

Performancevergleich Zen Trading System v2.0

Haftungsausschluss

Das Softwareprodukt **Zen Trading System v2.0** 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.

Inhalt

Einführung.....	4
Rahmenbedingungen für die Vergleiche	5
www.futurestruth.com.....	6
www.striker.com	8
Zusammenfassung	10

Einführung

Das **Zen Trading System v2.0** ist eine professionelle Software für die Erzeugung von Handelssignalen für den deutschen Dax Index (Basis "end of day"-Daten bzw. Tagesdaten). Darüber hinaus ermöglicht die Software über einen implementierten komfortablen Systemtester den Test von unterschiedlichsten Datenkursreihen, Risk- und Moneymanagementmodellen bzgl. des implementierten Handelssystems.

Dieses Gutachten enthält Benchmarks, also Vergleiche der Systemtests und der Performance des **Zen Trading Systems v2.0** mit veröffentlichten Werten und Ranglisten diverser anderer Handelssysteme.

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.

www.futurestruth.com

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

Kalkulations- und Testbedingungen wie folgt:

Transaktionskosten:

25\$ für E-minis pro Roundturn (für das Zen Trading System wird 1 Punkt je Roundturn angesetzt, dies entspricht einer Positionsgröße von 18 CFD-Kontrakten zum aktuellen Wechselkurs von ca. 25\$)

Tradingkapital:

3 x Margin (für das Zen Trading System werden hier 5.000€ als Margin für eine Positionsgröße von 18 CFDs angesetzt, d.h. Tradingkapital = 3 x 5.000 = 15.000€)

Zeitraum:

seit Systemstart (Januar 2000)

Zum Stichtag **30.04.2010** hatten die analysierten Handelssysteme in der Top10-Liste des Rankings „Top 10 Systems Since Their Release Date“ (www.futurestruth.com) jährliche Performanzenwerte zwischen 104.9% (Trend Weaver) und 285.1% (TSL-CEL_NG_1.1).

Ergebnis des Vergleichs:

Das Zen Trading System v2.0 erzielte in der dokumentierten Systemlaufzeit vom 01.01.2000 bis zum 30.04.2010 unter den zuvor genannten Benchmarkbedingungen eine jährliche Performance von 269%.

The screenshot shows the 'Zen Trading System v2.0e - System test' dialog box. The 'Test data file' is 'C:\DaxIndex.txt'. The 'Data format' is 'Format 01: Ticker,Date,Open,High,Low,Close'. The 'no stop (loss)' option is selected. Transaction costs are 0.50, currency value is 1.00, and number of contracts is 18. The evaluation period is from 01/01/2000 to 04/30/2010. Trading capital is 15000. The summary table shows 2625 price bars, 679 winning trades (59.5%), and 463 losing trades (40.5%). Performance/year is +269%, Profitability is 1.61, and MAR Ratio is 1.74.

Number of price bars:	2625	Number of winning trades:	679 (59.5%)	Number of losing trades:	463 (40.5%)
Volatility:	2.09%	Profit/trade:	90.4987	Loss/trade:	-82.1792
Performance/year:	+269%	Profit (points):	23392.9000	Max.loss/trade:	-354.3000
Profitability:	1.61	Profit (currency):	421.072	Max.DD (currency):	-23.167
MAR Ratio:	1.74	Profit/year (currency):	40.423	Max.consecutive losses:	7

Das System wäre also auf Platz 2 in der top10-Liste von „futurestruth“ vertreten!

www.striker.com

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

Kalkulations- und Testbedingungen wie folgt:

Transaktionskosten:

20\$ bis 30\$ für E-minis pro Roundturn (für das Zen Trading System wird 1 Punkt je Roundturn angesetzt, dies entspricht einer Positionsgröße von 18 CFD-Kontrakten zum aktuellen Wechselkurs von ca. 25\$)

Tradingkapital:

3 x Margin (für das Zen Trading System werden hier 5.000€ als Margin für eine Positionsgröße von 18 CFDs angesetzt, d.h. Tradingkapital = 3 x 5.000 = 15.000€)

Zeitraum:

seit Systemstart (Januar 2000)

Zum Stichtag am **05.11.2010** hatten die analysierten Handelssysteme im Striker Report (www.striker.com) Ranking „Life – since inception“ in der Top10-Liste jährliche Performanzenwerte zwischen 125.67% (Lion II / ER) und 362.77% (Compass / SP).

Ergebnis des Vergleichs:

Das Zen Trading System v2.0 erzielte in der dokumentierten Systemlaufzeit vom 01.01.2000 bis zum 05.11.2010 unter den zuvor genannten Benchmarkbedingungen eine jährliche Performance von 272%.

Zen Trading System v2.0e - System test

Test data file: C:\DaxIndex.txt [Select]

Data format: Format 01: Ticker,Date,Open,High,Low,Close

no stop (loss) Transaction costs each half turn (e.g. points): 0.50
 absolute stop 50 Currency value each point or leverage (currency amount): 1.00
 relative stop (%) 1.0 Number of contracts (or shares): 18
 Vola stop (factor) 8 Evaluation period..... Date (MM/TT/YYYY) from: 01/01/2000
 Minimum stop (abs.) 0 Date (MM/TT/YYYY) to: 05/11/2010
 Maximum stop (abs.) 1000 Trading capital (currency amount): 15000

Trailing stop Pyramiding

Number of price bars:	2632	Number of winning trades:	680 (59.4%)	Number of losing trades:	464 (40.6%)
Volatility:	2.10%	Profit/trade:	90.8499	Loss/trade:	-82.0469
Performance/year:	+272%	Profit (points):	23708.1900	Max.loss/trade:	-354.3000
Profitability:	1.62	Profit (currency):	426.747	Max.DD (currency):	-23.167
MAR Ratio:	1.76	Profit/year (currency):	40.859	Max.consecutive losses:	7

System test completed!

Das System wäre somit auch bei „striker“ auf Platz 2 in der top10-Liste vertreten!

Zusammenfassung

Das **Zen Trading System v2.0** für den Handel von Dax Index Tagesdaten ist ein sehr performantes und profitables mechanisches Handelssystem.

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