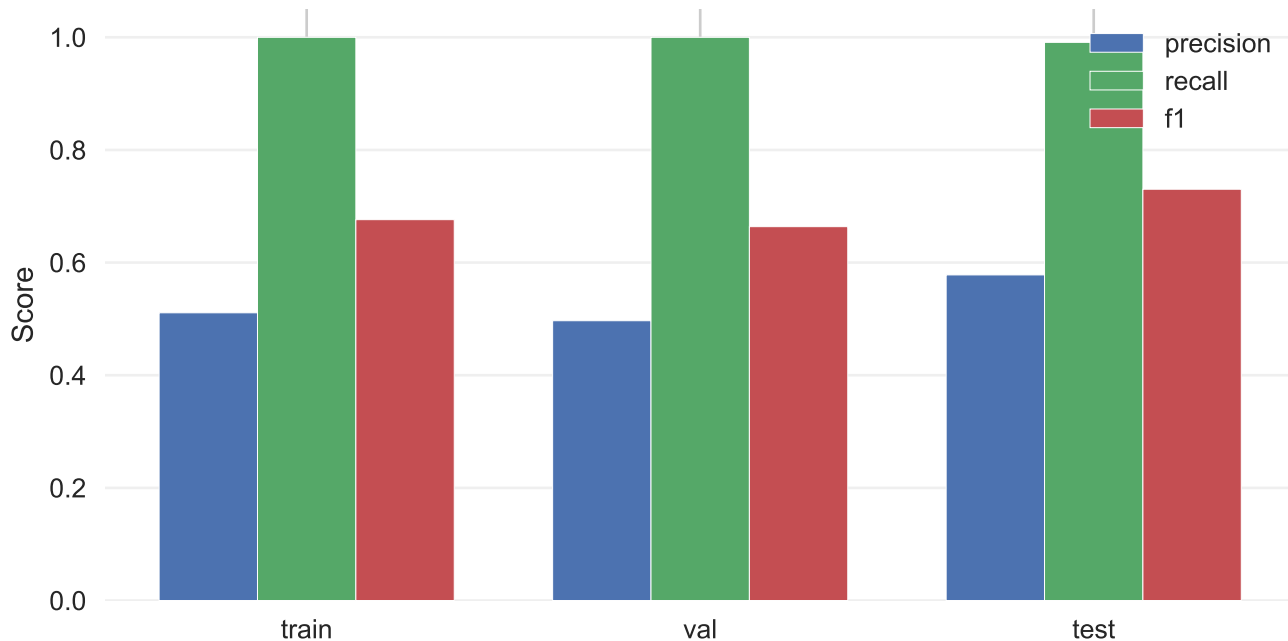


Abbildung: Precision, Recall und F1 der positiven Klasse je Split (train/val/test).

Richtungs-Modell – Tabelle (Klasse 'up')

| split | precision | recall | f1 | support |
|-------|-----------|--------|-------|---------|
| train | 0.511 | 1.000 | 0.676 | 707.000 |
| val | 0.497 | 1.000 | 0.664 | 154.000 |
| test | 0.578 | 0.991 | 0.730 | 112.000 |

Tabelle: Kennzahlen der positiven Klasse (precision/recall/F1/support) für train/val/test.

Kombinierte Test-Auswertung – neutral / up / down

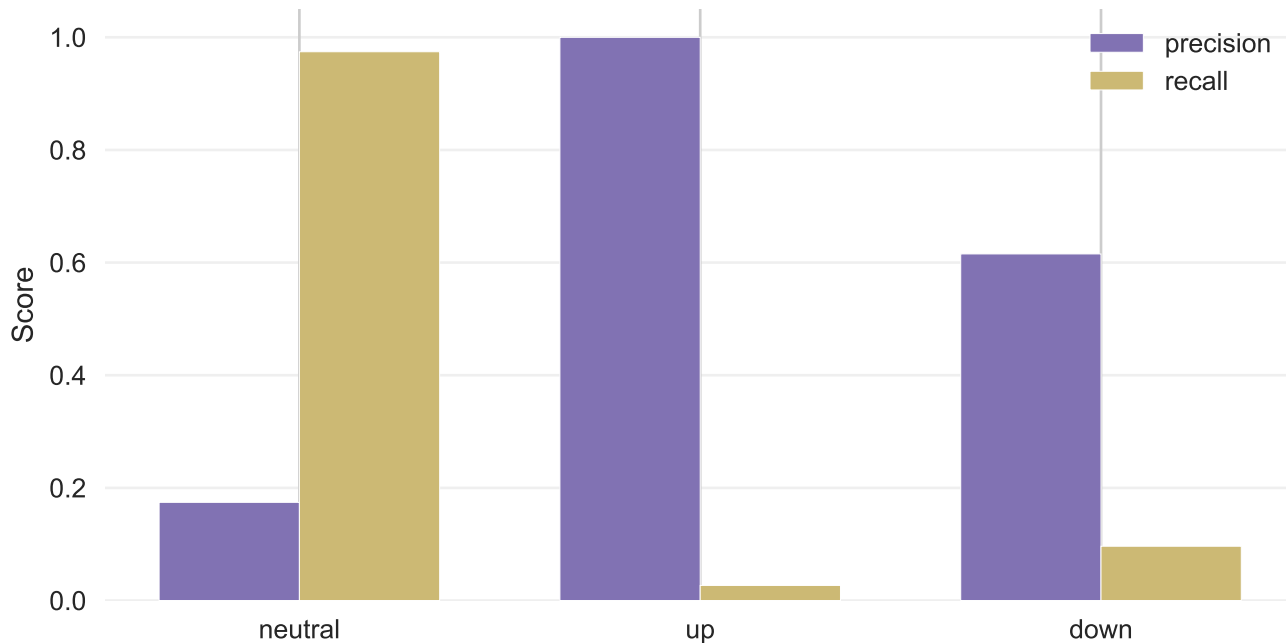


Abbildung: Precision und Recall der kombinierten 3-Klassen-Vorhersage (neutral/up/down) auf dem Test-Split.

Kombiniertes Modell – Tabelle (Test, neutral/up/down)

| klasse | precision | recall | f1 | support |
|---------|-----------|--------|-------|---------|
| neutral | 0.174 | 0.974 | 0.296 | 39 |
| up | 1.0 | 0.027 | 0.052 | 112 |
| down | 0.615 | 0.096 | 0.167 | 83 |

Tabelle: Kennzahlen der drei Klassen (neutral/up/down) des kombinierten Modells auf dem Test-Split.

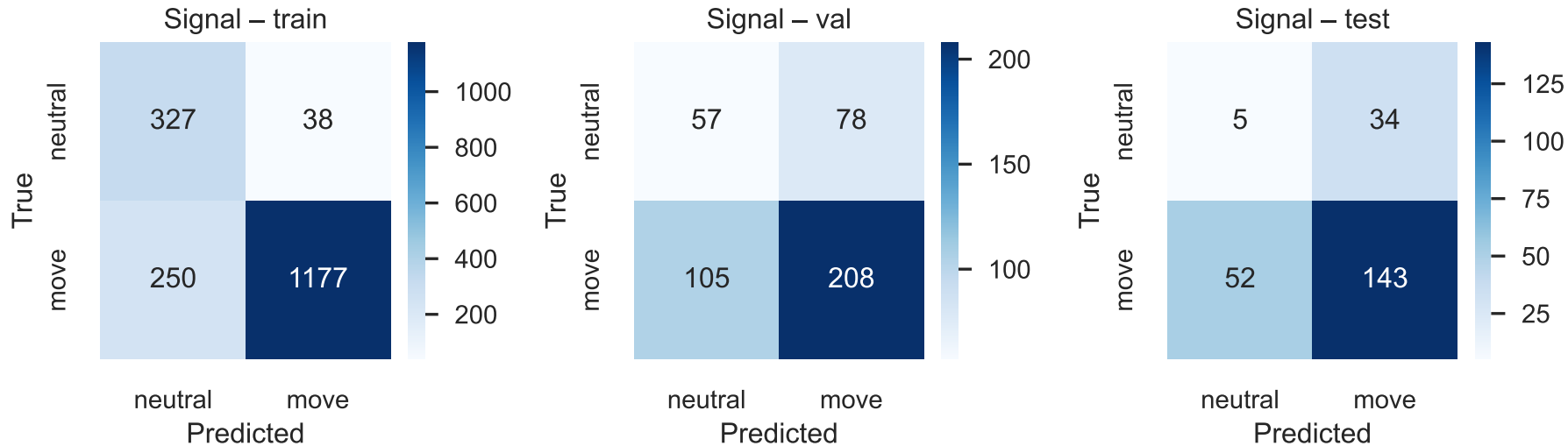


Abbildung: Confusion-Matrizen des Signal-Modells (neutral vs move) für Train-, Validierungs- und Test-Split.

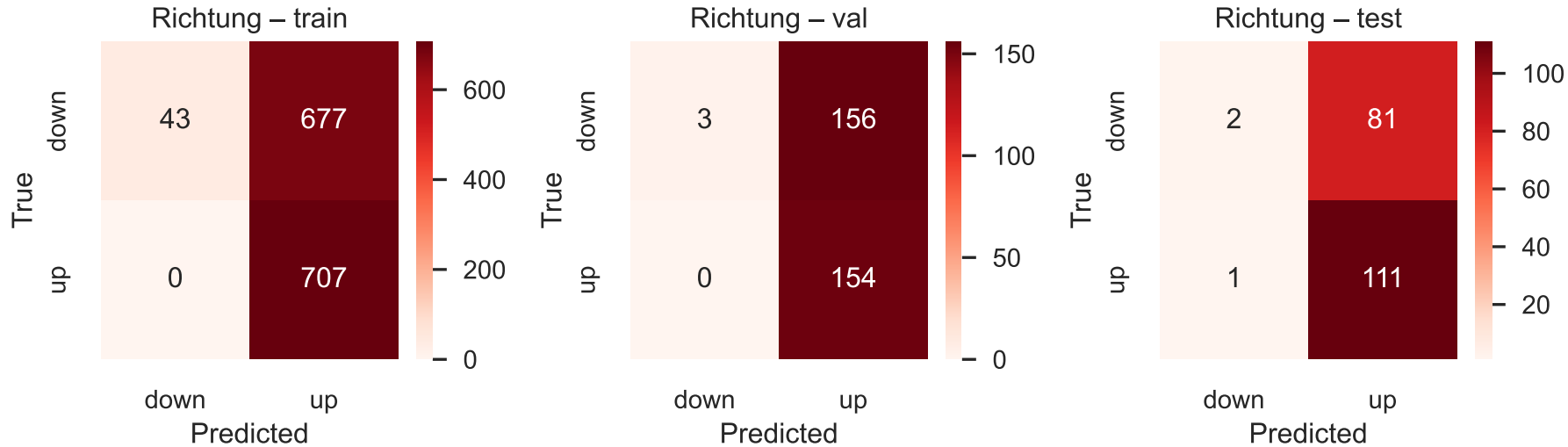


Abbildung: Confusion-Matrizen des Richtungs-Modells (down vs up) für Train-, Validierungs- und Test-Split.

Confusion Matrix – Test (neutral / up / down)

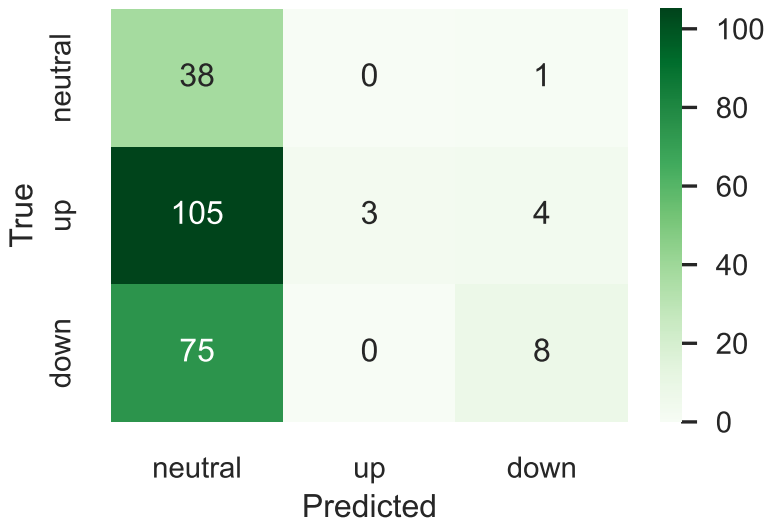


Abbildung: Confusion-Matrix des kombinierten Modells (neutral/up/down) auf dem Test-Split.

Konfusionsmatrizen – Zählwerte (TN/FP/FN/TP)

| modell | split | TN | FP | FN | TP |
|-----------|-------|-----|-----|-----|------|
| signal | train | 327 | 38 | 250 | 1177 |
| signal | val | 57 | 78 | 105 | 208 |
| signal | test | 5 | 34 | 52 | 143 |
| direction | train | 43 | 677 | 0 | 707 |
| direction | val | 3 | 156 | 0 | 154 |
| direction | test | 2 | 81 | 1 | 111 |

Tabelle: Zählwerte der Konfusionsmatrizen (TN/FP/FN/TP)
für Signal- und Richtungs-Modell je Split.

Fehlklassifikationen – Übersicht (False Positives)

| task | predicted | total_fp | true_label_breakdown |
|----------|-----------|----------|----------------------|
| combined | up | 0 | - |
| combined | down | 5 | neutral:1, up:4 |
| signal | move | 34 | neutral:34 |

Tabelle: Zusammenfassung der wichtigsten False-Positive-Fälle für kombinierten Test (neutral/up/down) und Signal-Test (neutral vs move).

Fehlklassifikationen (combined) im Test – Positionen auf der Preiszeitreihe (n=185/234 = 79.1%)

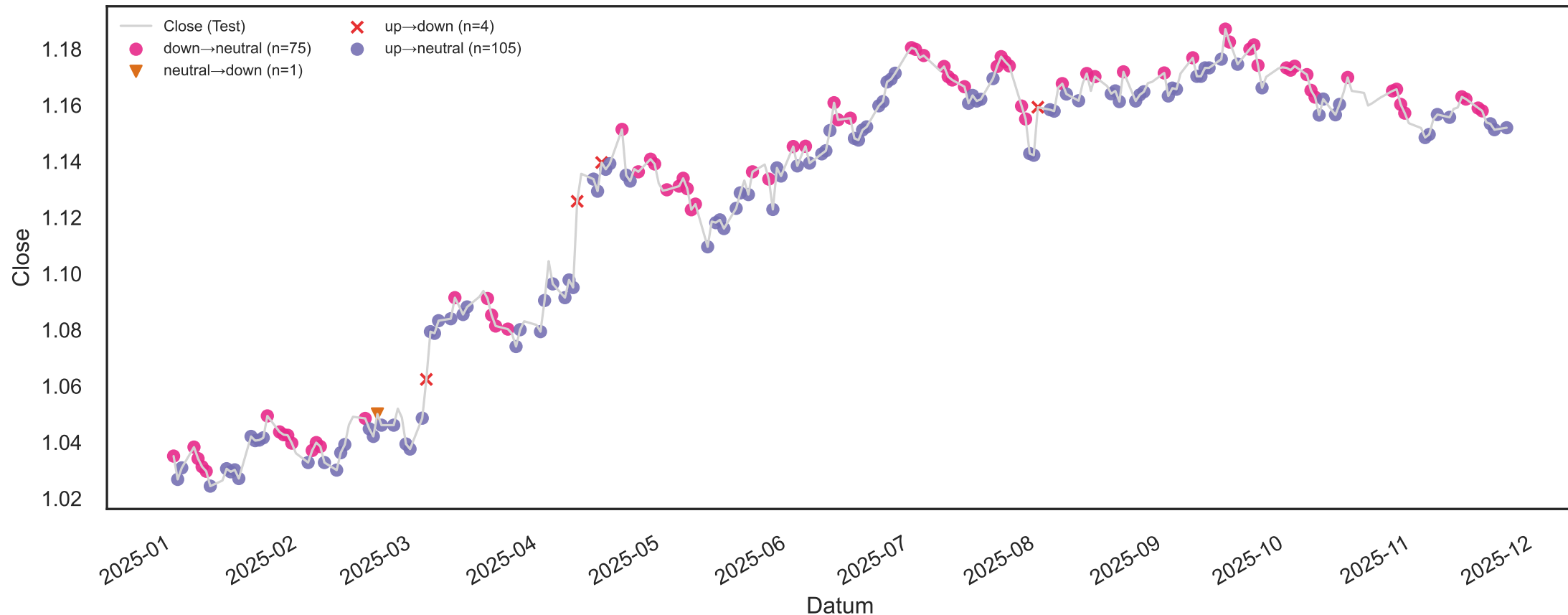


Abbildung: Jede Markierung ist ein Testtag, an dem der kombinierte Output (combined_pred) vom true label abweicht. Farben/Marker zeigen den Fehlertyp true→pred.

Signal-False-Positives im Test – Positionen auf der Preiszeitreihe

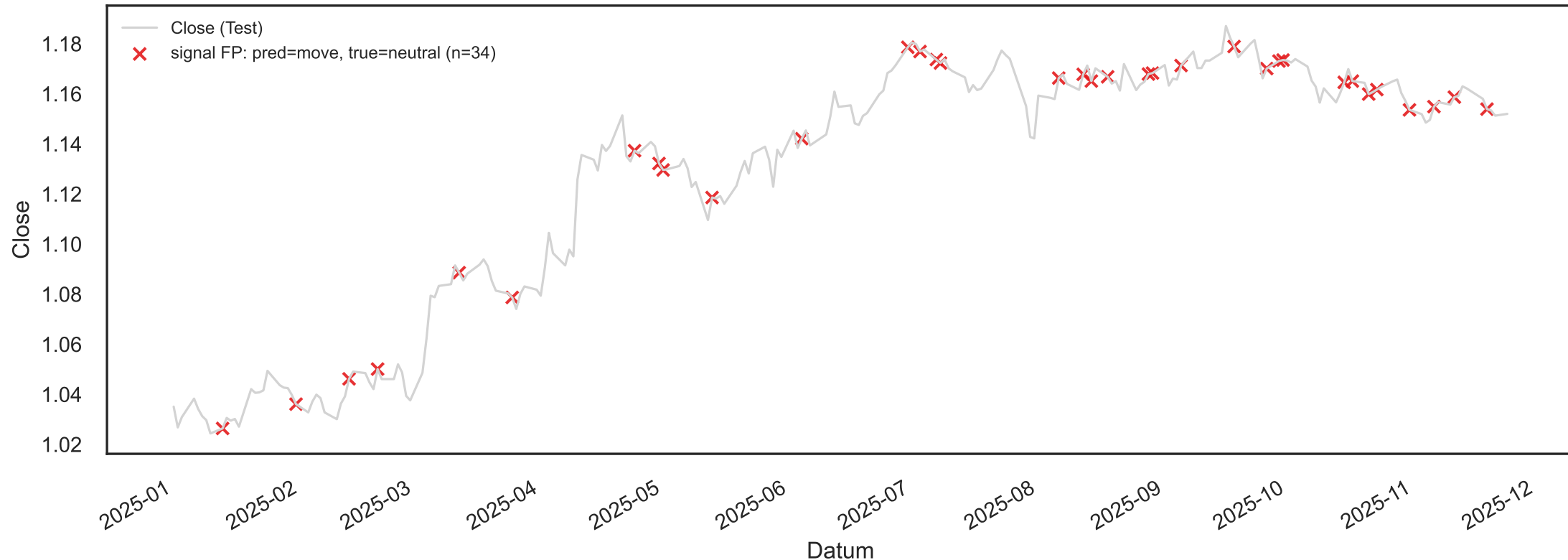


Abbildung: Markierte Testtage, an denen das Signal-Modell (neutral vs move) fälschlich ein Trade-Signal gegeben hat (pred=move), obwohl der Tag im Labeling neutral ist.

Keine Fälle: true=neutral, predicted=up im kombinierten Test.

Relativer Verlauf der Segmente (label='neutral→down')



Abbildung: Relativer Verlauf der Close-Preise für alle Testtage mit true label 'neutral', die im kombinierten Test als 'down' klassifiziert wurden.

Tradesimulation – Regel

Variante 1: SL + TP (wie bisher)

Parameter: horizon_days=4, up_threshold=0.005, down_threshold=-0.005, max_adverse_move_pct=0.005

- Stop-Loss und Take-Profit werden innerhalb des Fensters geprüft (close-basiert).
- Wenn weder SL noch TP getroffen wird: Exit am Horizontende (t+horizon_days).
- Sonderfall: true_label='neutral' aber Trade -> konservativ Stop-Loss-Annahme (wie bisher).

Hinweis: Diese Simulation arbeitet (wie bisher) close-basiert. Intraday-Trigger (High/Low) sind hier nicht abgebildet.

Tradesimulation – Strategien A und B (Test-Split)

| Strategy | Kennzahl | Wert |
|-------------------------------|-------------------------|-----------|
| A (fixer Einsatz) | Anzahl Trades | 16 |
| A (fixer Einsatz) | Einsatz up / down (CHF) | 100 / 100 |
| A (fixer Einsatz) | Trades up / down | 3 / 13 |
| A (fixer Einsatz) | Gewinner / Verlierer | 11 / 5 |
| A (fixer Einsatz) | Gesamt-P&L (CHF) | 3.00 |
| A (fixer Einsatz, Hebel 20) | Gesamt-P&L (CHF) | 60.00 |
| B (10% vom Kapital) | Startkapital (CHF) | 1000.00 |
| B (10% vom Kapital) | Endkapital (CHF) | 1003.00 |
| B (10% vom Kapital) | Minimum Kapital (CHF) | 1000.00 |
| B (10% vom Kapital, Hebel 20) | Endkapital (CHF) | 1060.99 |
| B (10% vom Kapital, Hebel 20) | Minimum Kapital (CHF) | 999.90 |

Tabelle: Zusammenfassung der Tradesimulation auf dem Test-Split.

Strategie A: fixer Einsatz pro Trade (100 CHF bei up, 100 CHF bei down).

Strategie B: 10 % des aktuellen Vermögens pro Trade (optional mit Hebel 20).

Kostenmatrix – durchschnittliche Kosten pro Fall (Strategie A, Test-Split)

| label_true | combined_pred | mean_chf |
|------------|---------------|----------|
| neutral | neutral | 0.0 |
| neutral | up | 0.0 |
| neutral | down | -0.5 |
| up | neutral | 0.0 |
| up | up | 0.5 |
| up | down | -0.5 |
| down | neutral | 0.0 |
| down | up | 0.0 |
| down | down | 0.5 |

Tabelle: durchschnittliche Kosten (CHF) pro Fall für jede Kombination aus wahren Label und vorhergesagtem Label (Strategie A, fixer Einsatz).

Kostenmatrix – Gesamtkosten und Anzahl Trades (Strategie A, Test-Split)

| label_true | combined_pred | count | sum_chf |
|------------|---------------|-------|---------|
| neutral | neutral | 38 | 0.0 |
| neutral | up | 0 | 0.0 |
| neutral | down | 1 | -0.5 |
| up | neutral | 105 | 0.0 |
| up | up | 3 | 1.5 |
| up | down | 4 | -2.0 |
| down | neutral | 75 | 0.0 |
| down | up | 0 | 0.0 |
| down | down | 8 | 4.0 |

Tabelle: Anzahl Fälle und Gesamt-P&L (CHF) auf dem Test-Split
für jede Kombination aus wahrem Label und vorhergesagtem Label (Strategie A).

Strategie A vs B – Verlauf des Kapitals (ohne Hebel, Test-Split)

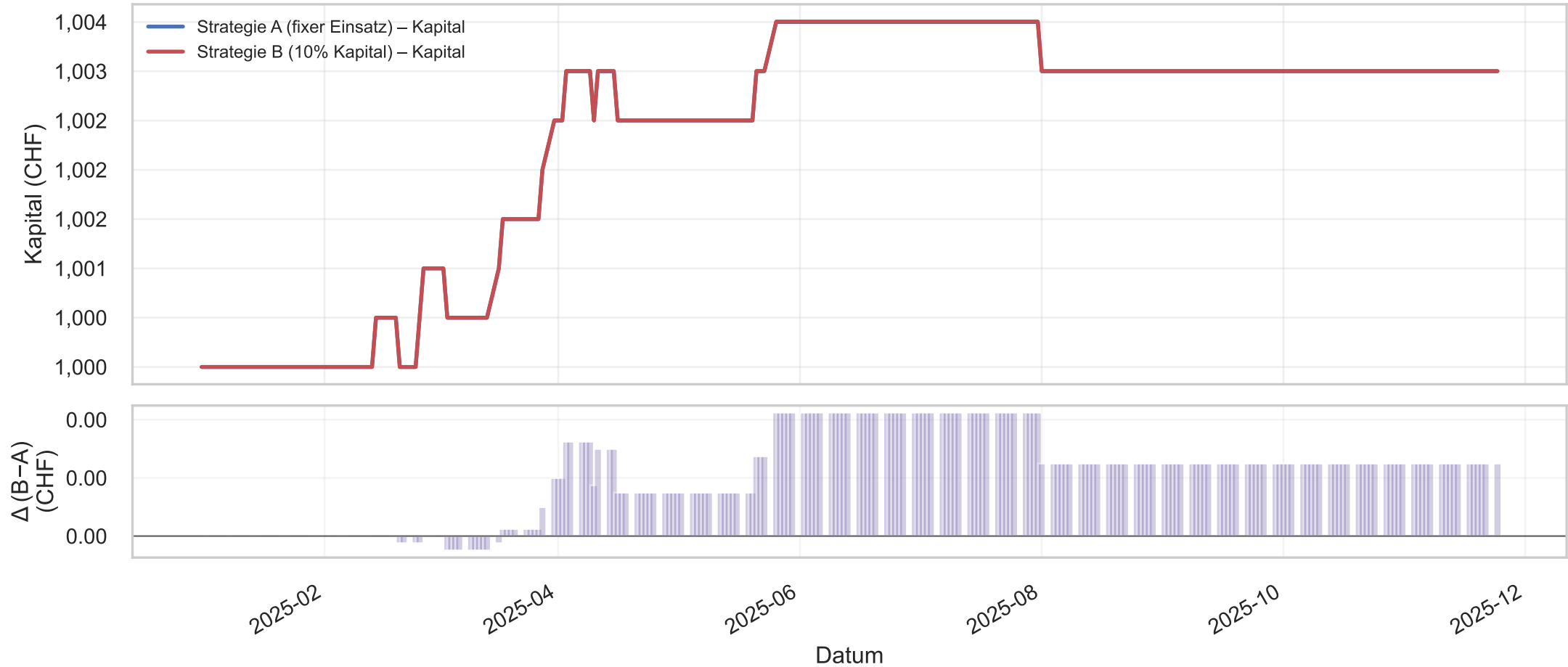


Abbildung: Oben Kapitalverlauf (CHF) für Strategie A und B ohne Hebel. Unten Balken: Differenz $\Delta = (B - A)$ je Tag.

Strategie A vs B – kumulierter P&L (ohne Hebel, Test-Split)

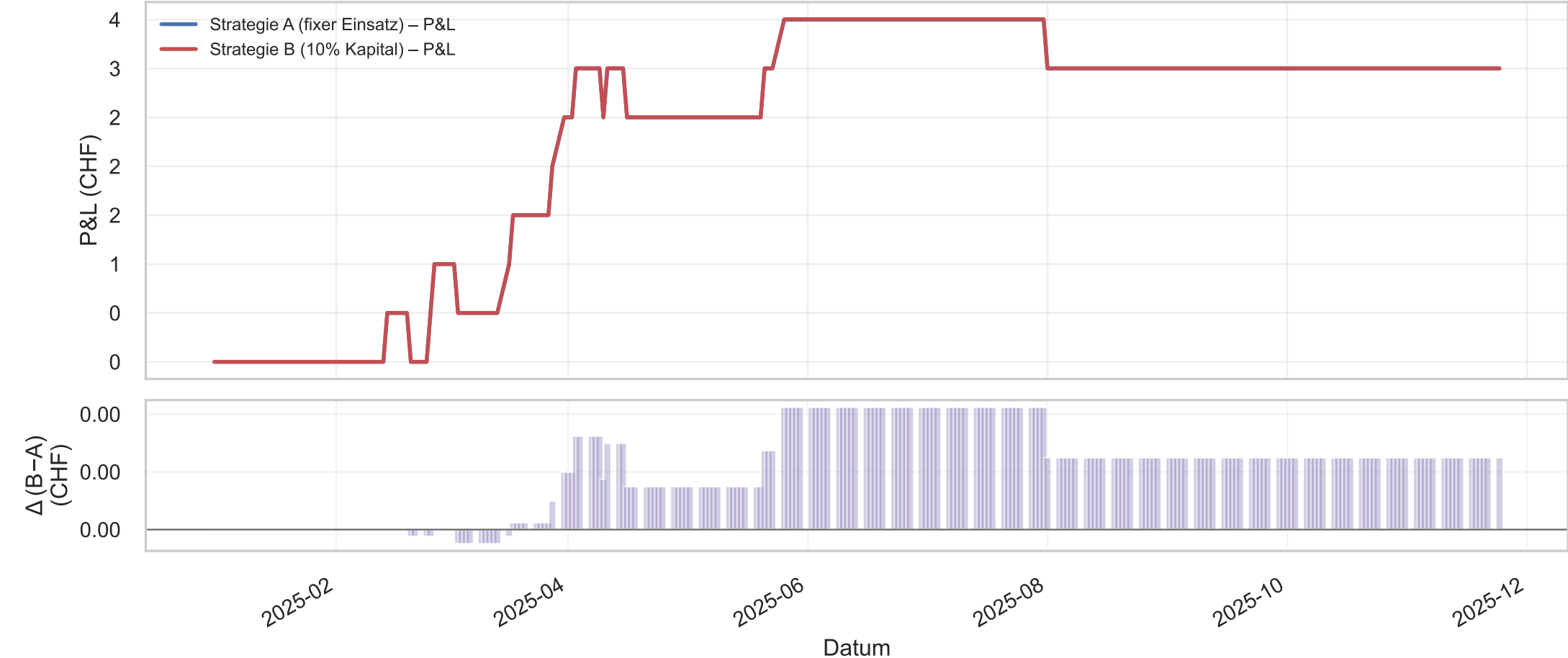


Abbildung: Oben kumulierter Gewinn/Verlust (P&L, CHF) für Strategie A und B ohne Hebel. Unten Balken: Differenz $\Delta = (B - A)$ je Tag.

Strategie A vs B – kumulierter Gewinn (P&L) als Punkte (ohne Hebel, Test-Split)

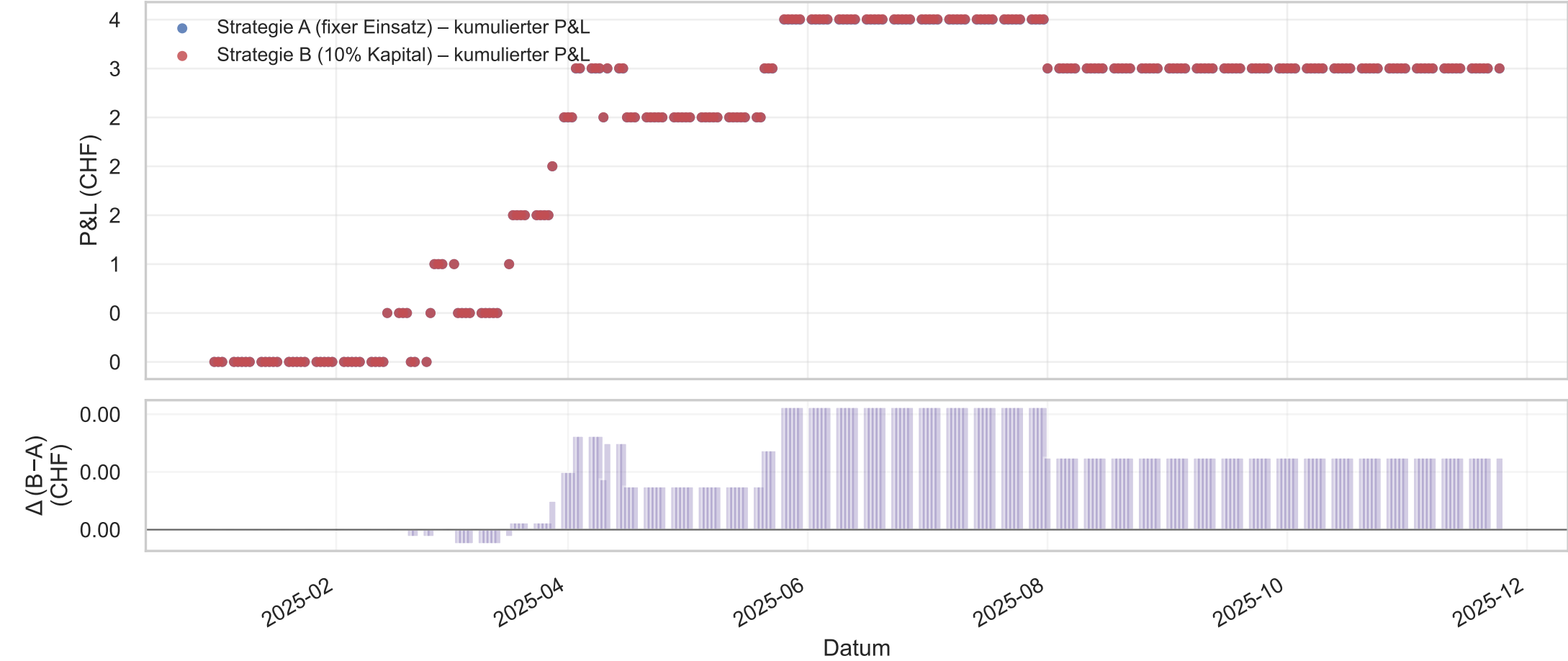


Abbildung: Oben kumulierter Gewinn/Verlust (P&L) als Punkte. Unten Balken: Differenz $\Delta = (B - A)$ je Tag.

Strategie A vs B – Verlauf des Kapitals (Hebel 20, Test-Split)

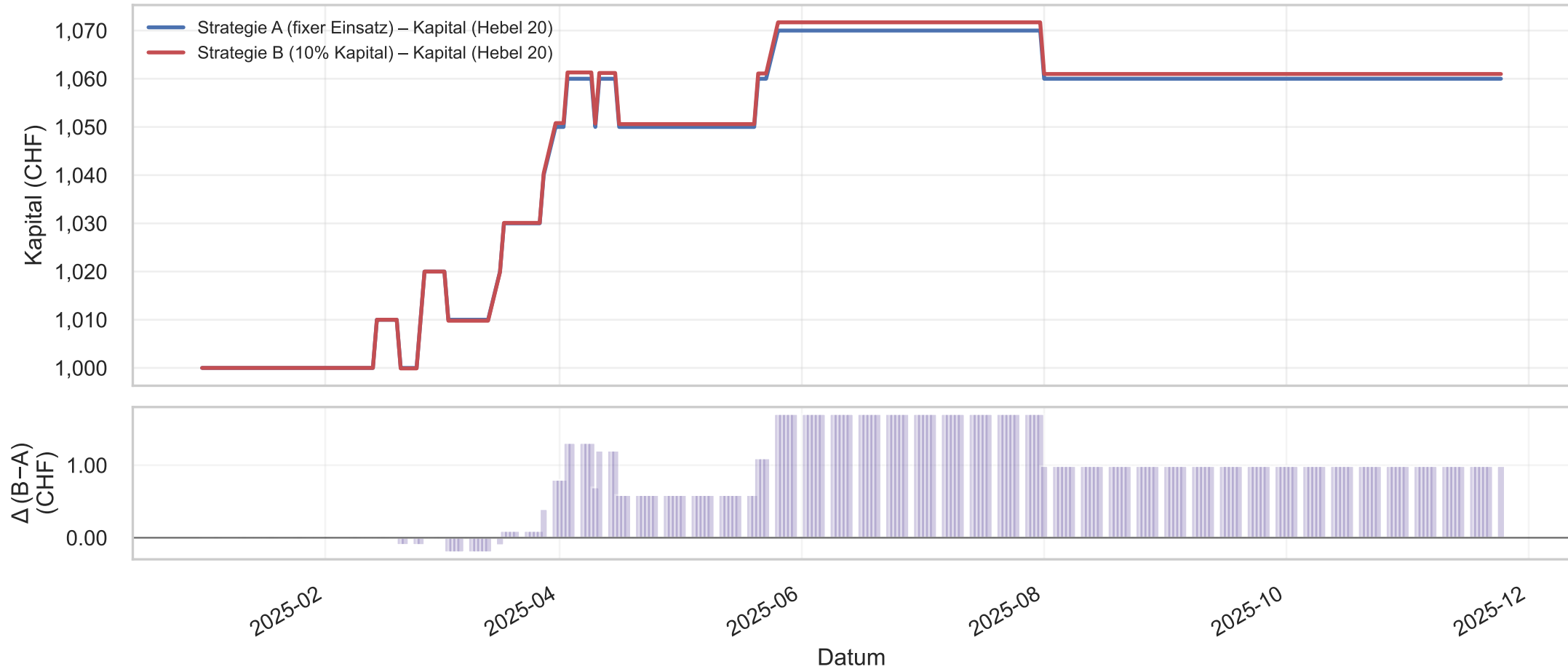


Abbildung: Oben Kapitalverlauf (CHF) für Strategie A und B mit Hebel 20. Unten Balken: Differenz $\Delta = (B - A)$ je Tag.

Strategie A vs B – kumulierter P&L (Hebel 20, Test-Split)

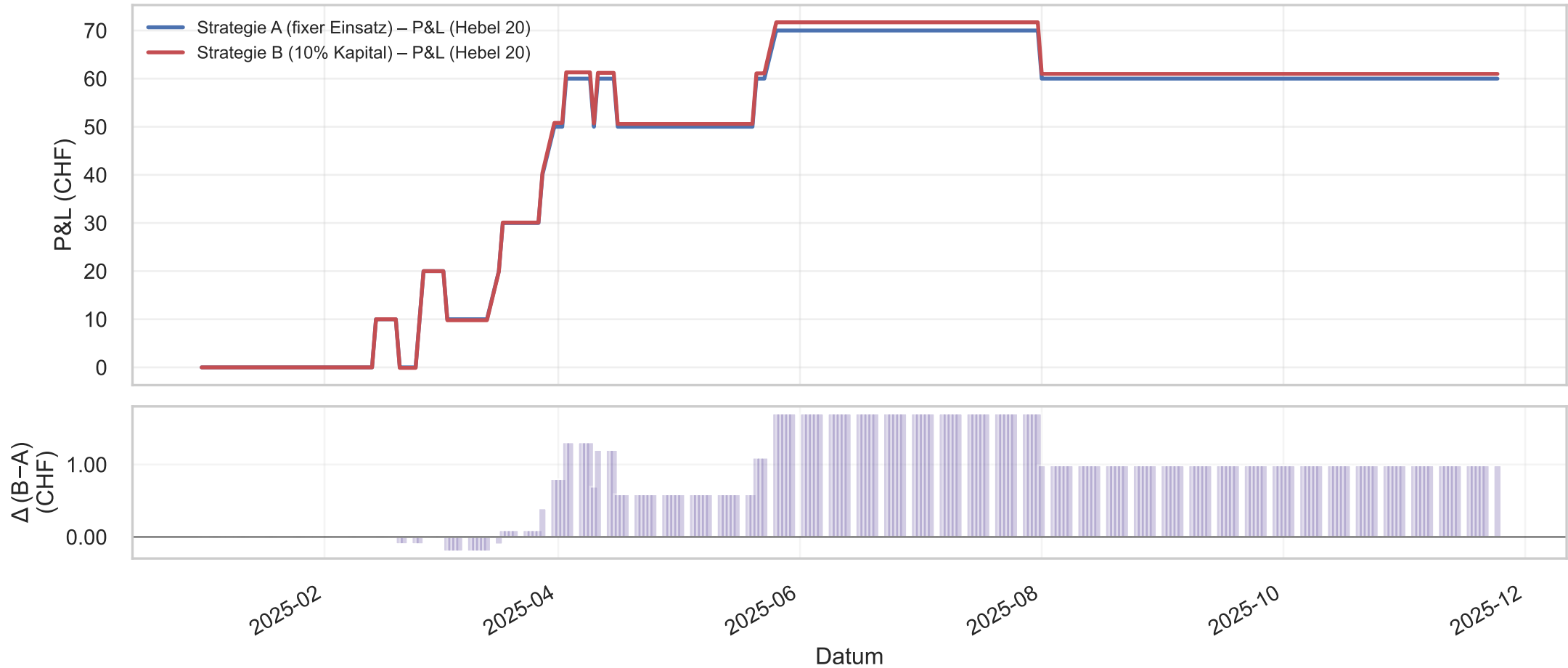


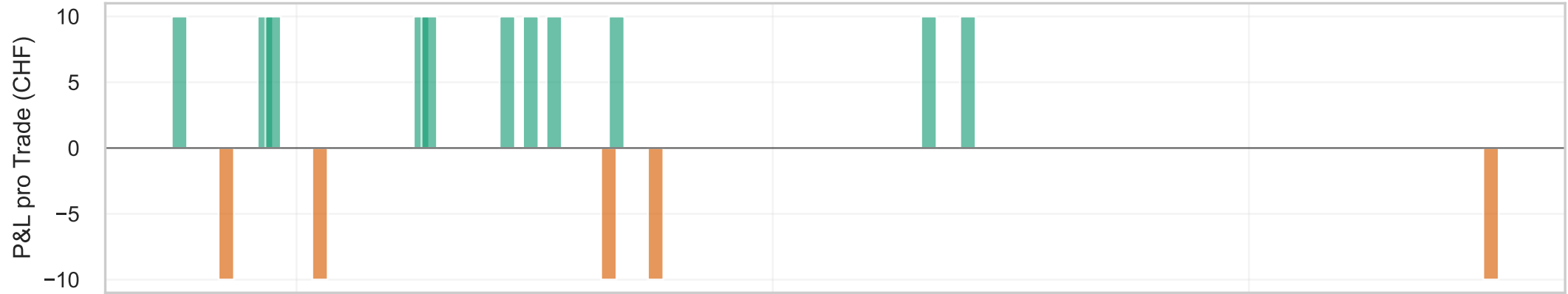
Abbildung: Oben kumulierter Gewinn/Verlust (P&L, CHF) für Strategie A und B mit Hebel 20. Unten Balken: Differenz $\Delta = (B - A)$ je Tag.

Strategie A vs B – kumulierter Gewinn (P&L) als Punkte (Hebel 20, Test-Split)

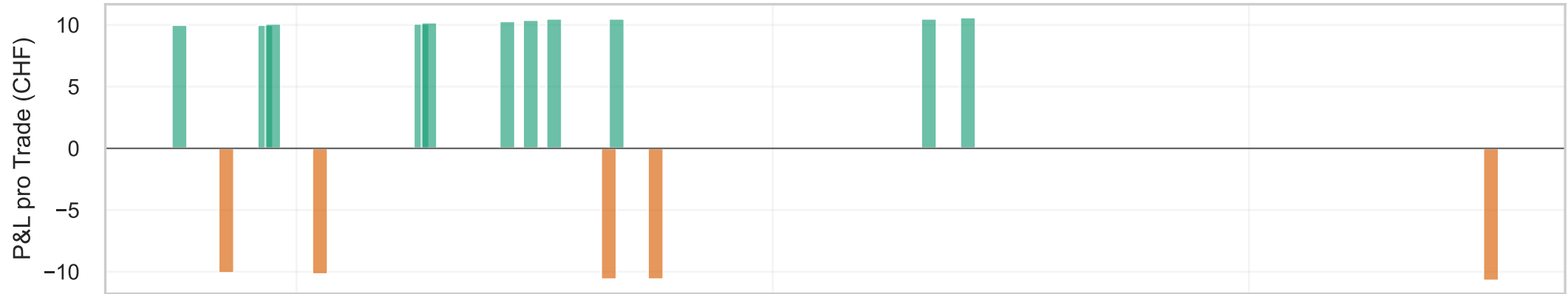


Abbildung: Oben kumulierter Gewinn/Verlust (P&L) als Punkte. Unten Balken: Differenz $\Delta = (B - A)$ je Tag.

Strategie A – Gewinn pro Trade (Hebel 20, nur Trade-Tage)



Strategie B – Gewinn pro Trade (Hebel 20, nur Trade-Tage)



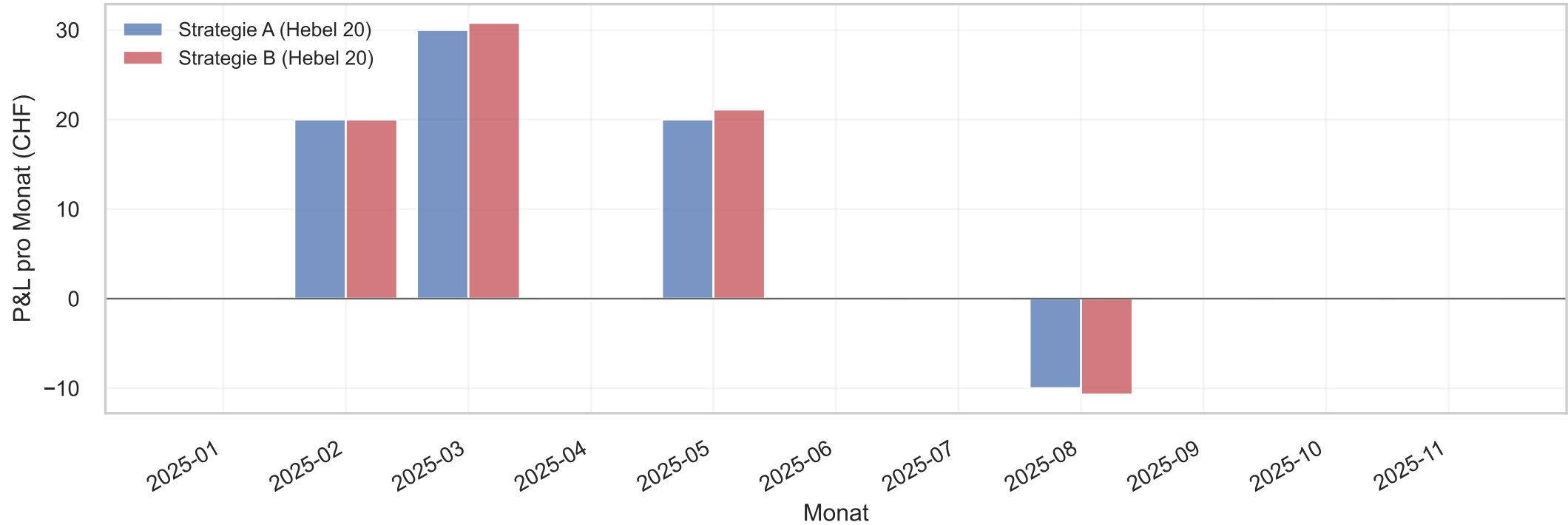
2025-03

2025-05

2025-07

Datum

Gewinn pro Monat (Hebel 20, Test-Split)



5-Jahres-Projektion (Bootstrap-Monte-Carlo, Hebel 20)

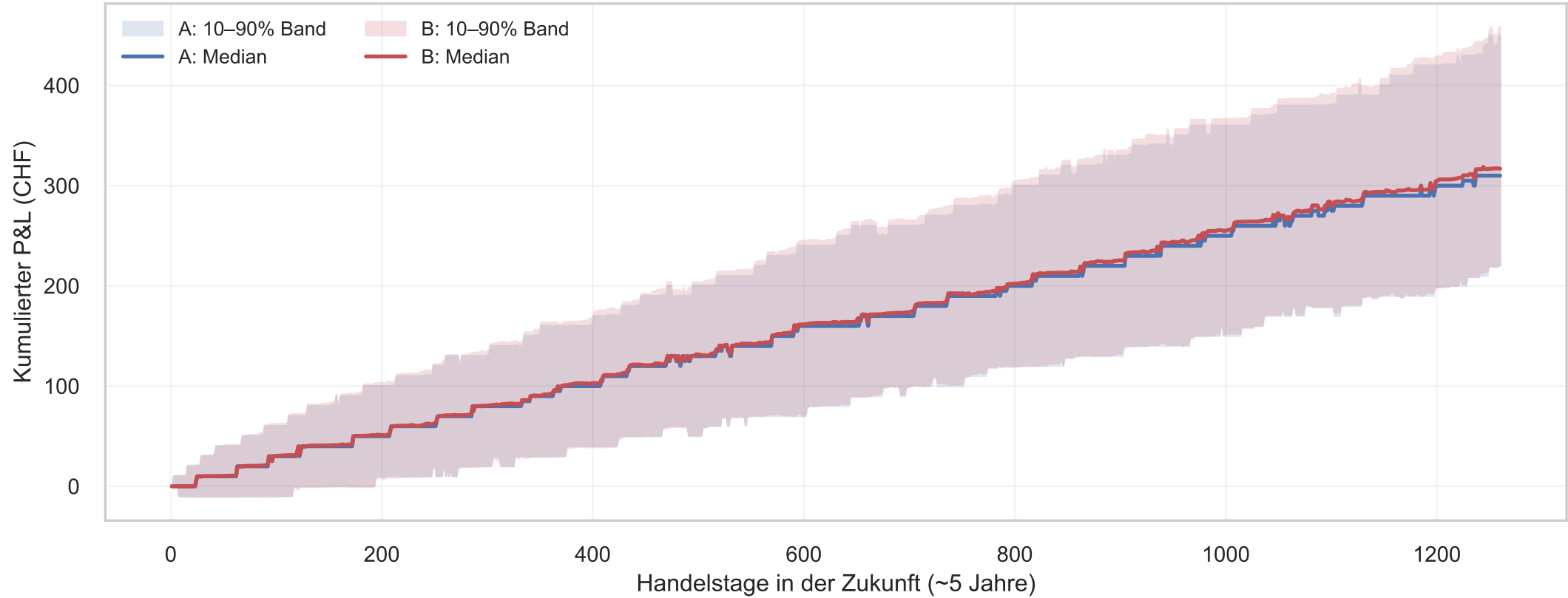


Abbildung: Keine echte Prognose. Es wird angenommen, dass die Verteilung der Tages-Ergebnisse aus dem Testzeitraum (inkl. Tage ohne Trades) in der Zukunft ähnlich bleibt. Gezeigt sind Median und 10–90%

Strategie A – kumulierter P&L (Test-Split)

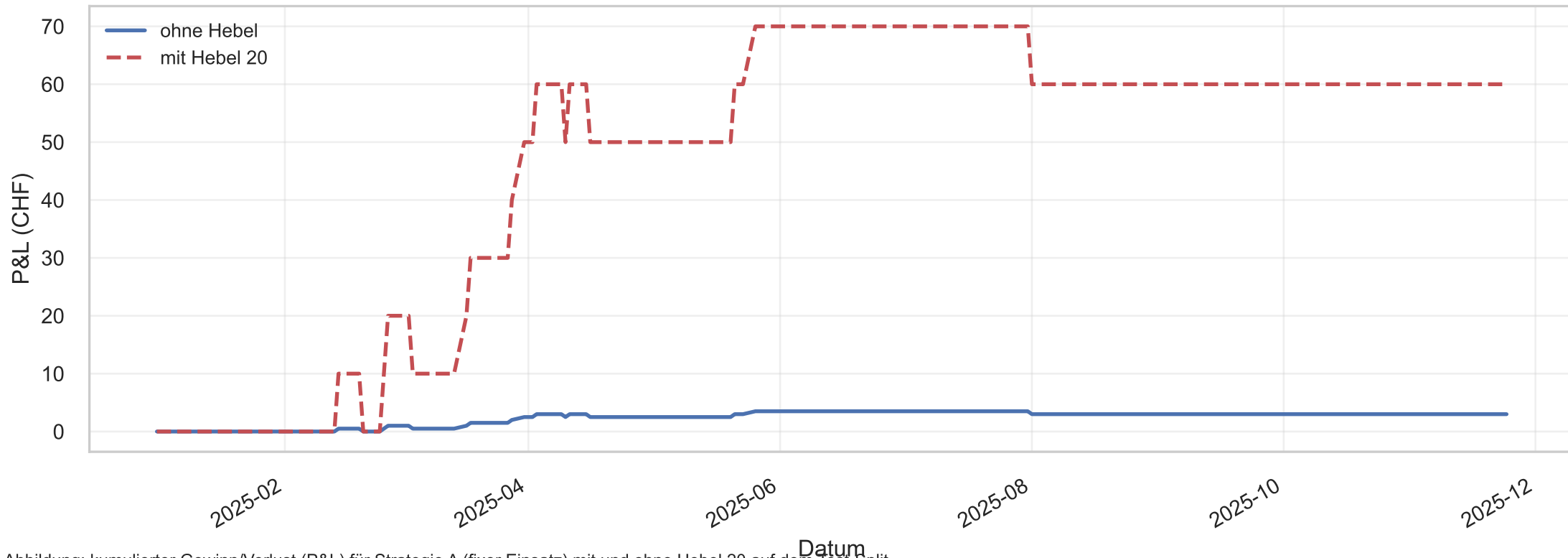


Abbildung: kumulierter Gewinn/Verlust (P&L) für Strategie A (fixer Einsatz) mit und ohne Hebel 20 auf dem Test-Split.

Strategie B – kumulierter P&L (Test-Split)

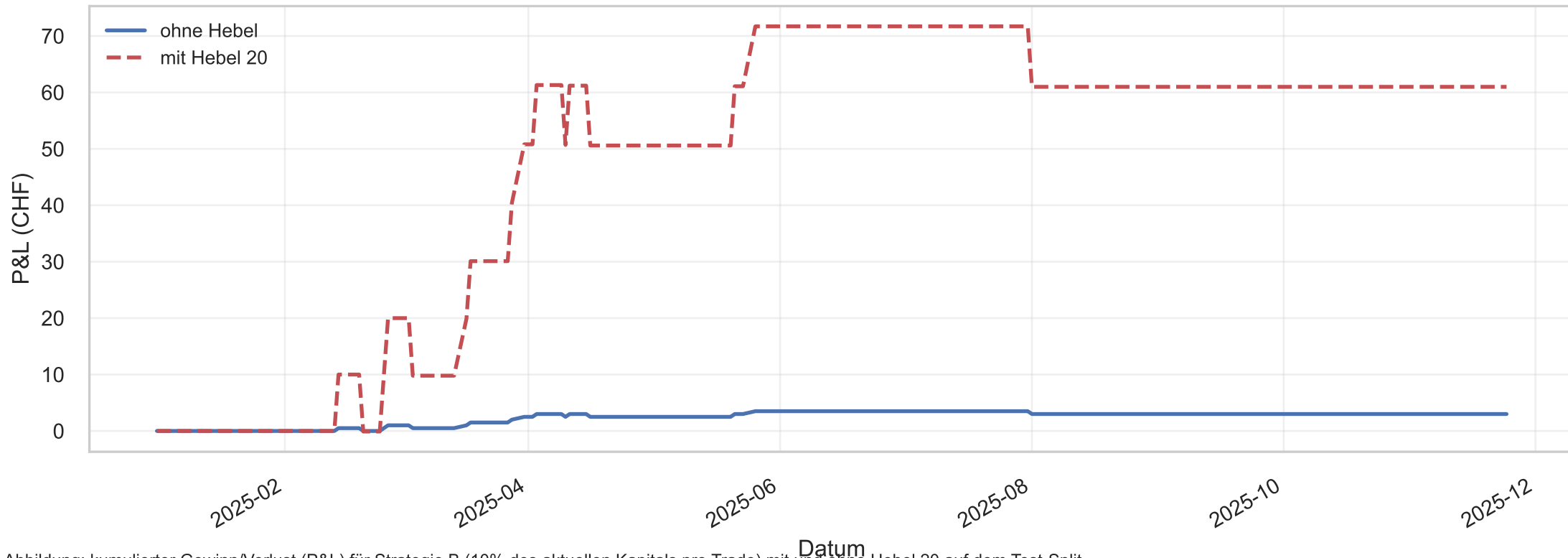


Abbildung: kumulierter Gewinn/Verlust (P&L) für Strategie B (10% des aktuellen Kapitals pro Trade) mit und ohne Hebel 20 auf dem Test-Split.

Tradesimulation – Regel

Variante 2: TP-only (kein Stop-Loss, sonst Horizontende)

Parameter: horizon_days=4, up_threshold=0.005, down_threshold=-0.005, max_adverse_move_pct=0.005

- Wenn die Label-Schwelle (TP) innerhalb des Fensters erreicht wird: Exit sofort mit TP-Return.
- Kein Stop-Loss: wenn TP nicht erreicht wird, wird am Horizontende geschlossen (Return am Horizontende).
- Diese Variante ist bewusst vereinfacht/optimistischer und dient als Vergleich.

Hinweis: Diese Simulation arbeitet (wie bisher) close-basiert. Intraday-Trigger (High/Low) sind hier nicht abgebildet.

Tradesimulation – Strategien A und B (Test-Split)

| Strategy | Kennzahl | Wert |
|-------------------------------|-------------------------|-----------|
| A (fixer Einsatz) | Anzahl Trades | 16 |
| A (fixer Einsatz) | Einsatz up / down (CHF) | 100 / 100 |
| A (fixer Einsatz) | Trades up / down | 3 / 13 |
| A (fixer Einsatz) | Gewinner / Verlierer | 13 / 3 |
| A (fixer Einsatz) | Gesamt-P&L (CHF) | 2.04 |
| A (fixer Einsatz, Hebel 20) | Gesamt-P&L (CHF) | 40.70 |
| B (10% vom Kapital) | Startkapital (CHF) | 1000.00 |
| B (10% vom Kapital) | Endkapital (CHF) | 1002.03 |
| B (10% vom Kapital) | Minimum Kapital (CHF) | 999.59 |
| B (10% vom Kapital, Hebel 20) | Endkapital (CHF) | 1039.63 |
| B (10% vom Kapital, Hebel 20) | Minimum Kapital (CHF) | 990.85 |

Tabelle: Zusammenfassung der Tradesimulation auf dem Test-Split.
 Strategie A: fixer Einsatz pro Trade (100 CHF bei up, 100 CHF bei down).
 Strategie B: 10 % des aktuellen Vermögens pro Trade (optional mit Hebel 20).

Kostenmatrix – durchschnittliche Kosten pro Fall (Strategie A, Test-Split)

| label_true | combined_pred | mean_chf |
|------------|---------------|--------------------|
| neutral | neutral | 0.0 |
| neutral | up | 0.0 |
| neutral | down | 0.1237977335491933 |
| up | neutral | 0.0 |
| up | up | 0.5 |
| up | down | -0.89715682503716 |
| down | neutral | 0.0 |
| down | up | 0.0 |
| down | down | 0.5 |

Tabelle: durchschnittliche Kosten (CHF) pro Fall für jede Kombination aus wahren Label und vorhergesagtem Label (Strategie A, fixer Einsatz).

Kostenmatrix – Gesamtkosten und Anzahl Trades (Strategie A, Test-Split)

| label_true | combined_pred | count | sum_chf |
|------------|---------------|-------|--------------------|
| neutral | neutral | 38 | 0.0 |
| neutral | up | 0 | 0.0 |
| neutral | down | 1 | 0.1237977335491933 |
| up | neutral | 105 | 0.0 |
| up | up | 3 | 1.5 |
| up | down | 4 | -3.58862730014864 |
| down | neutral | 75 | 0.0 |
| down | up | 0 | 0.0 |
| down | down | 8 | 4.0 |

Tabelle: Anzahl Fälle und Gesamt-P&L (CHF) auf dem Test-Split
für jede Kombination aus wahrem Label und vorhergesagtem Label (Strategie A).

Strategie A vs B – Verlauf des Kapitals (ohne Hebel, Test-Split)

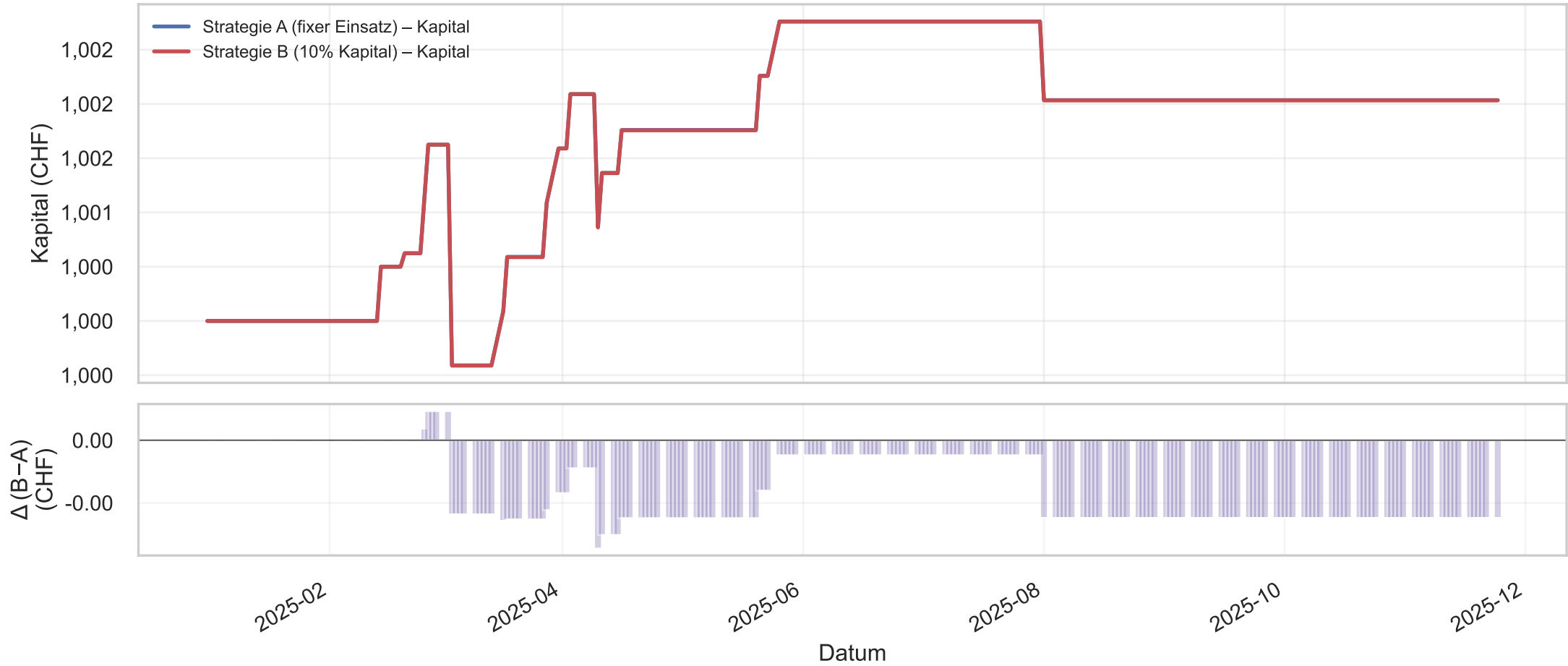


Abbildung: Oben Kapitalverlauf (CHF) für Strategie A und B ohne Hebel. Unten Balken: Differenz $\Delta = (B - A)$ je Tag.

Strategie A vs B – kumulierter P&L (ohne Hebel, Test-Split)

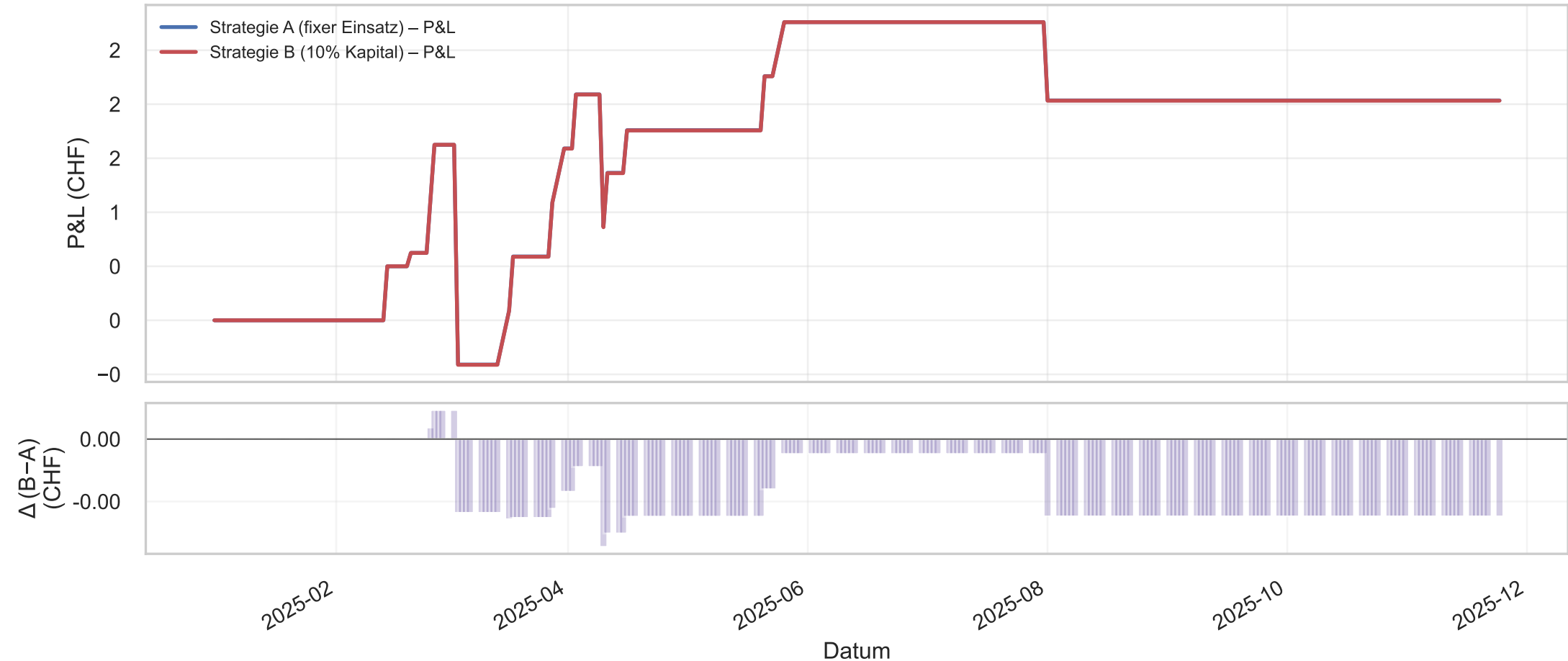


Abbildung: Oben kumulierter Gewinn/Verlust (P&L, CHF) für Strategie A und B ohne Hebel. Unten Balken: Differenz $\Delta = (B - A)$ je Tag.

Strategie A vs B – kumulierter Gewinn (P&L) als Punkte (ohne Hebel, Test-Split)

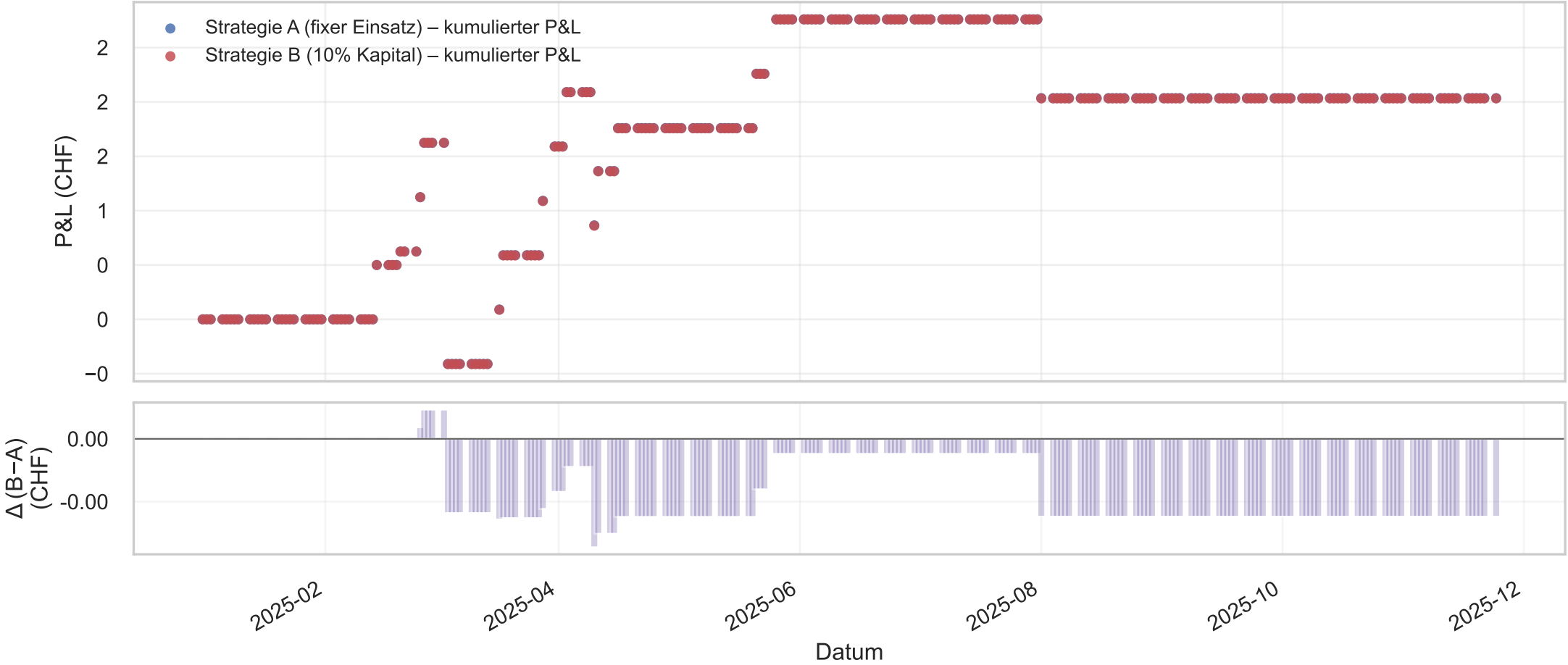


Abbildung: Oben kumulierter Gewinn/Verlust (P&L) als Punkte. Unten Balken: Differenz $\Delta = (B - A)$ je Tag.

Strategie A vs B – Verlauf des Kapitals (Hebel 20, Test-Split)

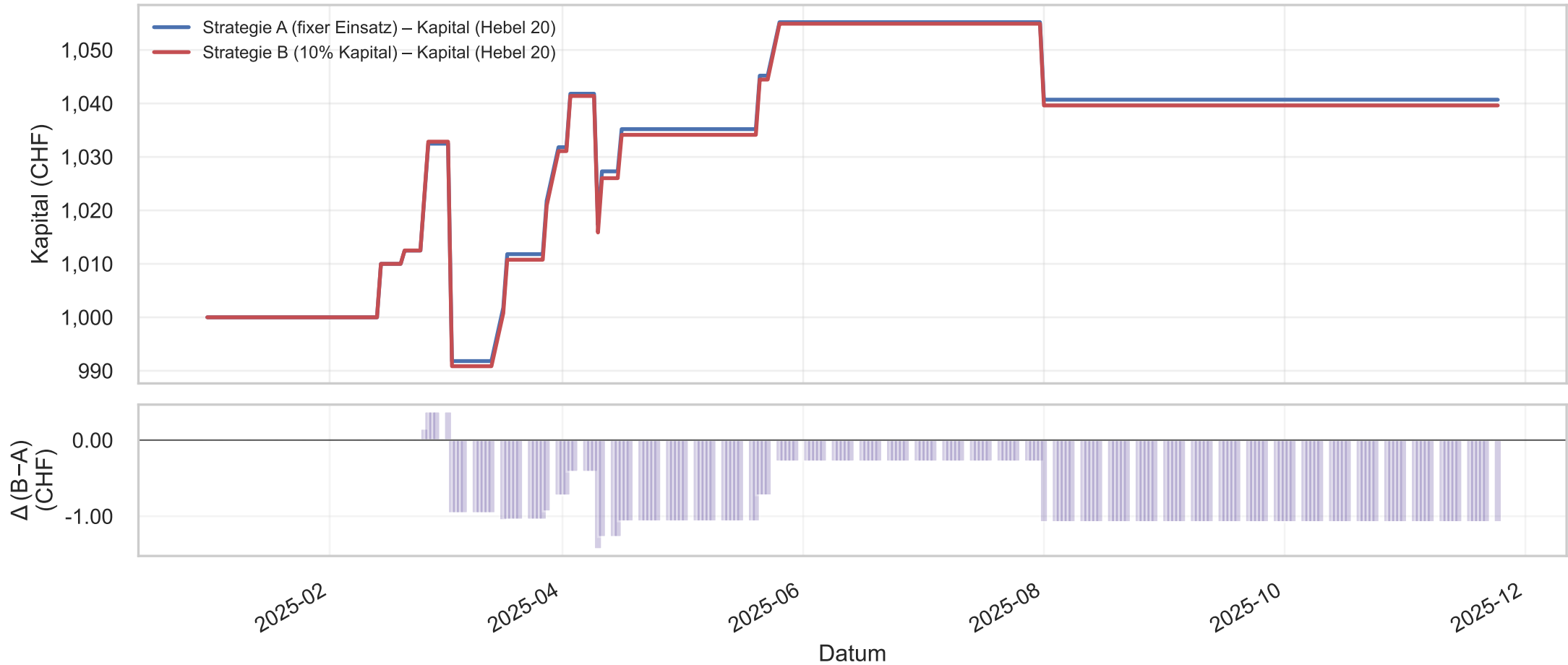


Abbildung: Oben Kapitalverlauf (CHF) für Strategie A und B mit Hebel 20. Unten Balken: Differenz $\Delta = (B - A)$ je Tag.

Strategie A vs B – kumulierter P&L (Hebel 20, Test-Split)

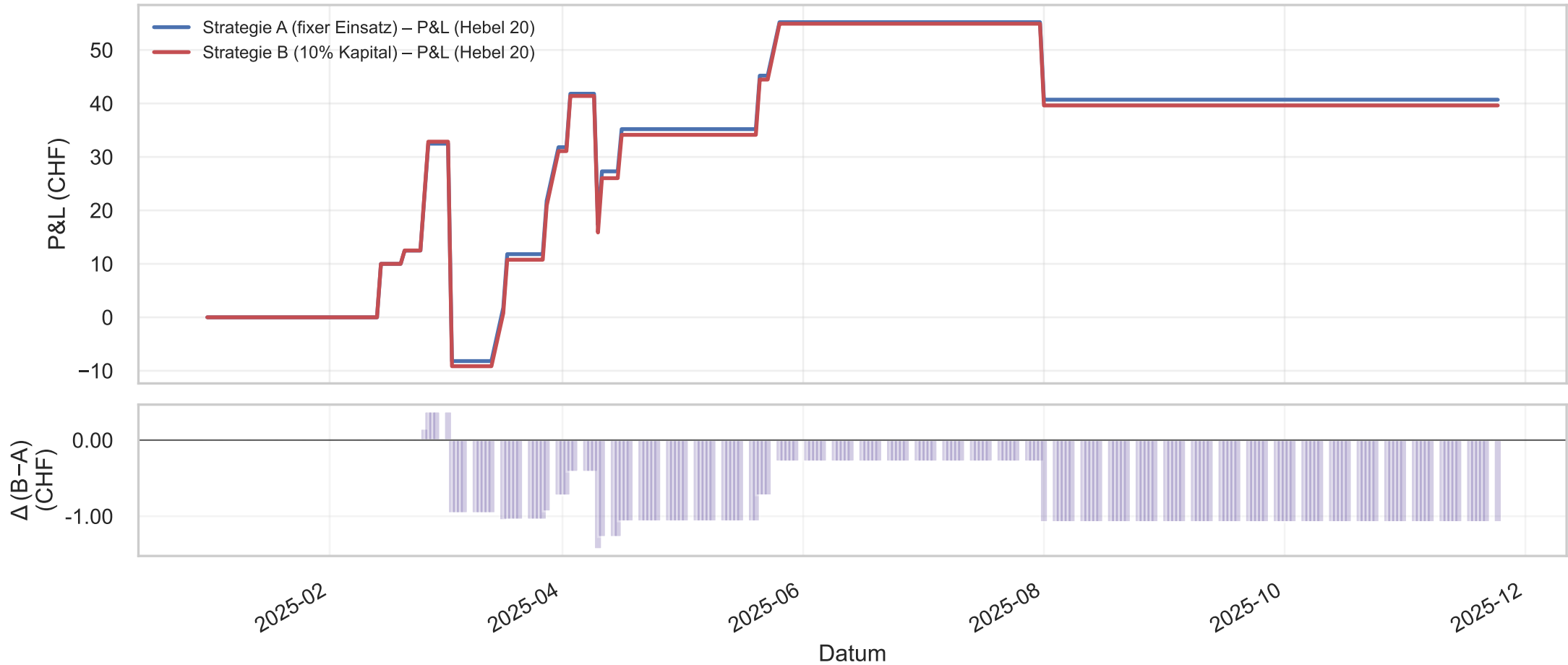


Abbildung: Oben kumulierter Gewinn/Verlust (P&L, CHF) für Strategie A und B mit Hebel 20. Unten Balken: Differenz $\Delta = (B - A)$ je Tag.

Strategie A vs B – kumulierter Gewinn (P&L) als Punkte (Hebel 20, Test-Split)

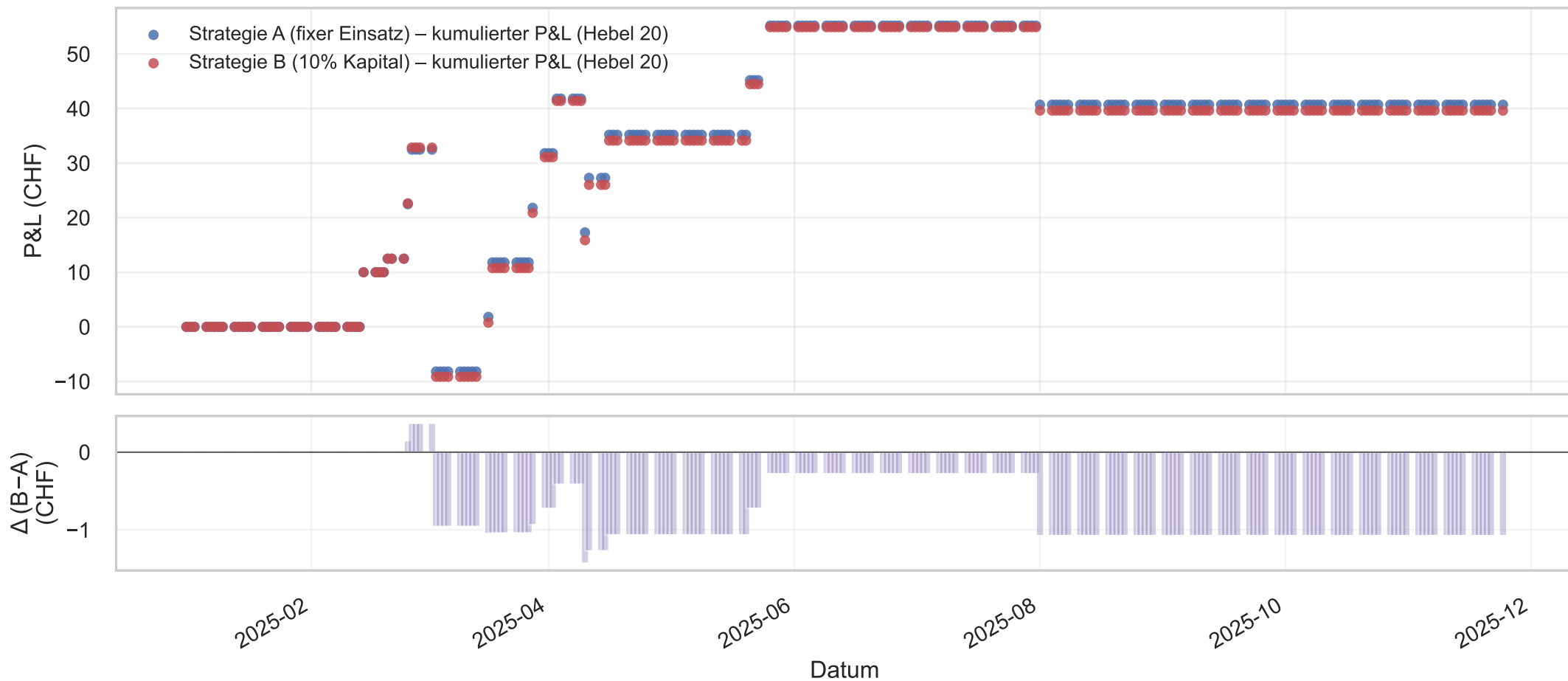
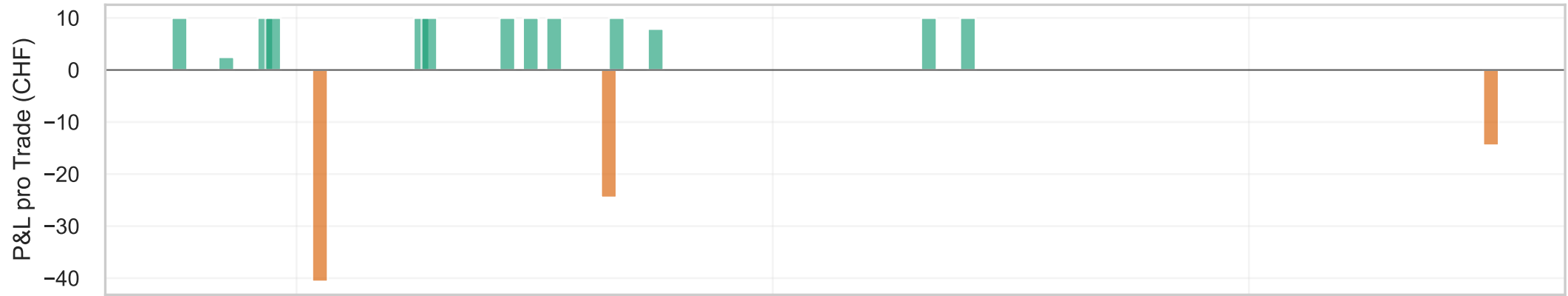
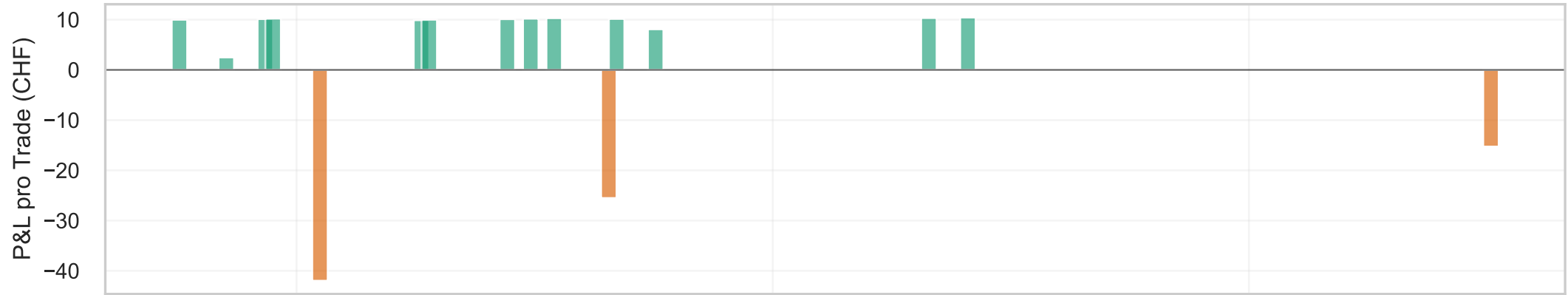


Abbildung: Oben kumulierter Gewinn/Verlust (P&L) als Punkte. Unten Balken: Differenz $\Delta = (B - A)$ je Tag.

Strategie A – Gewinn pro Trade (Hebel 20, nur Trade-Tage)



Strategie B – Gewinn pro Trade (Hebel 20, nur Trade-Tage)



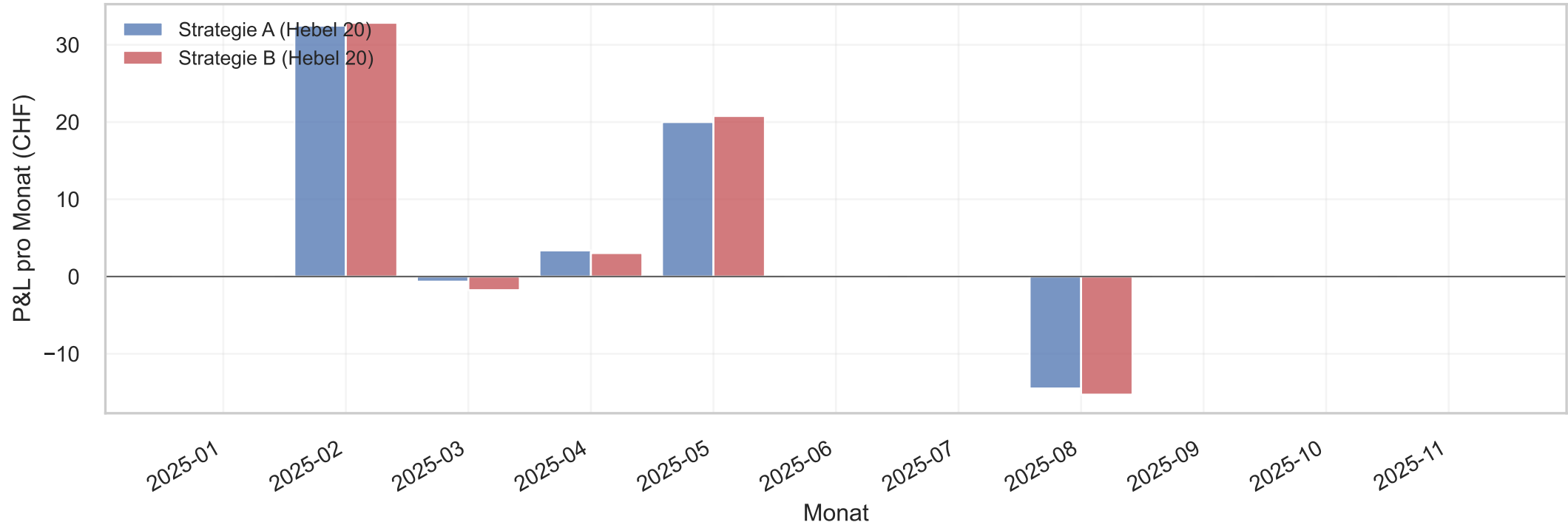
2025-03

2025-05

2025-07

Datum

Gewinn pro Monat (Hebel 20, Test-Split)



5-Jahres-Projektion (Bootstrap-Monte-Carlo, Hebel 20)

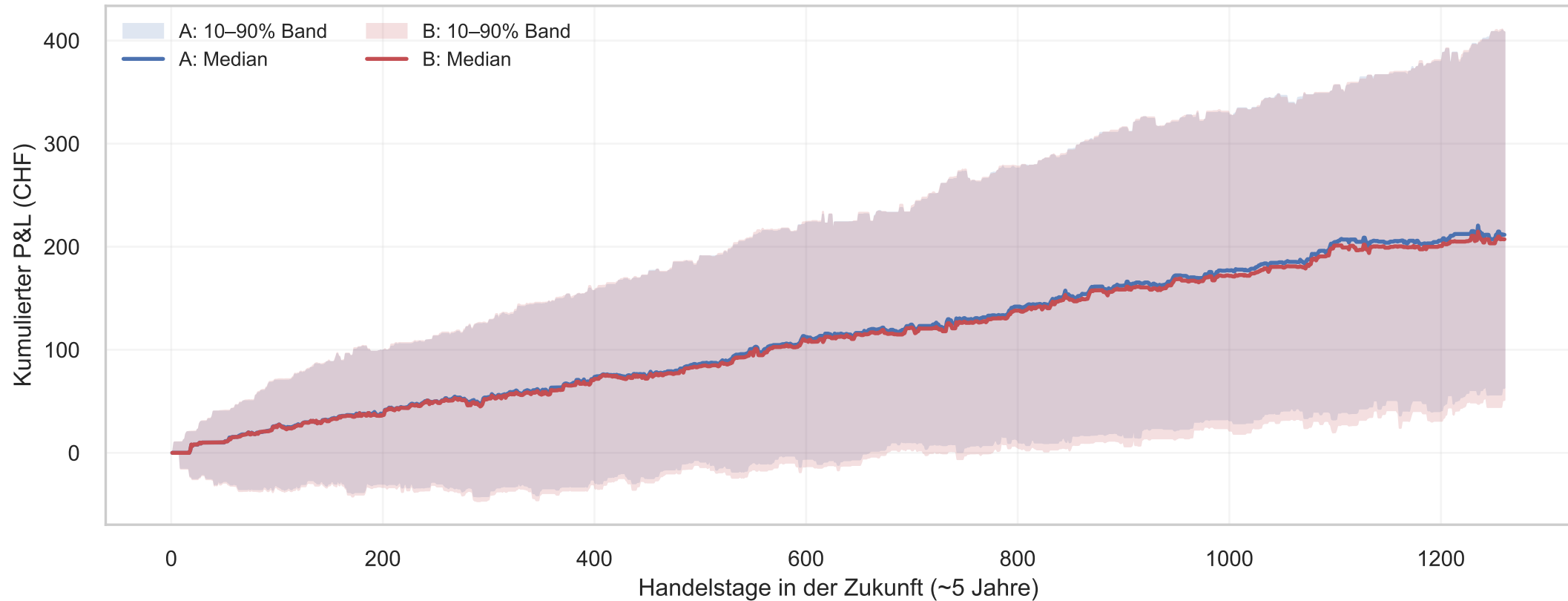


Abbildung: Keine echte Prognose. Es wird angenommen, dass die Verteilung der Tages-Ergebnisse aus dem Testzeitraum (inkl. Tage ohne Trades) in der Zukunft ähnlich bleibt. Gezeigt sind Median und 10–90%

Strategie A – kumulierter P&L (Test-Split)

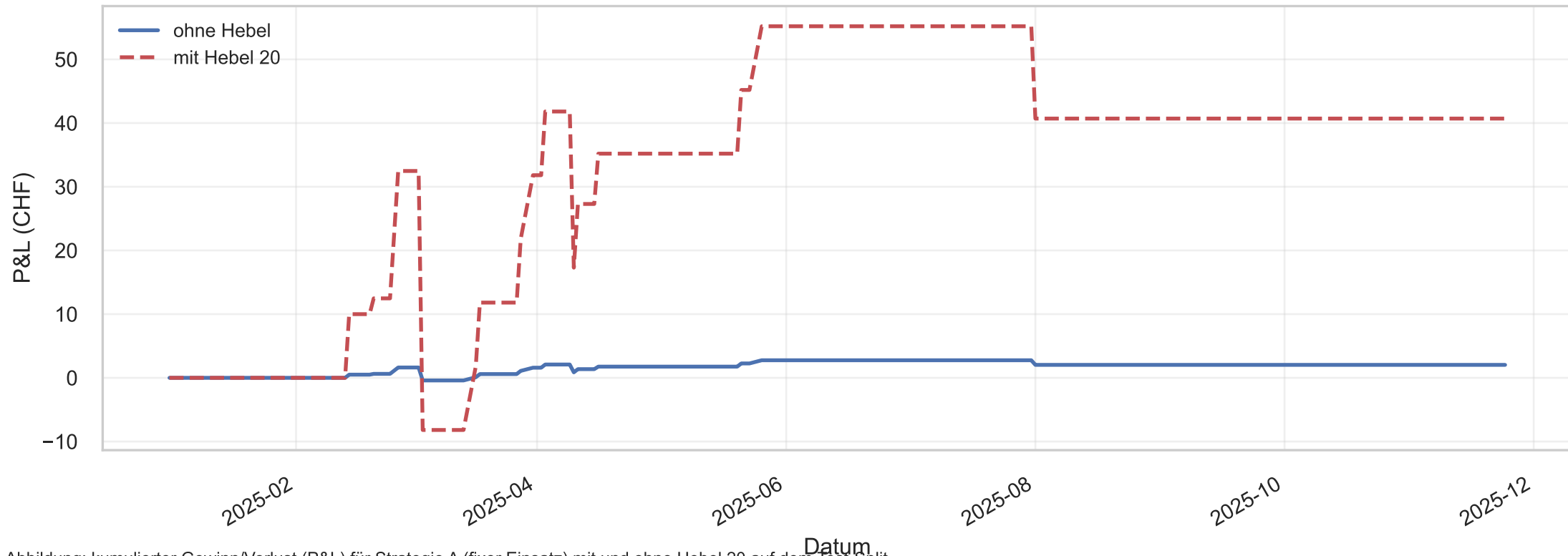


Abbildung: kumulierter Gewinn/Verlust (P&L) für Strategie A (fixer Einsatz) mit und ohne Hebel 20 auf dem Test-Split.

Strategie B – kumulierter P&L (Test-Split)

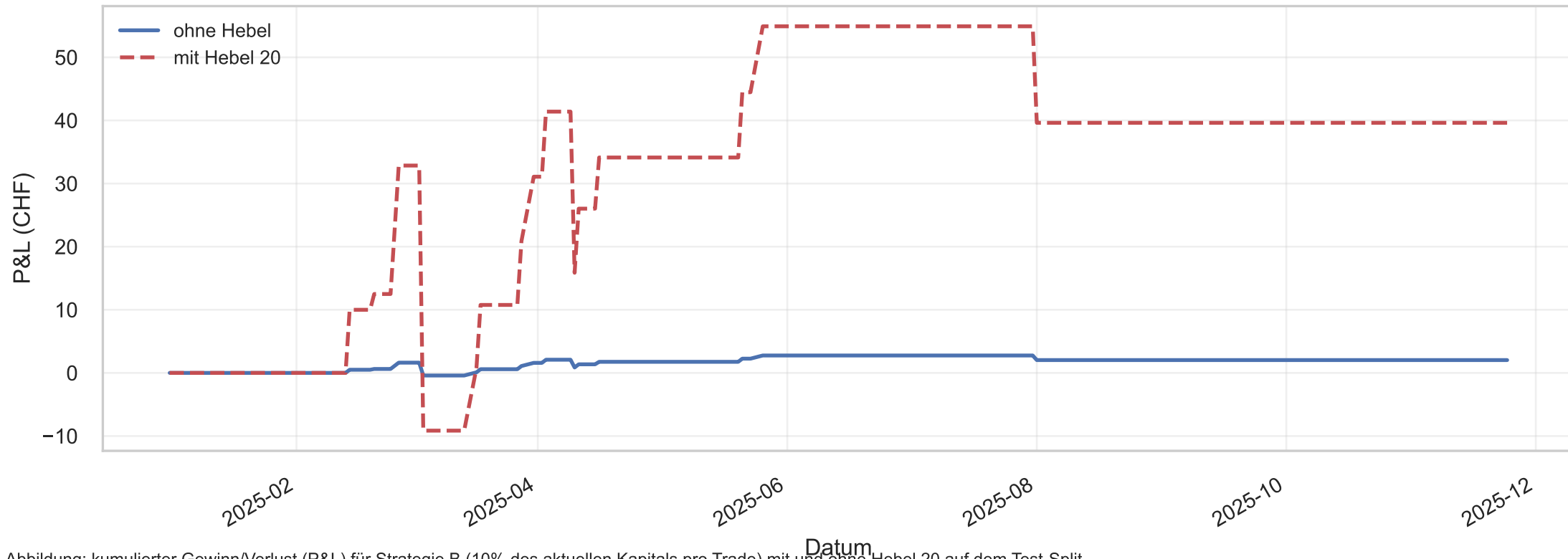


Abbildung: kumulierter Gewinn/Verlust (P&L) für Strategie B (10% des aktuellen Kapitals pro Trade) mit und ohne Hebel 20 auf dem Test-Split.

Feature Importance – Signal-Modell

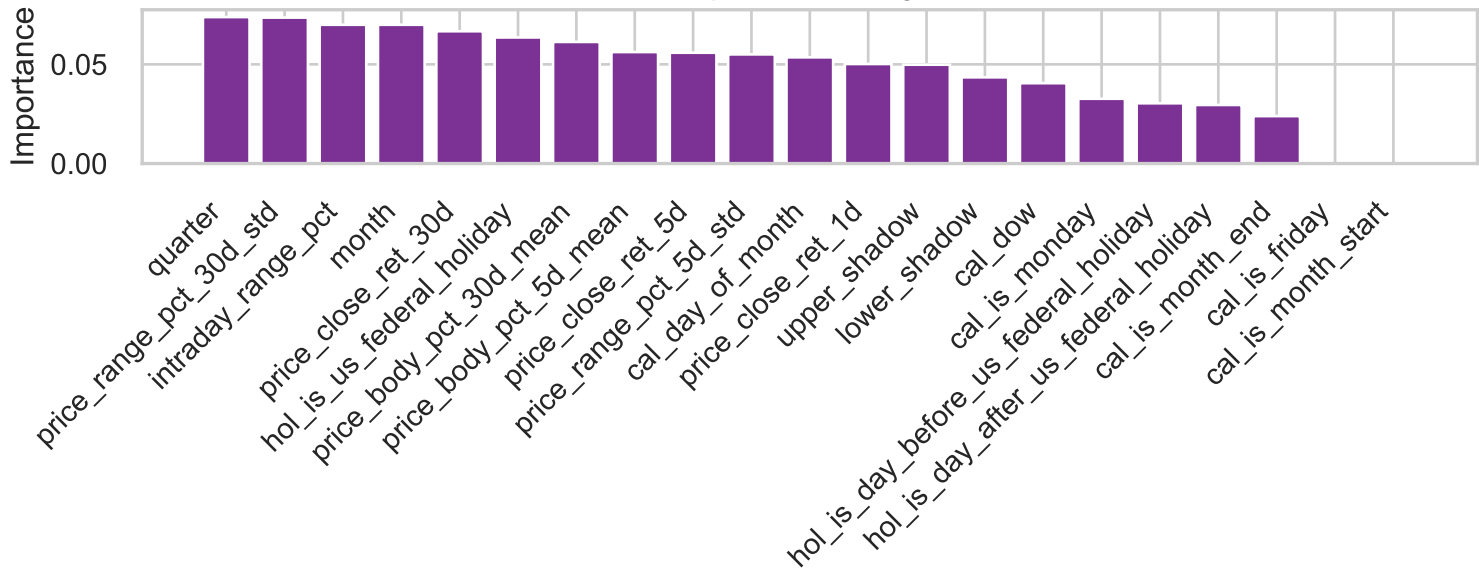


Abbildung: Wichtigkeit der Features für das Signal-Modell (neutral vs move).

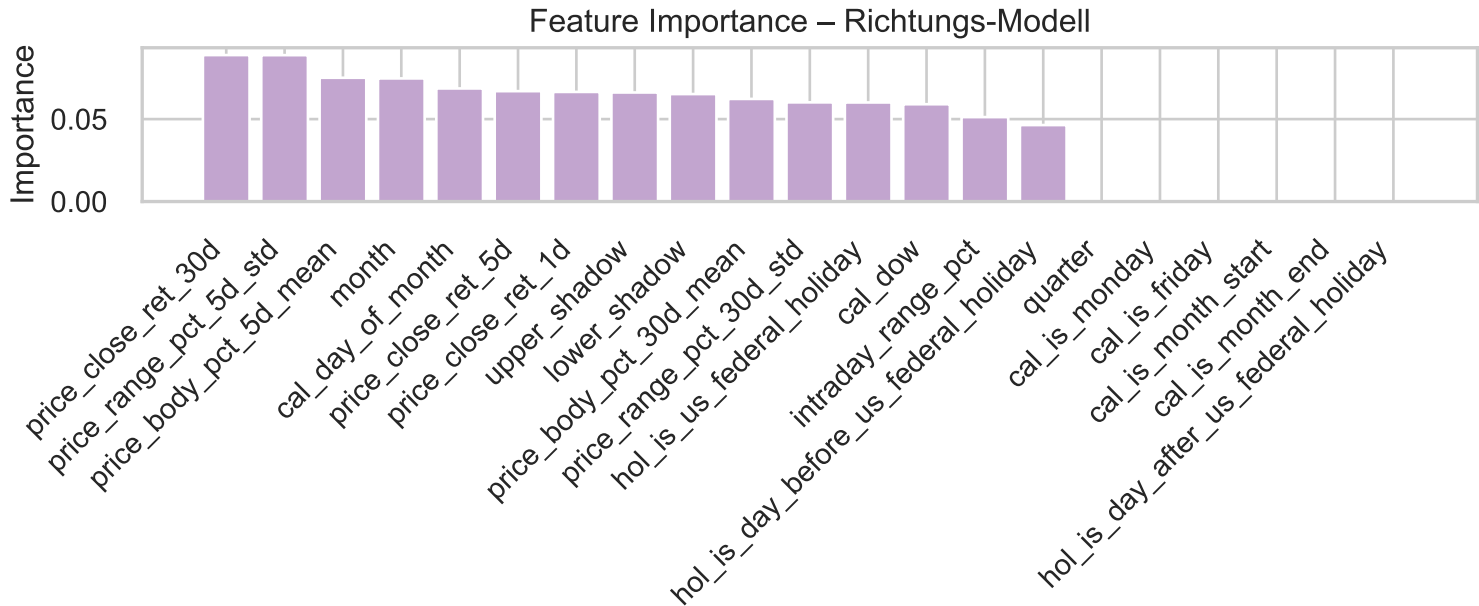


Abbildung: Wichtigkeit der Features für das Richtungs-Modell (down vs up).