

Table 3: The AUC results of four machine learning algorithms with the price/return of 2, 3 and 5 days ago

	Price	Return	Price	Return	Price	Return	Price	Return
Symbol	LR		RF		MLP		LSTM	
ADAUSD-2	0.4872	0.5549	0.5385	0.4972	0.4835	0.5211	0.5059	0.5033
ADAUSD-3	0.4919	0.5549	0.5263	0.4954	0.5024	0.5090	0.4782	0.5222
ADAUSD-5	0.4942	0.5549	0.5274	0.5109	0.5124	0.5185	0.5233	0.5355
BNBUSDT-2	0.5174	0.5349	0.4811	0.5114	0.5000	0.5346	0.4704	0.5000
BNBUSDT-3	0.5174	0.5523	0.4939	0.5352	0.5736	0.5755	0.4438	0.5000
BNBUSDT-5	0.5429	0.5523	0.4923	0.5148	0.5000	0.5477	0.4941	0.5000
BTCUSD-2	0.4965	0.5401	0.4988	0.5324	0.5000	0.5013	0.5000	0.5084
BTCUSD-3	0.5063	0.5401	0.5030	0.5421	0.5044	0.5161	0.4789	0.4824
BTCUSD-5	0.5063	0.5401	0.4970	0.5313	0.4968	0.5222	0.4911	0.5131
DOTUSD-2	0.4775	0.6620	0.5085	0.5276	0.4518	0.5391	0.5076	0.5368
DOTUSD-3	0.4775	0.6197	0.4994	0.5282	0.5191	0.5778	0.4709	0.5058
DOTUSD-5	0.5056	0.6197	0.5359	0.5211	0.4625	0.5657	0.4292	0.5225
ETHUSD-2	0.5042	0.5245	0.4803	0.5748	0.5000	0.5385	0.4605	0.5000
ETHUSD-3	0.5014	0.5228	0.4836	0.5119	0.4987	0.5542	0.5000	0.5000
ETHUSD-5	0.4930	0.5350	0.5019	0.5552	0.5000	0.5711	0.5000	0.5329
SOLUSD-2	0.5118	0.5476	0.4819	0.4792	0.5173	0.5353	0.4952	0.5003
SOLUSD-3	0.5118	0.5595	0.4940	0.4873	0.4951	0.5647	0.4795	0.5049
SOLUSD-5	0.5308	0.5952	0.4594	0.4616	0.5239	0.5464	0.4859	0.5000
XRPUSD-2	0.5197	0.5145	0.5168	0.5524	0.5134	0.5378	0.5103	0.5071
XRPUSD-3	0.5104	0.5581	0.5082	0.5335	0.4871	0.5617	0.5158	0.4879
XRPUSD-5	0.5035	0.5407	0.5137	0.5426	0.4939	0.5643	0.5182	0.4821
Average	0.5051	0.5583	0.5020	0.5212	0.5017	0.5430	0.4885	0.5069