

Checkliste für den Test von „Blackbox“-Systemen mit dem Zen Monte Carlo Simulator

Folgende Eingabedaten (Systemtest bzw. „Backtest“-Resultate) müssen vorhanden sein bzw. vom Systemanbieter zur Verfügung gestellt werden:

- die Anzahl der „Gewinner“-Trades
- die Anzahl der „Verlierer“-Trades
- der durchschnittliche Gewinn je „Gewinner“-Trade
- der durchschnittliche Verlust je „Verlierer“-Trade
- die Anzahl der Kurse bzw. der OHLC-Kurse, die dem Systemtest / „Backtest“ zugrunde lagen, also die Zeitperiode
- die Anzahl der Kurse je Zeiteinheit, also die Art der Daten des Systemtests (handelte es sich um Wochendaten, Tagesdaten, Stundendaten, Minutendaten etc. ?)

Diese wenigen Eingabedaten seitens des Systemanbieters genügen, um mit dem **Zen Monte Carlo Simulator** eine Systemsimulation durchzuführen und erste Aussagen bzgl. der Chancenbewertung und der Risikoanalyse des Systems zu treffen!

(Anmerkung: Stellt der Anbieter auch seine historischen Testdaten zur Verfügung ist eine erweiterte Analyse bzw. eine Validierung des Systems mit Hilfe der Datensimulation möglich.)

Beispiel: Systemsimulation mit dem **Zen Monte Carlo Simulator**

Zen Monte Carlo Simulator v6.0 - Systemsimulation

Datei Bearbeiten Hilfe

Name des Systems: Systemtest Beispiel

Anzahl Gewinner-Trades: 510 TR: 0,51 Anzahl Verlierer-Trades: 490

Durchschnittl. Gewinn je Trade: 60 PR: 1,33 Durchschnittl. Verlust je Trade: -45

Anzahl der Testkurse: 1260 PX: 1,39 Anzahl Kurse je Zeiteinheit: 252

Währungswert je Punkt: F Statistische Sicherheit (nur VaR): 95,00%

Anzahl der Trades je MCS-Lauf: 1000 Anzahl der MCS-Läufe: 1000

Monte Carlo Simulation grafisch anzeigen Export (.csv) aktiviert

optionaler Dokumentationsmodus starke PRNG-Zufallszahlen (Diehard/ENT)

Gewinn/Zeiteinheit, Min.:	3.825	Drawdown, Min.:	-1.575
Gewinn/Zeiteinheit, Max.:	13.800	Drawdown, Max.:	-8.325
Gewinn/Zeiteinheit, Mittelwert:	8.511	Drawdown, Mittelwert:	-3.438
Average Case Ratio (ACR):	0,40	Worst Case Ratio (WCR):	2,18

Gewinn-Schätzwert, VaR:	5.331	Drawdown-Schätzwert, VaR:	-5.313
-------------------------	-------	---------------------------	--------

OK Abbrechen Datensimulation Default Hilfe

Berechnung beendet! (simulierte Trades: 1.000.000, Zeit: 0,06 Sekunden)