

Performance-Vergleich zwischen einer Excel-Lösung und dem Zen Monte Carlo Simulator

Hardware:

Pentium M / 1,86 GHZ, 1024 MB RAM

Software:

Windows XP SP2

Anzahl der simulierten Trades	Benötigte Zeit für <i>Excel-Lösung mit VBA</i> *	<i>Zen Monte Carlo Simulator</i> **
500.000	6 Sekunden	< 1 Sekunde
1.000.000	11 Sekunden	< 1 Sekunde
5.000.000	83 Sekunden	< 1 Sekunde
10.000.000	> 3 Minuten	< 1 Sekunde
50.000.000	> 15 Minuten	3 Sekunden
100.000.000	-	9 Sekunden
500.000.000	-	36 Sekunden
1.000.000.000	-	71 Sekunden

* die Excel-Tests wurden mit MS Office 2003 durchgeführt

** die Zen Monte Carlo Simulator-Tests wurden mit dem Zen Monte Carlo Simulator v5.0 durchgeführt.

Das Produkt ist in PowerBasic implementiert (www.powerbasic.com).

PowerBasic erzeugt extrem kompakte und sehr schnelle Programme (vergleichbar der Ausführungsgeschwindigkeit von C-Programmen).