

# Zen Monte Carlo Simulator v5.1

**Systemsimulation**  
Chancenbewertung  
und Risikoanalyse von  
Handelssystemen

**Zen Monte Carlo Simulator v5.01 - Systemsimulation**

Systemtest

Anzahl Gewinner-Trades:	150	TR: 0.43	Anzahl Verlierer-Trades:	200
Durchschnittl. Gewinn je Trade:	75	PR: 3.00	Durchschnittl. Verlust je Trade:	25
		FX: 2.25	<input checked="" type="checkbox"/> Simulation mit max. Verlust:	30
Anzahl der Test-Kurzbalken:	1000		Anzahl Kurzbalken je Zeiteinheit:	252
Währungswert je Punkt:	10		Statistische Sicherheit (VaR):	95.00%
Anzahl der Trades je MC Sim.:	350		Anzahl der MC Simulationläufe:	10000

Monte Carlo Simulation grafisch anzeigen  Grafik expandieren

Gewinn/Zerleinheit, Min.:	8.676	Account-Drawdown, Min.:	900
Gewinn/Zerleinheit, Max.:	23.814	Account-Drawdown, Max.:	-6.300
Gewinn/Zerleinheit, Mittelwert:	15.733	Account-Drawdown, Mittelwert:	-338
Average Case Ratio (ACR):	0.07	Worst Case Ratio (WCR):	0.94
Gewinn-Schätzwert, VaR:	11.152	Account-DD-Schätzwert, VaR:	-2.116

OK Abbrechen Datensimulation Hilfe

Berechnung beendet!

**Zen Monte Carlo Simulator v5.01 - Datensimulation**

Name der Quelldatei: C:\zenentwicklung\incsim5\test\test\_bq2.txt Auswahl

Name des Zielverzeichnis: C:\zenentwicklung\incsim5\test\ Auswahl

Dateiformat (EDD bzw. Intraday): Format 01: Ticker,Date,Open,High,Low,Close,(Volume)

Anzahl der zu erstellenden Dateien: 1  Währungs-Genauigkeit 4 Kommastellen (z.B. Euro FX)

Neue Ticker-Bezeichnung (optional):   dynamisch

Name einer Simulationsdatei (optional):  Auswahl

Methode:  zufällige zeitliche Verteilung  
 zufällige zeitliche Verteilung und Korrektur der max. Open/Close-Differenzen

optionale Manipulation des Up/Down-Verhältnisses Anteil der Up-Kurse (%): 50

optionale Manipulation der Open/Close-Volatilität Open/Close-Volatilität (%): 1.00

optionale Manipulation der Kursmuster (Patterns) Blockgröße:  dynamisch 10

Open/Close-Differenzen... max Down: -407.27 / max Up: 291.02 Anteil der Up-Kurse...: 49 %

Minimal, Maximalwerte... Low: 2198.75 / High: 8136.16 Open/Close-Volatilität...: 1.31 %

OK Abbrechen Dateivergleich Hilfe

1 Dateien mit jeweils 1270 Datensätzen wurde(n) erfolgreich erstellt!

**Datensimulation**  
Validierung von  
Handelssystemen

**Effektiv, effizient und preisgünstig!**

# Die Systemsimulation ermöglicht Chancenbewertung und Risikoanalyse des Systems...

**Zen Monte Carlo Simulator v5.1 - Systemsimulation**

Datei Bearbeiten Hilfe

Name des Systems: Systemtest

Anzahl Gewinner-Trades: 100 TR: 0,50 Anzahl Verlierer-Trades: 100

Durchschnittl. Gewinn je Trade: 100 PR: 2,00 Durchschnittl. Verlust je Trade: 50

FX: 2,00  Simulation mit max.Verlust: 0

Anzahl der Test-Kursbalken: 1000 Anzahl Kursbalken je Zeiteinheit: 252

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

Anzahl der Trades je MC Sim.: 200 Anzahl der MC Simulationsläufe: 5000

Monte Carlo Simulation grafisch anzeigen  Grafik expandieren

optionaler Dokumentationsmodus...

---

Gewinn/Zeiteinheit, Min.:	7.875	Account-Drawdown, Min.:	2.500
Gewinn/Zeiteinheit, Max.:	51.345	Account-Drawdown, Max.:	-23.750
Gewinn/Zeiteinheit, Mittelwert:	31.402	Account-Drawdown, Mittelwert:	-1.372
Average Case Ratio (ACR):	0,04	Worst Case Ratio (WCR):	3,02

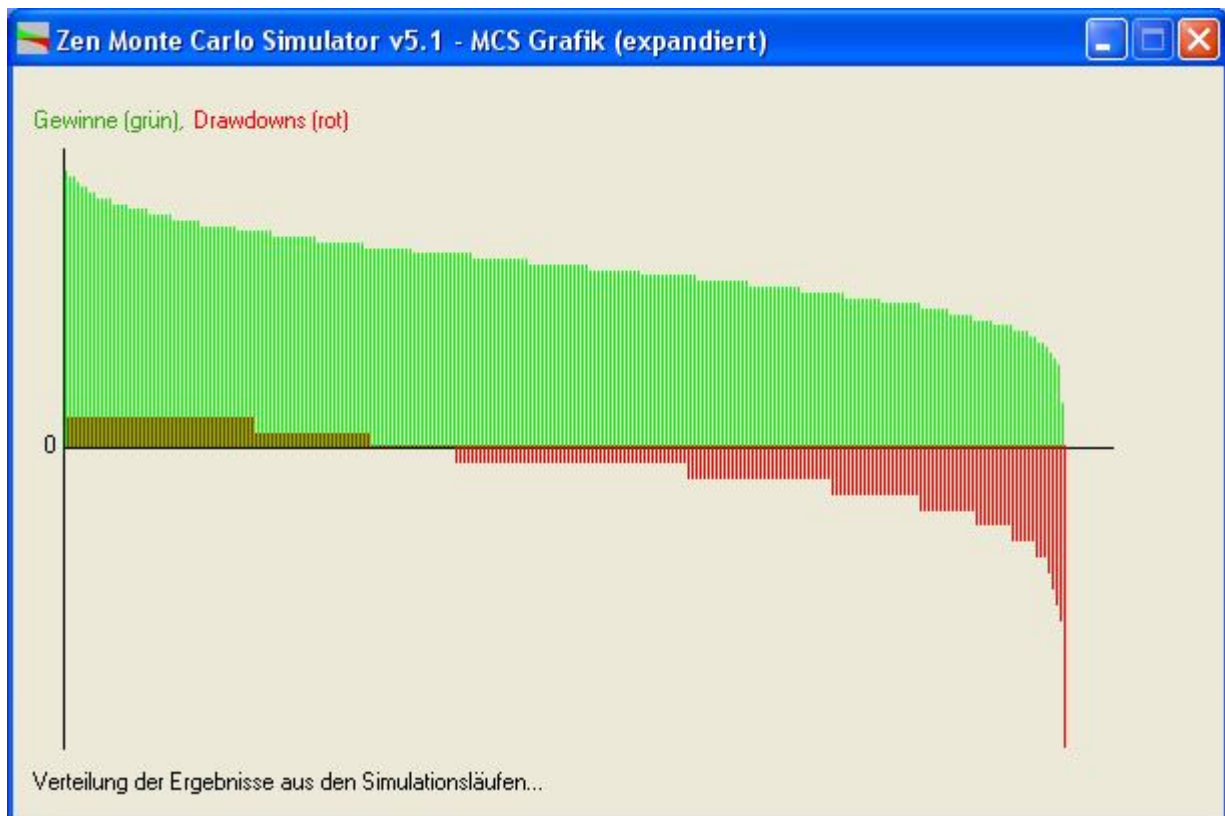
---

Gewinn-Schätzwert, VaR:	18.583	Account-DD-Schätzwert, VaR:	-7.557
-------------------------	--------	-----------------------------	--------

OK Abbrechen Datensimulation Hilfe

Berechnung beendet!

**...und die Verteilung der Monte Carlo Simulationen kann zusätzlich grafisch dargestellt werden.**



**Die Datensimulation ermöglicht die Erstellung von synthetischen Daten für alternative Systemtests und unterstützt somit eine Validierung des Systems.**

**Zen Monte Carlo Simulator v5.1 - Datensimulation**

Name der Quelldatei: C:\test\test.txt

Name des Zielverzeichnisses: C:\test\

Dateiformat (EOD bzw. Intraday): Format 01: Ticker,Date,Open,High,Low,Close,(Volume) ▾

Anzahl der zu erstellenden Dateien: 1  Währungs-Genauigkeit 4 Kommastellen (z.B. Euro FX)

Neue Ticker-Bezeichnung (optional):  dynamisch

Name einer Simulationsdatei (optional):

---

Methode:  zufällige zeitliche Verteilung  
 zufällige zeitliche Verteilung und Korrektur der max. Open/Close-Differenzen

optionale Manipulation des Up/Down-Verhältnisses Anteil der Up-Kurse (%): 50

optionale Manipulation der Open/Close-Volatilität Open/Close-Volatilität (%): 1,00

optionale Manipulation der Kursmuster (Patterns) Blockgröße:  dynamisch 10

---

optionaler Intermarket-Simulationsmodus...

---

Open/Close-Differenzen... max.Down: -502,49 / max.Up: 291,02 Anteil der Up-Kurse... 53 %  
Minimal-, Maximalwerte... Low: 2188,75 / High: 8151,57 Open/Close-Volatilität... 1,02 %

1 Datei(en) mit jeweils 2319 Datensätzen wurde(n) erfolgreich erstellt!

**Die Dateien können mittels 16 Methoden sowie zusätzlicher Parametrierungen erstellt werden...**

Methode	Zufällige zeitliche Verteilung ohne Korrektur	Zufällige zeitliche Verteilung mit Korrektur	Manipulat. der Up/Down-Kurse	Manipulat. der Volatilität	Manipulat. der Kursmuster
M1	x				
M2	x		x		
M3	x			x	
M4	x				x
M5	x		x	x	
M6	x		x		x
M7	x			x	x
M8	x		x	x	x
M9		x			
M10		x	x		
M11		x		x	
M12		x			x
M13		x	x	x	
M14		x	x		x
M15		x		x	x
M16		x	x	x	x

**...und optional grafisch verglichen werden.**



## **Systemvoraussetzungen:**

Win32 Software (Windows XP, Vista, 7 etc.),  
sehr geringe Hardwarevoraussetzungen

**Kostenlose  
Demo-Version!**

## **Preise (inkl. MwSt.):**

Einzellizenz:

Zen Monte Carlo Simulator v5.1

Developer Edition (EXE & DLL) 250 €

Multiuser- u.a. Lizenzen: Preise auf Anfrage

## **Kontakt:**

**Dipl.-Ing. Volker Butzlaff**  
**Buchstr. 11**  
**D-74321 Bietigheim-Bissingen**

**T. 0039-3275404329**  
[info@zentrader.de](mailto:info@zentrader.de)  
[www.zentrader.de](http://www.zentrader.de)