

Zen Monte Carlo Simulator v5.5

Systemsimulation Chancenbewertung und Risikoanalyse von Handelssystemen

Zen Monte Carlo Simulator v5.5 - Systemsimulation

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 Test-Kustbalken:	1260	FK: 1.39	Anzahl Kustbalken je Zeiteinheit:	252
Währungswert je Punkt:	5		Statistische Sicherheit (nur VaR):	95,00%
Anzahl der Trades je MC Sim:	1000		Anzahl der MC Simulationsläufe:	1000

Monte Carlo Simulation grafisch anzeigen
 Grafik expandieren
 optionaler Dokumentationsmodus

Simulation mit max. Verlust
 max DD - Kompatibilität
 starke PRNG-Zufallszahlen (Diehard/ENT)

Gewinn/Zeiteinheit, Min.:	2.775	Account-Drawdown, Min.:	300
Gewinn/Zeiteinheit, Max.:	73.485	Account-Drawdown, Max.:	-6.000
Gewinn/Zeiteinheit, Mittelwert:	8.463	Account-Drawdown, Mittelwert:	-725
Average Case Ratio (ACR):	0,08	Worst Case Ratio (WCR):	2,18
Gewinn-Schätzwert, VaR:	5.034	Account-DD-Schätzwert, VaR:	-2.451

Berechnung beendet! (simulierte Trades: 1.000.000, Zeit: 0,12 Sekunden)

Zen Monte Carlo Simulator v5.5 - Datensimulation

Name der Quelldatei: C:\test\Qiaindex.bt
Name des Zielverzeichnis: C:\test\
Dateiformat (EOD bzw. Intraday): Format 01: Ticker,Date,Open,High,Low,Close,Volume
Anzahl der zu erstellenden Dateien: 1
Neue Ticker-Bezeichnung (optional):
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 starke PRNG-Zufallszahlen (Diehard/ENT)

Max. Open/Close-Differenzen... Anteil der Up-Kurse...
Minimal-, Maximalwerte... Open/Close-Volatilität...

Datensimulation Validierung von Handelssystemen

Effektiv, effizient und preisgünstig!

Die Systemsimulation ermöglicht Chancenbewertung und Risikoanalyse des Systems...

Zen Monte Carlo Simulator v5.5 - 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 Test-Kursbalken: 1260 FX: 1,39 Anzahl Kursbalken je Zeiteinheit: 252

Währungswert je Punkt: 5 Statistische Sicherheit (nur VaR): 95,00%

Anzahl der Trades je MC Sim.: 1000 Anzahl der MC Simulationläufe: 1000

Monte Carlo Simulation grafisch anzeigen Simulation mit max. Verlust: 0

Grafik expandieren max DD - Kompatibilität

optionaler Dokumentationsmodus starke PRNG-Zufallszahlen (Diehard/ENT)

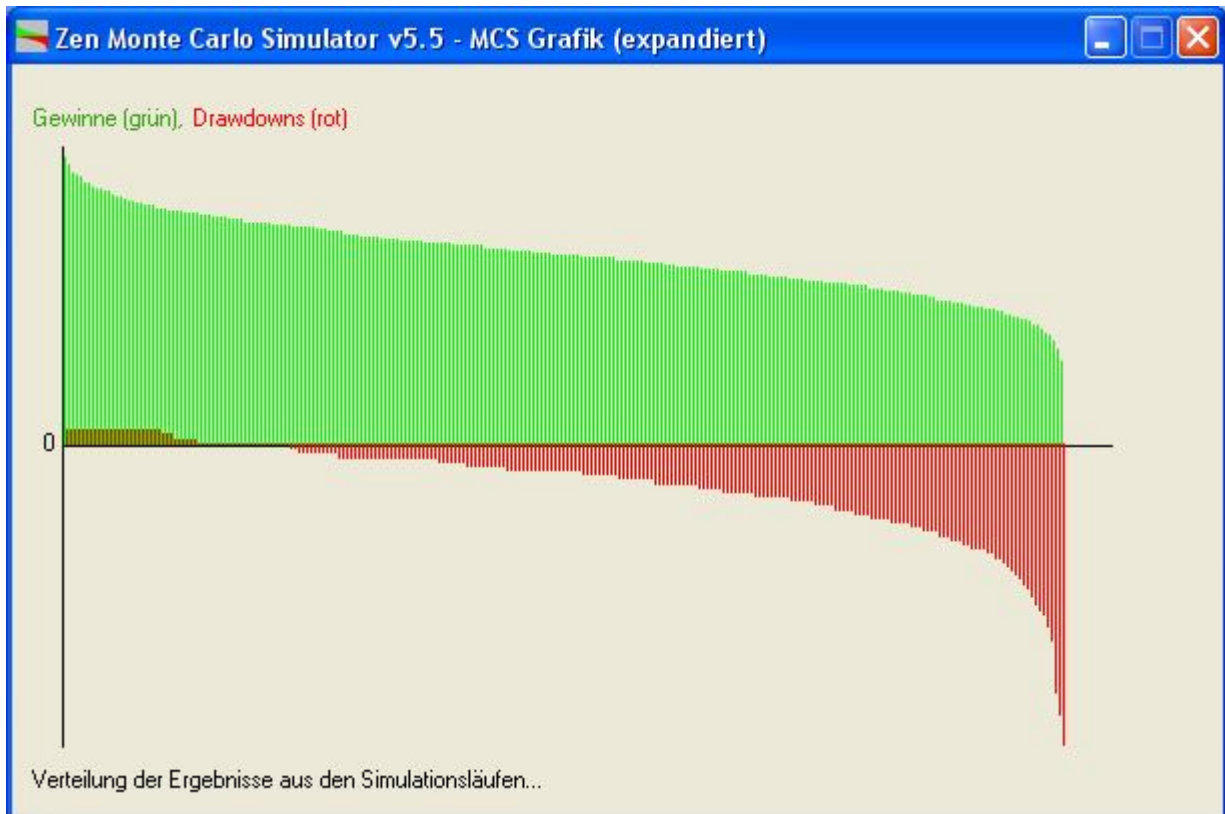
Gewinn/Zeiteinheit, Min.:	2.775	Account-Drawdown, Min.:	300
Gewinn/Zeiteinheit, Max.:	13.485	Account-Drawdown, Max.:	-6.000
Gewinn/Zeiteinheit, Mittelwert:	8.463	Account-Drawdown, Mittelwert:	-725
Average Case Ratio (ACR):	0,09	Worst Case Ratio (WCR):	2,16

Gewinn-Schätzwert, VaR:	5.034	Account-DD-Schätzwert, VaR:	-2.491
-------------------------	-------	-----------------------------	--------

OK Abbrechen Datensimulation Hilfe

Berechnung beendet! (simulierte Trades: 1.000.000, Zeit: 0,12 Sekunden)

...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 Handelssystems.

The screenshot shows the 'Zen Monte Carlo Simulator v5.5 - Datensimulation' dialog box. It is divided into several sections for configuring data simulation parameters.

Source and Output Settings:

- Name der Quelldatei: C:\test\DaxIndex.txt (with 'Auswahl' button)
- Name des Zielverzeichnisses: C:\test\ (with 'Auswahl' button)
- Dateiformat (EOD bzw. Intraday): Format 01: Ticker,Date,Open,High,Low,Close,(Volume) (dropdown menu)
- Anzahl der zu erstellenden Dateien: 1 (input field) with checkbox 'Währungs-Genauigkeit 4 Kommastellen (z.B. Euro FX)'
- Neue Ticker-Bezeichnung (optional): (input field) with checkbox 'dynamisch'
- Name einer Simulationsdatei (optional): (input field) with 'Auswahl' button

Simulation Method and Options:

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
- starke PRNG-Zufallszahlen (Diehard/ENT)

Additional Parameters:

- Max. Open/Close-Differenzen... (input field)
- Anteil der Up-Kurse... (input field)
- Minimal-, Maximalwerte... (input field)
- Open/Close-Volatilität... (input field)

Buttons: OK, Abbrechen, Dateivergleich, Hilfe

Status...

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 v5.5

Developer Edition (EXE & DLL) 250 €

Multiuser- u.a. Lizenzen: Preise auf Anfrage

Kontakt:

Dipl.-Ing. Volker Butzlaff

Buchstr. 11

D-74321 Bietigheim-Bissingen

info@zentrader.de

www.zentrader.de