

Checkliste für den Test von „Blackbox“-Systemen mit dem Zen Monte Carlo Simulator v5

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
- (optional der maximale Verlust eines einzelnen Trades)
- die Anzahl der Kursbalken bzw. der OHLC-Kurse, die dem Systemtest / „Backtest“ zugrunde lagen
- die Anzahl der Kursbalken 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 fundierte Analyse bzw. eine Validierung des Systems mit Hilfe der Datensimulation möglich.)

Beispiel:
Systemsimulation mit dem **Zen Monte Carlo Simulator v5.0**.

Zen Monte Carlo Simulator v5.0 - Systemsimulation

Datei Bearbeiten Hilfe

Name des Systems: Systemtest Blackboxsystem

Anzahl Gewinner-Trades: 300 TR: 0,55 Anzahl Verlierer-Trades: 250

Durchschnittl. Gewinn je Trade: 51 PR: 1,46 Durchschnittl. Verlust je Trade: 35

Anzahl der Test-Kursbalken: 756 FX: 1,75 Anzahl Kursbalken je Zeiteinheit: 252

Währungswert je Punkt: 25 Statistische Sicherheit (VaR): 95,00%

Anzahl der Trades je MC Sim.: 252 Anzahl der MC Simulationsläufe: 10000

Monte Carlo Simulation grafisch anzeigen Grafik expandieren

Gewinn/Zeiteinheit, Min.:	6.948	Account-Drawdown, Min.:	1.275
Gewinn/Zeiteinheit, Max.:	102.361	Account-Drawdown, Max.:	-15.700
Gewinn/Zeiteinheit, Mittelwert:	54.600	Account-Drawdown, Mittelwert:	-1.206
Average Case Ratio (ACR):	0,02	Worst Case Ratio (WCR):	2,26

Gewinn-Schätzwert, VaR:	30.267	Account-DD-Schätzwert, VaR:	-5.376
-------------------------	--------	-----------------------------	--------

OK Abbrechen Datensimulation Hilfe

Berechnung beendet!