

Konfiguration & Filter

Historie-Filter

Markt-Regime filtern (Tab 1):

Bull x Bear x x ▼

ML-Signal filtern (Tab 1):

Up x x ▼

Down x x ▼

Ähnlichkeits-Analyse (Analogiebildung)

Anzahl ähnlicher Tage (Top-K):

6

1 100

Modell-Einstellungen

(Die Modellauswahl befindet sich jetzt in den jeweiligen 'Metriken'-Tabs.)

✓ Versuche, Datei von Pfad: /Users/burcukiran/Desktop/Abschlussprojekt_Data_Science/data/processed laden...

✓ Daten erfolgreich geladen und PCA-Spalten als Float konvertiert! Shape: (3891, 24)

B BTC Markt-Regime & Prognose-Dash

🎯 Prognose-Fokus

Wählen Sie einen Datumsbereich (Historie):

2015-04-04

Analyse-Zeitraum: 2025-07-09 bis 2025-11-27 | Fokus-Tag: 2025-11-27

[Metriken \(Richtung/Signal\)](#) [Clustering-Metriken \(Markt-Regime\)](#) Signal-Analyse & Analogien [Markt-Visualisierung \(P\)](#)

2. Signal-Analyse & Analogien

🎯 **Fokus-Tag: 2025-11-27 (Regime: Sideways | Signal: ⚡ Down)**

Ähnlichkeitsanalyse basiert auf den Top 6 ähnlichen Tagen.

2.1 Historische Analogien (Was passierte nach ähnlichen Tagen?)

	Ergebnis
Tage analysiert	5 Tage
Durchschn. 7d Return (Real)	1.53 %
Anteil Up (7d)	80.00 %
Median 7d Return (Real)	0.43 %

Interpretation der historischen Unterstützung

👍 Stark Bullish: In 80% der ähnlichen Fälle stieg der Preis in den nächsten 7 Tagen. Der durchschnittliche historische Unterstutzung das Signal des ML-Modells stark.

📋 Details der Top 6 Analogien

Date	Regime	PC1	PC2	Ähnlichkeit (Abstand)	Schlusskurs	Tägl. Return
2025-11-26 00:00:00	Sideways	3.791	1.229	0.058	90,518.37	0.0364
2025-07-16 00:00:00	Sideways	3.668	1.191	0.071	118,738.51	0.0082
2025-07-22 00:00:00	Sideways	3.772	1.134	0.085	119,995.41	0.0218
2025-07-09 00:00:00	Sideways	3.675	1.148	0.088	111,326.55	0.0218
2025-07-12 00:00:00	Sideways	3.645	1.135	0.119	117,435.23	-0.0007
2025-07-02 00:00:00	Sideways	3.594	1.235	0.144	108,859.32	0.0299

Bedeutung der Kennzahlen in der Analogie-Tabelle

Kennzahl	Bedeutung	Idealer Wert
Ähnlichkeit (Abstand)	Der euklidische Abstand zwischen dem Fokus-Tag und diesem historischen Tag im PCA-Raum (PC1/PC2).	Niedriger
PC1 / PC2	Die Marktposition an diesem historischen Tag. Zeigt, ob der Tag tatsächlich dem Fokus-Tag ähnelt.	Nahe den Werten
Tatsächlicher 7d Return (Real)	Die tatsächliche prozentuale Preisänderung, die in den 7 Tagen nach diesem historischen Tag (der Analogie) eingetreten ist.	Positiv bei starken Anstiegen, negativ bei starken Abfällen

2.2 Erklärung der Logik und Interpretation

Signal-Analyse: Was bedeutet das?

Dieser Tab verbindet die rohe **Prognose** des Machine-Learning-Modells mit der **historischen Erfahrung** (Analogie).

1. Der ML-Prognose-Fokus (Signal des Fokus-Tages)

Das ML-Modell hat für den **Fokus-Tag** (2025-11-27) das Signal  Down mit dem Markt-Regime **Sideways** ausgespielt. Dies basiert auf der 1-Tages-Prognose der Klassifikationsmodelle, die die aktuellen **technischen Kennzahlen** bewerten.

2. Die Analogie-Validierung (Historischer Vergleich)

Die **Analogien** suchen mithilfe des **PCA-Markt-Regime-Raums** (, ) nach historischen Tagen, die dem Fokus-Tag am ähnlichsten waren.

 **Prüfschritt:** Was geschah **historisch** in den 7 Tagen, nachdem der Markt in der gleichen Konstellation wie heute war?

3. Interpretation der Ergebnisse (Ihre Frage)

Die Metriken der Analogien dienen als **Konfidenz-Filter** für die ML-Prognose:

- **Hohe Übereinstimmung** (z.B. > 80% Anteil Up): Das aktuelle Signal ( Down) ist historisch sehr wahrscheinlich bestätigt worden.
- **Niedrige Übereinstimmung** (z.B. < 40% Anteil Up): Das aktuelle Signal ( Down) widerspricht der historischen Erfahrung.