

Performancevergleich Zen Trading System v1.7

Version 1.7

vom 18.01.2009

Autor: Dipl.-Ing. Volker Butzlaff

Buchstrasse 11
74321 Bietigheim-Bissingen (Deutschland)

Mail: info@zentrader.de

Inhalt:

Einleitung	4
1. Rahmenbedingungen für die Vergleiche	5
2. www.futurestruth.com	6
3. www.striker.com	7
Zusammenfassung	8

Haftungsausschluss

Das Softwareprodukt „**Zen Trading System**“ erzeugt auf Grundlage des implementierten mechanischen Handelssystems sowie der vom Anwender zur Verfügung gestellten Daten Kauf- bzw. Verkaufssignale für den Handel von Dax Index Börseninstrumenten. In der Vergangenheit erzielte Ergebnisse bieten jedoch keine Sicherheit für den zukünftigen Erfolg des Systems. Es kann deshalb keine Gewähr für den Handel nach diesen Systemansätzen übernommen werden. Der Anwender trägt sein Trading-Risiko selbst.

Einleitung

Das **Zen Trading System v1.7** ist eine professionelle Software für die Erzeugung von Handelssignalen für den Dax Index anhand von bereit gestellten Kursdaten (Tagesdaten).

Darüber hinaus ermöglicht die Software über einen implementierten komfortablen Systemtester den Test von unterschiedlichsten Datenkursreihen bzgl. des implementierten Handelssystems.

Dieses Gutachten enthält Benchmarks, also Vergleiche der Systemtests und der Performance des Zen Trading Systems mit veröffentlichten Werten und Ranglisten diverser anderer Handelssysteme.

1. Rahmenbedingungen für die Vergleiche

Folgende Rahmenbedingungen gelten für die Systemvergleiche:

- Die Transaktionskosten und das initiale Tradingkapital werden den Bedingungen für die Vergleichssysteme angepasst.
- Nach Möglichkeit wird auch der Vergleichszeitraum entsprechend angepasst.

2. www.futurestruth.com

Diese bekannte US-Website listet Systemtests für diverse mechanische Handelssysteme in unterschiedlichsten Märkten auf.

Transaktionskosten: 25\$ für E-minis pro Roundturn (für das Zen Trading System werden 2 Punkte je Roundturn angesetzt, dies entspricht bei 10 CFD-Kontrakten zum aktuellen Wechselkurs ca. 26\$)

Tradingkapital: 3 x Margin (für das Zen Trading System werden hier 2.500€ als Margin für eine Positionsgröße von 10 CFDs angesetzt, d.h. Tradingkapital = 3 x 2.500 = 7.500€)

Zeitraum: seit Systemstart

Zum Stichtag 30.09.2008 hatten die analysierten Handelssysteme in der Top10-Liste des Rankings („Top 10 Systems Since Their Release Date“) jährliche Performanewerte zwischen 112% (Natural Gas Trader) und 203% (Dual Thrust).

Ergebnis des Vergleichs:

Das Zen Trading System v1.7 erzielte in der dokumentierten Systemlaufzeit vom 01.01.2000 bis zum Stichtag (30.09.2008) unter den o.g. Benchmarkbedingungen eine jährliche Performance von 323%.

Das System wäre also klar auf Platz 1 in den top10 von futurestruth vertreten.

3. www.striker.com

Diese US-Website verfolgt ebenfalls die Tradingleistungen von Handelssystemen in unterschiedlichsten Märkten.

Transaktionskosten: 20\$ - 30\$ für E-minis pro Roundturn (für das Zen Trading System werden 2 Punkte je Roundturn angesetzt, dies entspricht bei 10 CFD-Kontrakten zum aktuellen Wechselkurs ca. 26\$)

Tradingkapital: keine festen Vorgaben (für das Zen Trading System werden hier analog zum Ansatz bei futurestruth 2.500€ als Margin für eine Positionsgröße von 10 CFDs angesetzt, d.h. Tradingkapital = 3 x 2.500 = 7.500€)

Zeitraum: unterschiedlich

Zum Stichtag 31.12.2008 (Striker Report January 2009) gab es insgesamt sieben Handelssysteme im Ranking mit jährlichen Performannewerten von mehr als 100%:

Compass	456%
Impetus mini Russell	311%
Crescendo Mini Russell	219%
Brigade	192%
Delphi II mini Russell	173%
Charge ES	144%
Ultramini mini S&P	136%

Das Zen Trading System v1.7 erzielte in der dokumentierten Systemlaufzeit vom 01.01.2000 bis zum 31.12.2008 eine jährliche Performance von 322%.

Das System hätte somit in dieser Liste Platz 2 belegt!

Zusammenfassung

Das **Zen Trading System v1.7** für den Handel von Dax Index Tagesdaten ist ein sehr performantes und profitables mechanisches Handelssystem.

Der Vergleich mit anderen Systemen und Rankings zeigt, dass das System aktuell zu den weltbesten Systemen gehört.

Wenn man nun noch die auf den Websites der Anbieter erhältlichen Informationen bzgl. der Abonnement- oder Kaufkosten der Konkurrenzsysteme analysiert, lässt sich feststellen, dass das **Zen Trading System v1.7** im Vergleich zu diesen auch ein ausgezeichnetes Preis-/Leistungsverhältnis aufweist!