

ML Report Predikcie Akcií

Ticker: MSFT

Vygenerované: 2026-02-18 21:13:34

Manažérske Zhrnutie (Executive Summary)

Tento report predstavuje komplexnú analýzu akcie MSFT pomocou pokročilých modelov strojového učenia (ML). Najvýkonnejší model je **ML_EXTRATREES** s raw smerovou presnosťou (Raw DA) **87.2%** (oproti Buy & Hold baseline 52.2%).

Predikcia na ďalší Deň: HOLD/CASH (Očakávaný Výnos: -111.22%)

Metriky Výkonnosti Modelov

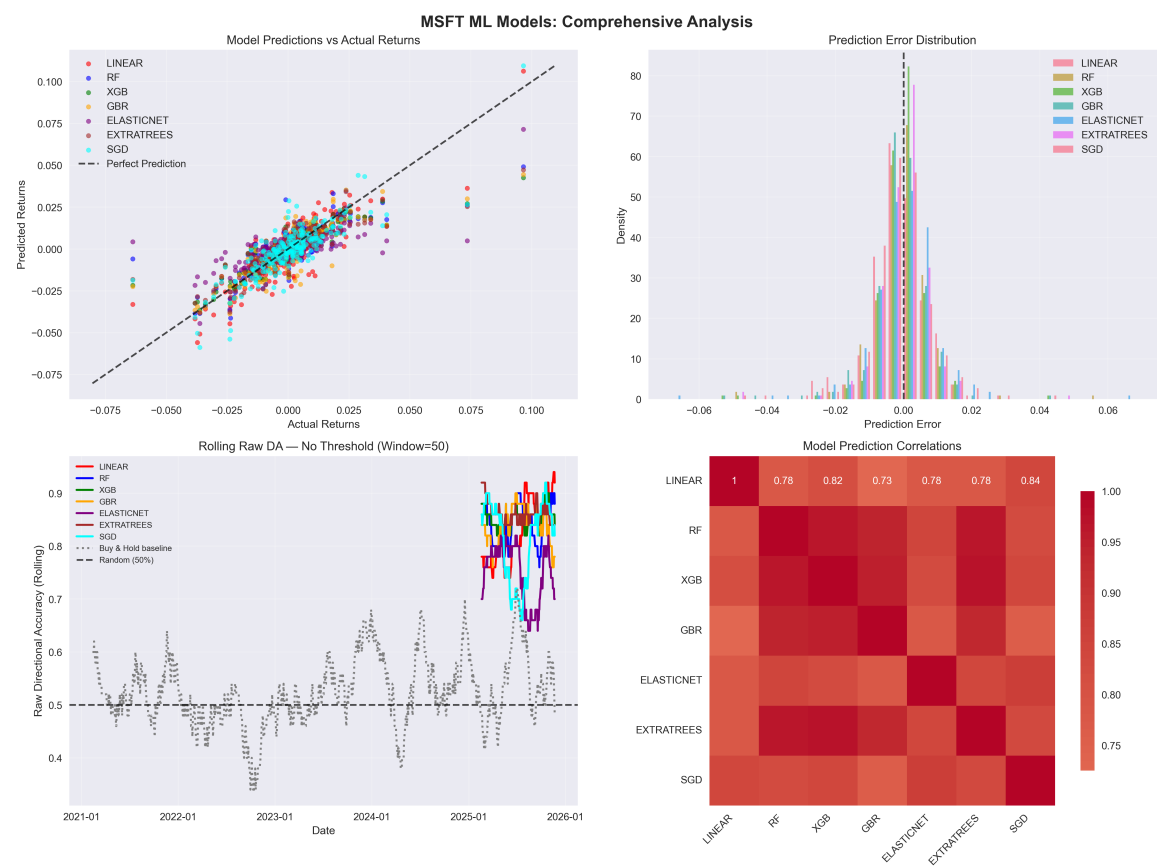
Model	RMSE	MAE	Raw DA	Confident DA	Coverage
Buy & Hold (baseline)	—	—	52.2%	—	100.0%
LINEAR	0.0084	0.0060	84.0%	85.5%	88.1%
RF	0.0087	0.0055	85.2%	90.7%	79.4%
XGB	0.0077	0.0047	86.0%	90.0%	86.0%
GBR	0.0088	0.0058	84.0%	88.0%	88.9%
ELASTICNET	0.0107	0.0070	73.3%	78.3%	72.0%
EXTRATREES	0.0081	0.0052	87.2%	91.3%	85.6%
SGD	0.0089	0.0061	81.5%	86.8%	81.1%

Odporúčanie pre Zajtrašie Obchodovanie

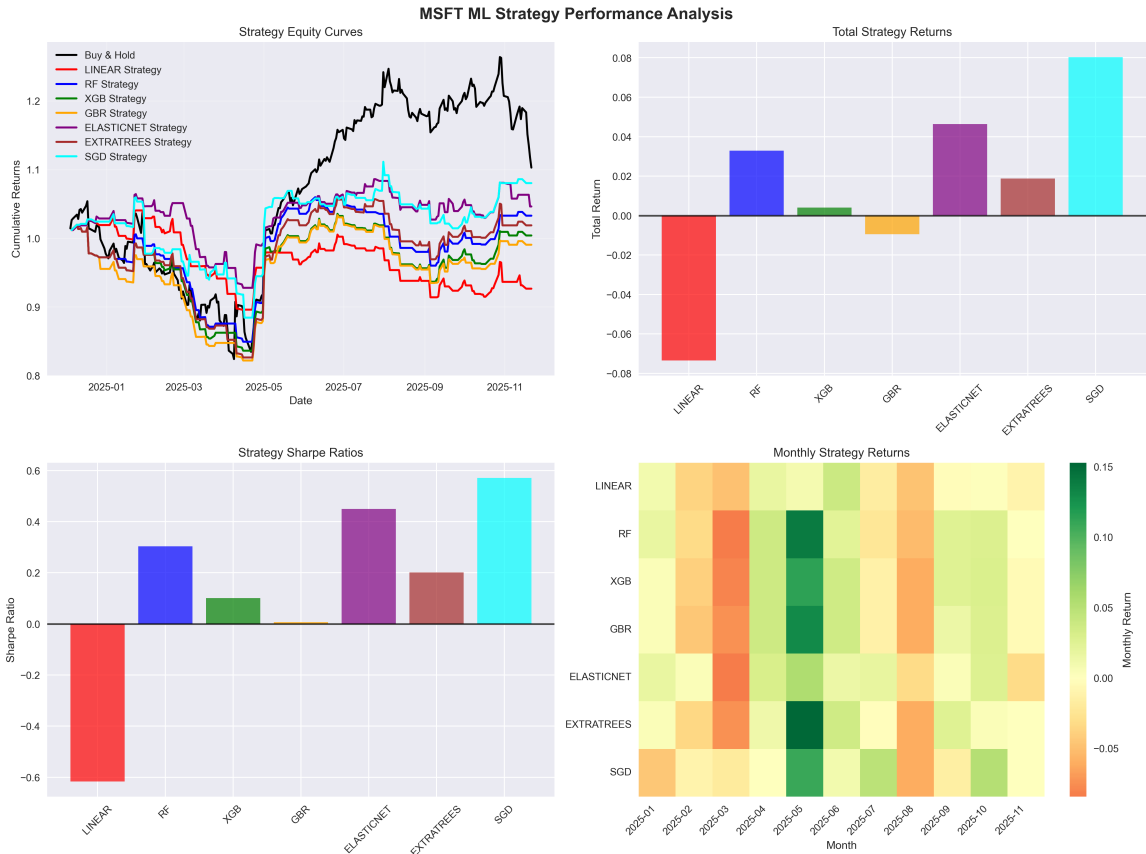
Metric (Metrika)	Value (Hodnota)
Best Model	EXTRATREES
Predicted Return	-1.11%
Raw DA	87.2%
Buy & Hold DA	52.2%
Recommendation	HOLD/CASH

Analytické Grafy (Analysis Charts)

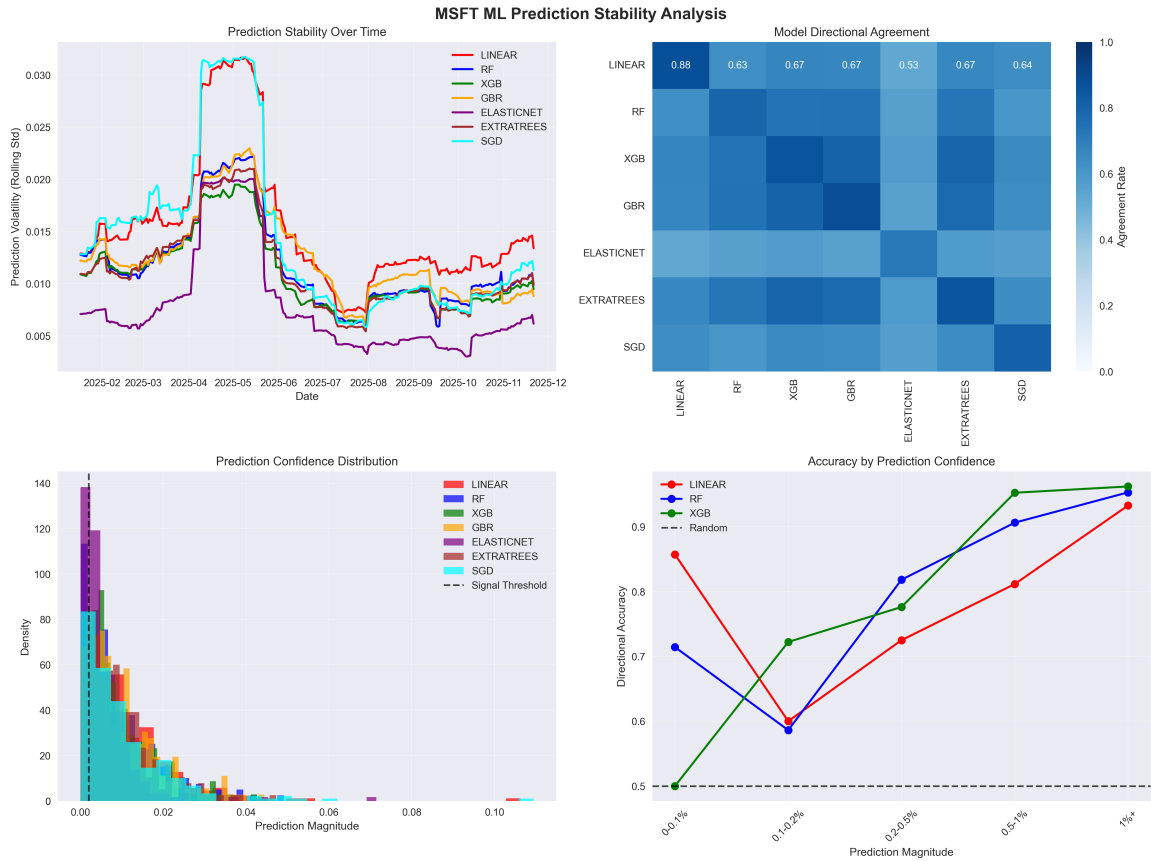
Porovnanie Modelov & Analýza Chýb (Model Predictions vs Actual Returns)



Výkonnos ■ Stratégie & Metriky Rizika (Strategy Performance)



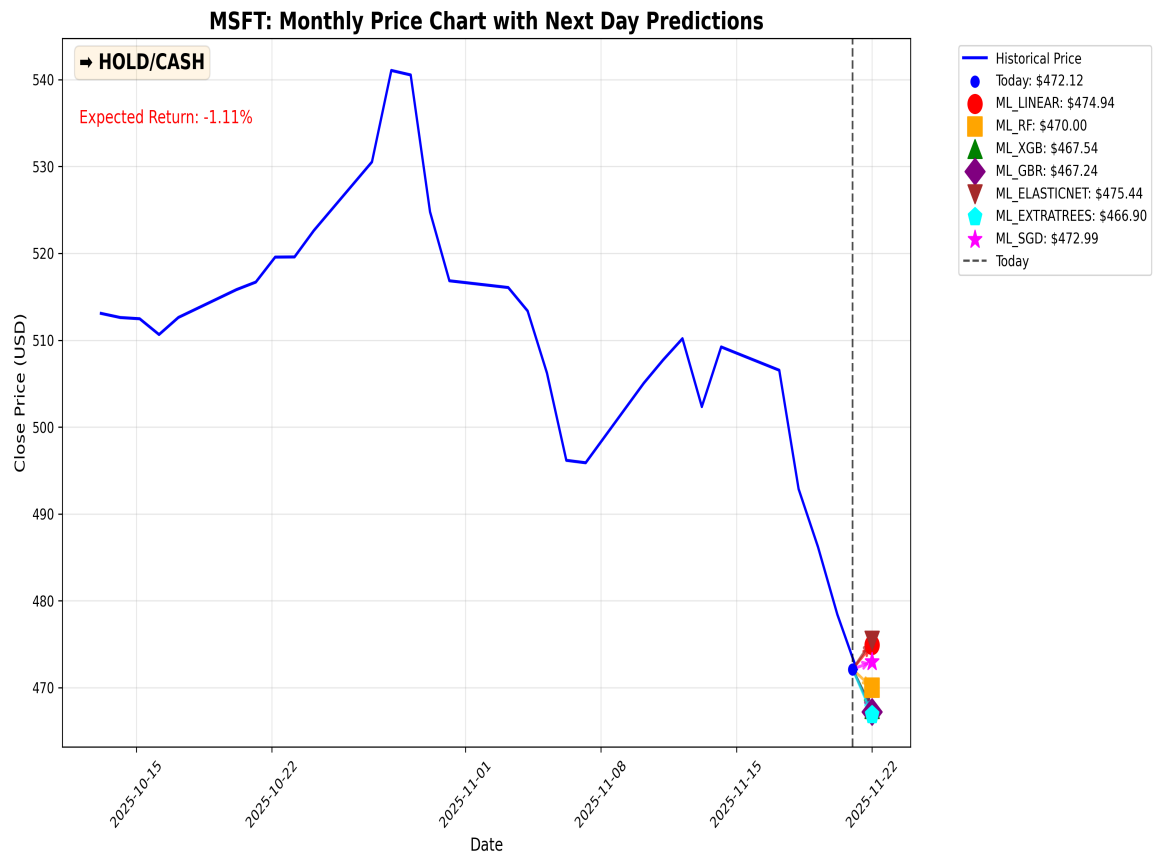
Stabilita Predikcií & Zhoda Modelov (Prediction Stability)



Analýza Atribútov & Korelácie (Feature Importance)



next_day_predictions



Závery & Odporúčania (Conclusions)

Na základe komplexnej ML analýzy akcie MSFT je možné vyvodiť nasledujúce závery: 1. **Výkonnosť Modelov:** Modely strojového učenia dosahujú raw smerovú presnosť (Raw DA) v rozsahu od 73.3% do 87.2%, v porovnaní s Buy & Hold baseline 52.2%. 2. **Najlepší Model:** ML_EXTRATREES poskytuje najspoľahlivejšie predikcie pre obchodné rozhodnutia. 3. **Riadenie Rizík:** Implementovaná stratégia založená na prahu (0.2%) efektívne redukuje falošné signály a zlepšuje kvalitu signálov. 4. **Implementácia:** Zvážte implementáciu odporúčanej obchodnej stratégie s primeraným dimenzovaním pozícií a protokolmi riadenia rizík. 5. **Monitorovanie:** Pravidelné pretrénovanie modelov a monitorovanie výkonnosti je nevyhnutné pre udržanie presnosti predikcií. **Vylúčenie Zodpovednosti (Disclaimer):** Táto analýza slúži len na informačné účely a nemala by byť považovaná za finančné poradenstvo.