

NT7 Features & Stand der Entwicklung

Stand der Entwicklung

June 22, 2009: Ende September wird eine Vorab-Version an NinjaScript Entwickler ausgegeben, im Anschluss wird der NinjaTrader7 noch auf Bugs überprüft und einer Performanceoptimierung unterzogen. Zum jetzigen Zeitpunkt (Mitte Juni 2009) ist der NinjaTrader7 zu 95% fertiggestellt

Regards, Raymond Deux President & CEO

NT7 Features

NinjaTrader 7 ist das bisher ambitionierteste Projekt, das wir bisher in Angriff genommen haben. Insgesamt wird es über 300 Änderungen und Verbesserungen zu der vorherigen Version geben. Dieser Artikel stellt einige der interessantesten neuen Features vor.

Allgemeine Verbesserungen

Allgemeine Performance des Programms *Hier haben wir sehr viel Zeit während der Entwicklung investiert. Wir konnten die Effizienz des NinjaTrader7 stark verbessern – unter anderem dadurch, dass Core-Sections der Programmierung umgeschrieben wurden. Die CPU – Auslastung als auch der verwendete Arbeitsspeicher werden nun noch viel effizienter genutzt.*

Hier einige Vergleiche zwischen der 6.5 Version und dem neuen Programm:

Fall 1

Viele auf Ticks basierende Charts (tick, volume and seconds) bei hochvolumigen Märkten hatten eine relative lange Ladezeit beim Neustart des Programms.

NinjaTrader6.5: Absturz des Programms nach fünf Minuten mit einer Fehlermeldung – Out of Memory bei einer Verwendung von 1.2GB Arbeitsspeicher

Version7: Charts sind nach 75 Sekunden geladen bei einer maximalen Arbeitsspeicherausnutzung von nicht mehr als 100MB.

Fall 2 Backtesting einer Multi-Series Strategie mit Einbeziehung von mehreren Märkten

Version 6.5 – Maximale RAM Nutzung von 1.3 GB – mögliche Abstürze mit einer out of memory Fehlermeldung nach etwa 6 Minuten

Version7 – Maximaler RAM Bedarf liegt nun bei 430 MB – Berechnungen dauern nun etwa 80

Sekunden.

Fall 3 Backtesting von unserer SampleMACrossOver Strategie auf einem 50 tick ES Chart, mit Verwendung von drei Monaten an historischen Daten.

Version 6.5 - Maximaler RAM Bedarf von 1.2 GB, 550 MB blieb davon nach Abschluss im Speicher – Dauer: 4 minutes

Version 7 - Max RAM Verwendung geht nun nicht mehr über 110 MB hinaus und der Backtest ist nun auch in circa 40 Sekunden beendet.

Fall 4 Backtesting von unserer SampleMACrossOver Strategie auf einem 50 tick ES Chart mit einem Jahr an historischen Daten

Version 6.5 – Abbruch mit “out of memory exception”

Version 7 – Maximaler RAM Bedarf von 140 MB – Backtest ist nun nach weniger als 3 Minuten beendet.

These performance tests were performed on a standard Dell Inspiron laptop.

64-bit NinjaTrader

NinjaTrader7 wird 64-Bit Betriebssysteme als auch Multi-Core Prozessoren nun unterstützen.

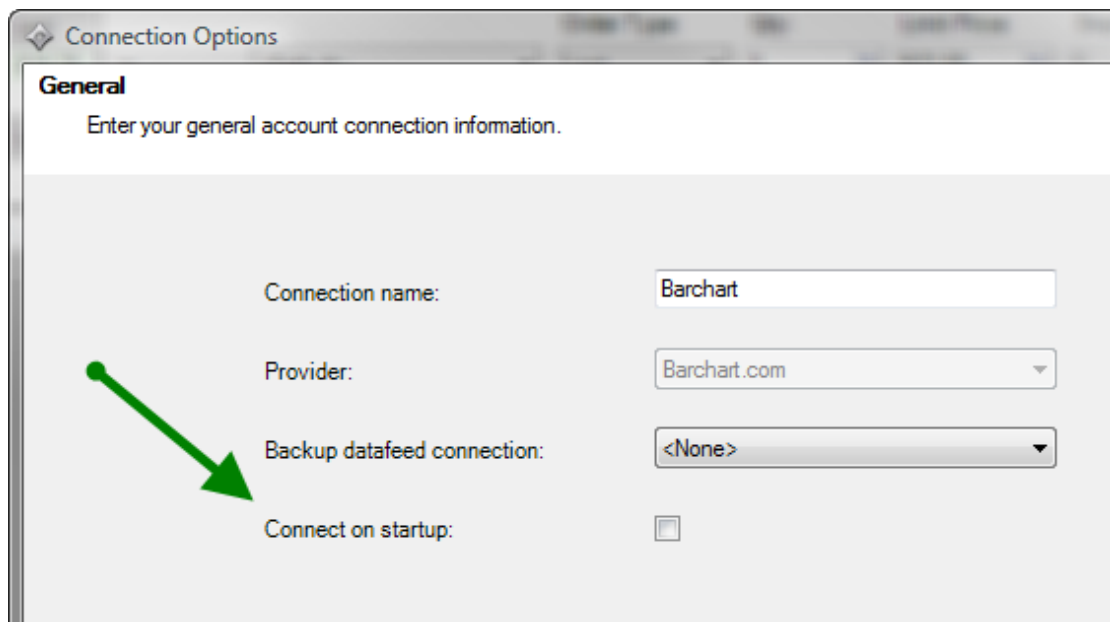
Neuer Google Adapter

User können gratis historische und and verzögerte Stream Daten nun von www.google.com beziehen.

Neuer RSS Feed Support

New Hot Key Manager Nun können auch Hotkeys verschiedenen Funktionen inklusive dem Order Management zugewiesen werden.

Neuer Automatic Connect on Application Start Up Beim Start des Programms verbindet der NinjaTrader Sie nun automatisch mit Ihrem Datenanbieter.



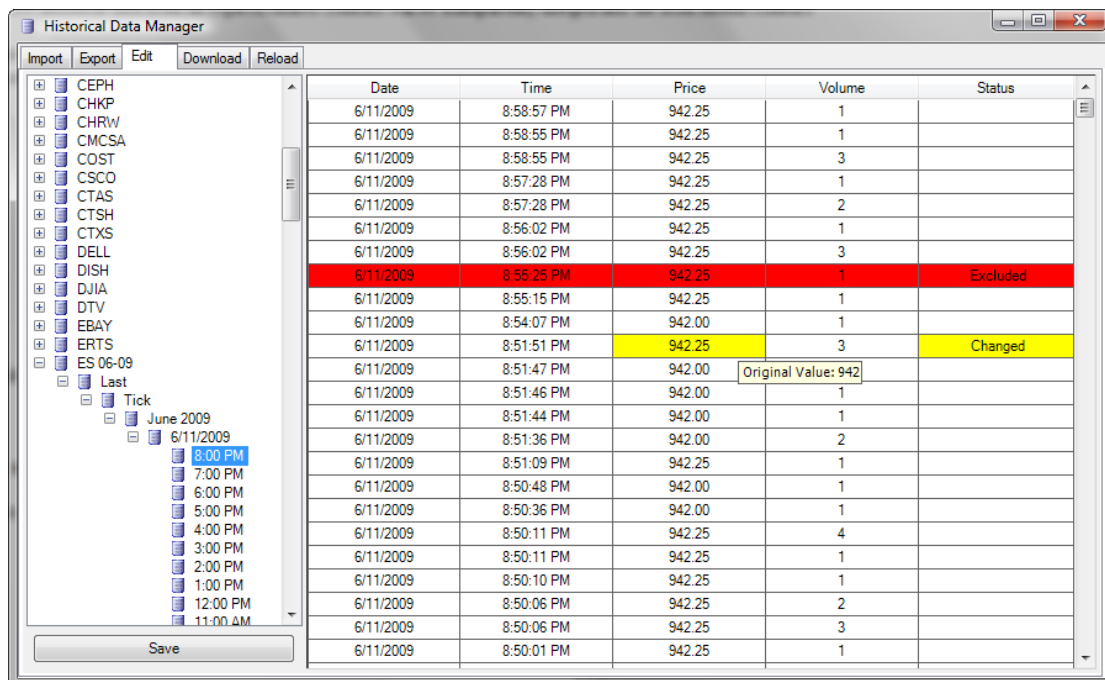
The screenshot shows the 'Connection Options' dialog box with the 'General' tab selected. The dialog contains the following fields and options:

- Connection name:** Barchart
- Provider:** Barchart.com
- Backup datafeed connection:** <None>
- Connect on startup:**

A green arrow points to the 'Connect on startup' checkbox, indicating that this option should be checked to enable automatic connection at application startup.

Daten Management - Verbesserungen

Neuer Historical Data Manager Dieses Tool erlaubt es dem Nutzer, historische Daten zu importieren als auch zu exportieren.



The screenshot shows the 'Historical Data Manager' application window. The interface includes a menu bar with 'Import', 'Export', 'Edit', 'Download', and 'Reload'. On the left, a tree view displays a list of stock symbols (CEPH, CHKP, CHRW, CMCSA, COST, CSCO, CTAS, CTSH, CTXS, DELL, DISH, DJIA, DTV, EBAY, ERTS, ES 06-09) and a detailed view of the 'Last' tick for 'June 2009' on '6/11/2009' at '8:00 PM'. The main area is a table with columns for Date, Time, Price, Volume, and Status. The table contains 20 rows of data for the date 6/11/2009. One row is highlighted in red with the status 'Excluded', and another is highlighted in yellow with the status 'Changed'. A tooltip for the 'Original Value: 942' is visible over the Price column of the 'Changed' row. A 'Save' button is located at the bottom left of the window.

Date	Time	Price	Volume	Status
6/11/2009	8:58:57 PM	942.25	1	
6/11/2009	8:58:55 PM	942.25	1	
6/11/2009	8:58:55 PM	942.25	3	
6/11/2009	8:57:28 PM	942.25	1	
6/11/2009	8:57:28 PM	942.25	2	
6/11/2009	8:56:02 PM	942.25	1	
6/11/2009	8:56:02 PM	942.25	3	
6/11/2009	8:55:25 PM	942.25	1	Excluded
6/11/2009	8:55:15 PM	942.25	1	
6/11/2009	8:54:07 PM	942.00	1	
6/11/2009	8:51:51 PM	942.25	3	Changed
6/11/2009	8:51:47 PM	942.00		Original Value: 942
6/11/2009	8:51:46 PM	942.00	1	
6/11/2009	8:51:44 PM	942.00	1	
6/11/2009	8:51:36 PM	942.00	2	
6/11/2009	8:51:09 PM	942.25	1	
6/11/2009	8:50:48 PM	942.00	1	
6/11/2009	8:50:36 PM	942.00	1	
6/11/2009	8:50:11 PM	942.25	4	
6/11/2009	8:50:11 PM	942.25	1	
6/11/2009	8:50:10 PM	942.25	1	
6/11/2009	8:50:06 PM	942.25	2	
6/11/2009	8:50:06 PM	942.25	3	
6/11/2009	8:50:01 PM	942.25	1	

New Continuous/Merged Futures Contracts

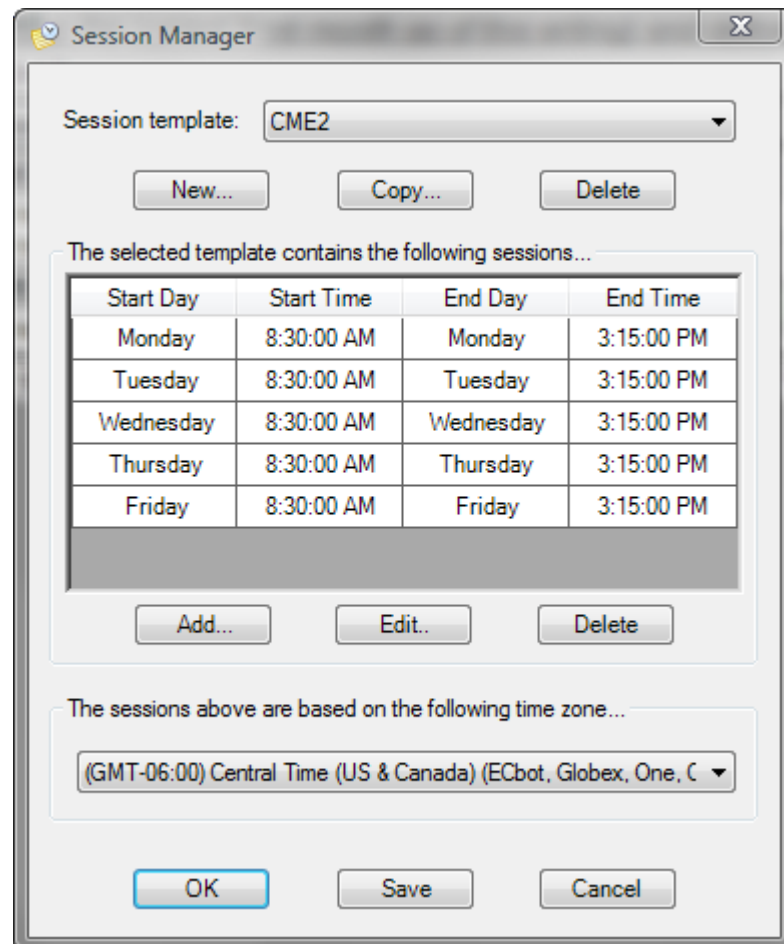
Nun stehen auch continuous Kontrakte zur Verfügung.

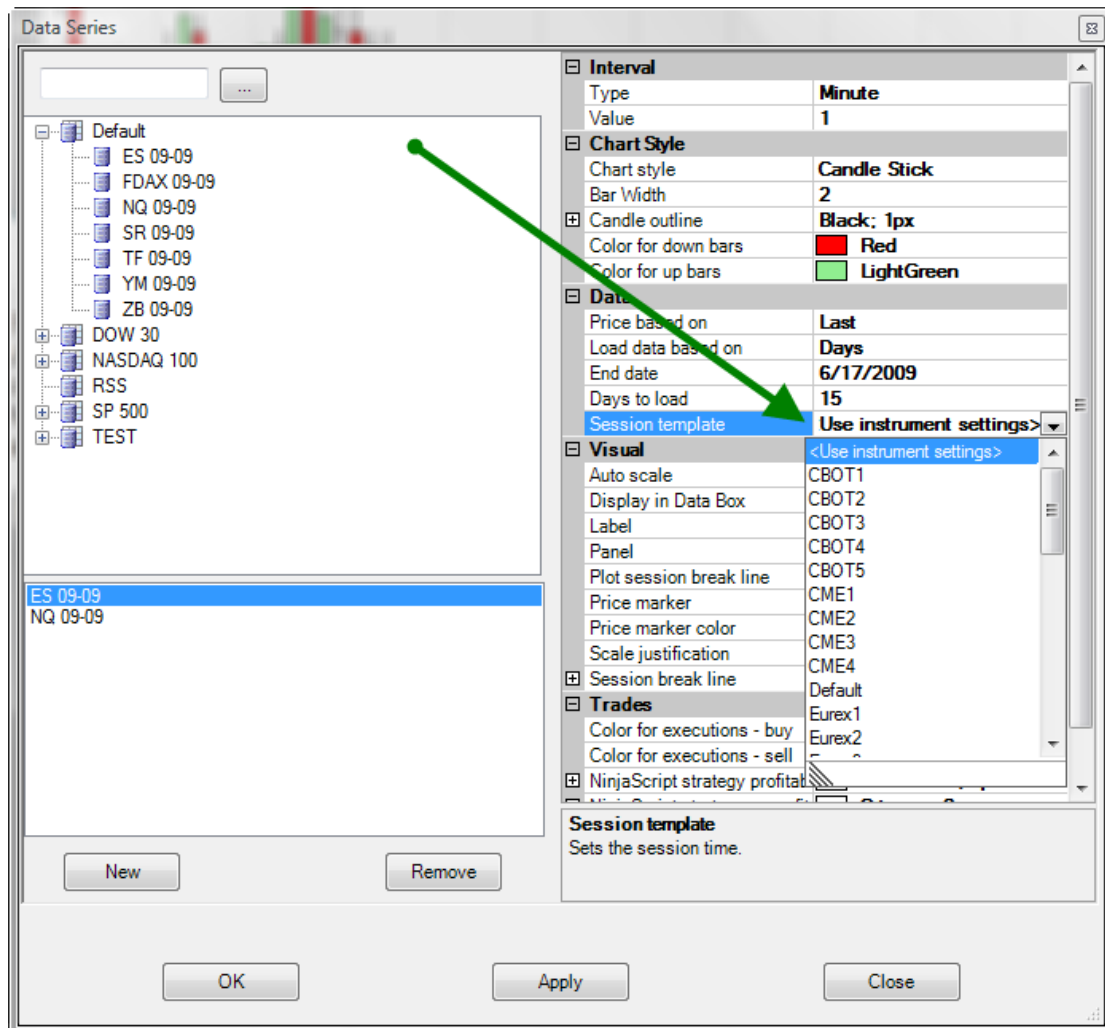
The screenshot shows the 'Instrument Editor' dialog box with the 'Definition' tab selected. The 'Misc' sub-tab is active. The 'Master instrument' is set to 'ES'. The 'Instrument type' is 'Future'. The 'Exchanges' list includes Ace, Aeb, Aex, Amex, Arca, Asx, Belfox, Bm, Box, BrokerTec, Brut, Bse, BTrade, Bvme, Caes, and Cboe. The 'Tick size' is 0.25, 'Currency' is UsDollar, 'Point value' is 50, and 'Rollover period' is 3. The 'Sim feed start price' is 905.50 and 'Margin value' is 0. The 'Merge policy' dropdown is open, showing options: UseGlobalSettings, DoNotMerge, MergeBackAdjusted, MergeNonBackAdjuste, and UseGlobalSettings. The 'Session template' is CME2. The 'URL' field contains http://www.cme.com/trading/prd/contract_spec_ES702.html and a 'Visit' button is next to it. 'OK' and 'Cancel' buttons are at the bottom.

Field	Value
Master instrument	ES
Instrument type	Future
Tick size	0.25
Currency	UsDollar
Point value	50
Rollover period	3
Sim feed start price	905.50
Margin value	0
Merge policy	UseGlobalSettings
Session template	CME2
URL	http://www.cme.com/trading/prd/contract_spec_ES702.html

Neuer Session Manager

Templates können nun auf die diversen Sessions vordefiniert werden.





Market Replay Verbesserungen

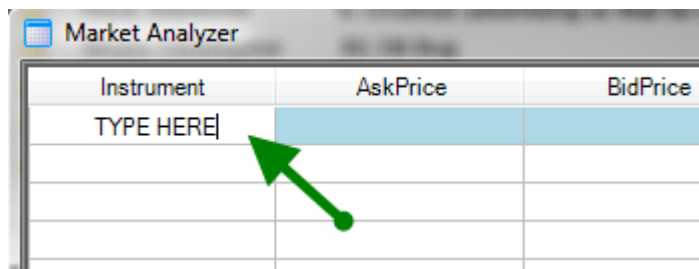
Downloadbare Replay Daten

Wir planen, Market Replays auf unsere Server für rund 40 Märkte zu speichern und diese dann den Usern per Download zur Verfügung zu stellen.

Market Analyzer Verbesserungen

Performance Verbesserungen- *Das Laden von historischen Daten wurde hier stark optimiert. So wird eine stark verbesserte Performance erreicht.*

Des Weiteren werden viele neue Funktionen verfügbar sein.



Instrument	AskPrice	BidPrice
TYPE HERE		

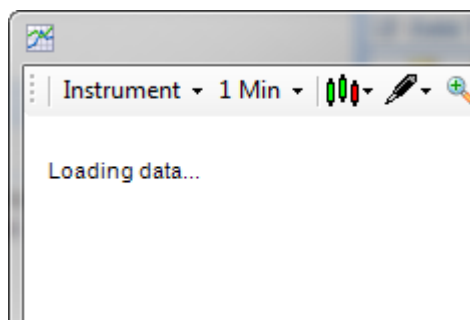
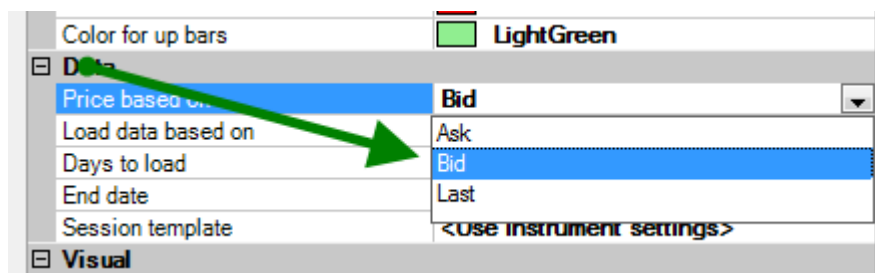
Instrument	AskPrice	BidPrice	LastPrice	CCI(14)
Stocks				
AAPL	137.33	137.31	137.31	-30.95
ADBE	28.29	28.27	28.27	-95.56
CSCO	19.01	19.00	19.01	-70.71
DELL	12.67	12.66	12.66	-11.31
EBAY	16.97	16.96	16.97	62.6
GOOG	414.90	414.76	414.77	-14.45
JNPR	22.30	22.29	22.30	61.4
MSFT	23.34	23.33	23.33	Oversold
SYMC	15.72	15.71	15.71	59.87
YHOO	15.31	15.30	15.30	Oversold
Futures				
ES 09-09	912.75	912.50	912.50	-66.82
NQ 09-09	1450.50	1450.00	1450.00	-61.04
TF 09-09	504.9	504.8	504.9	-98.73
YM 09-09	8501	8500	8500	-77.58
ZB 09-09	114'200	114'195	114'195	Oversold

Charting Enhancements

Neue Chart Styles

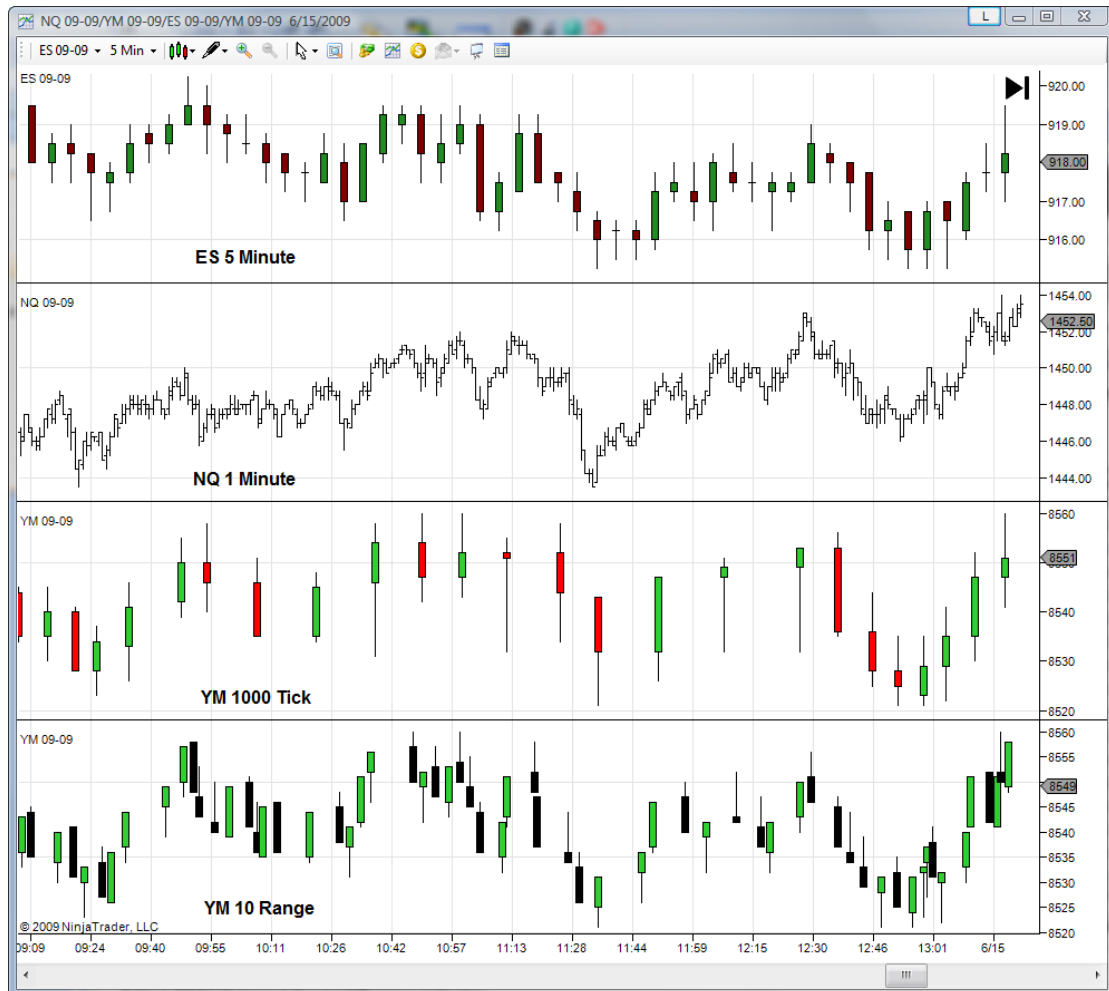
Renko, Point and Figure und Kagi werden neu verfügbar werden

New Ask/Bid Charts Charts können nun auch so konfiguriert werden, dass anstatt des Last Preis nun der momentane Ask oder Bid angezeigt wird.



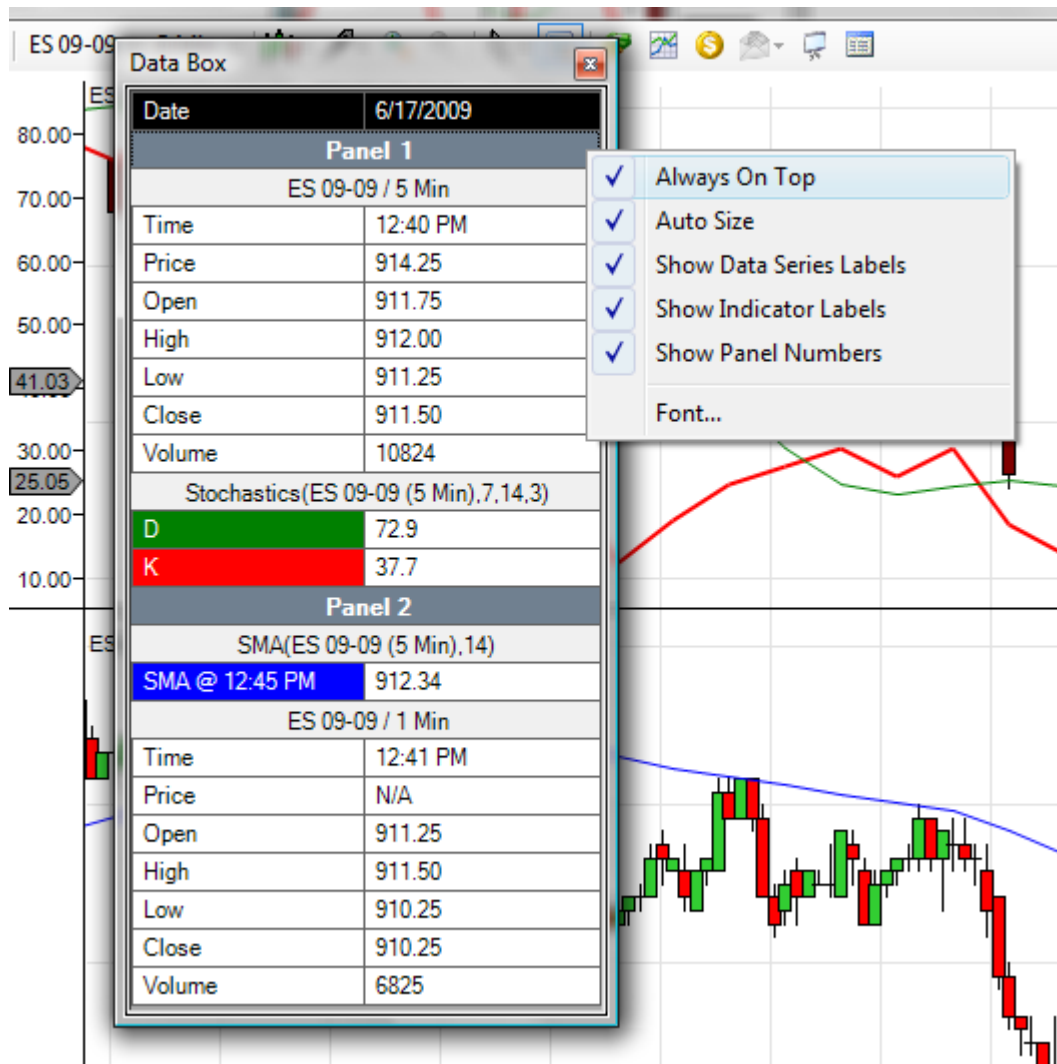
Neues Multi-Series Charting

Verschiedene Charts von unterschiedlichen Instrumenten können nun auf einen Chart gelegt werden.



Indicators on Indicators

Diese Funktion wird nun auch verfügbar sein.



Enhanced Scale Properties

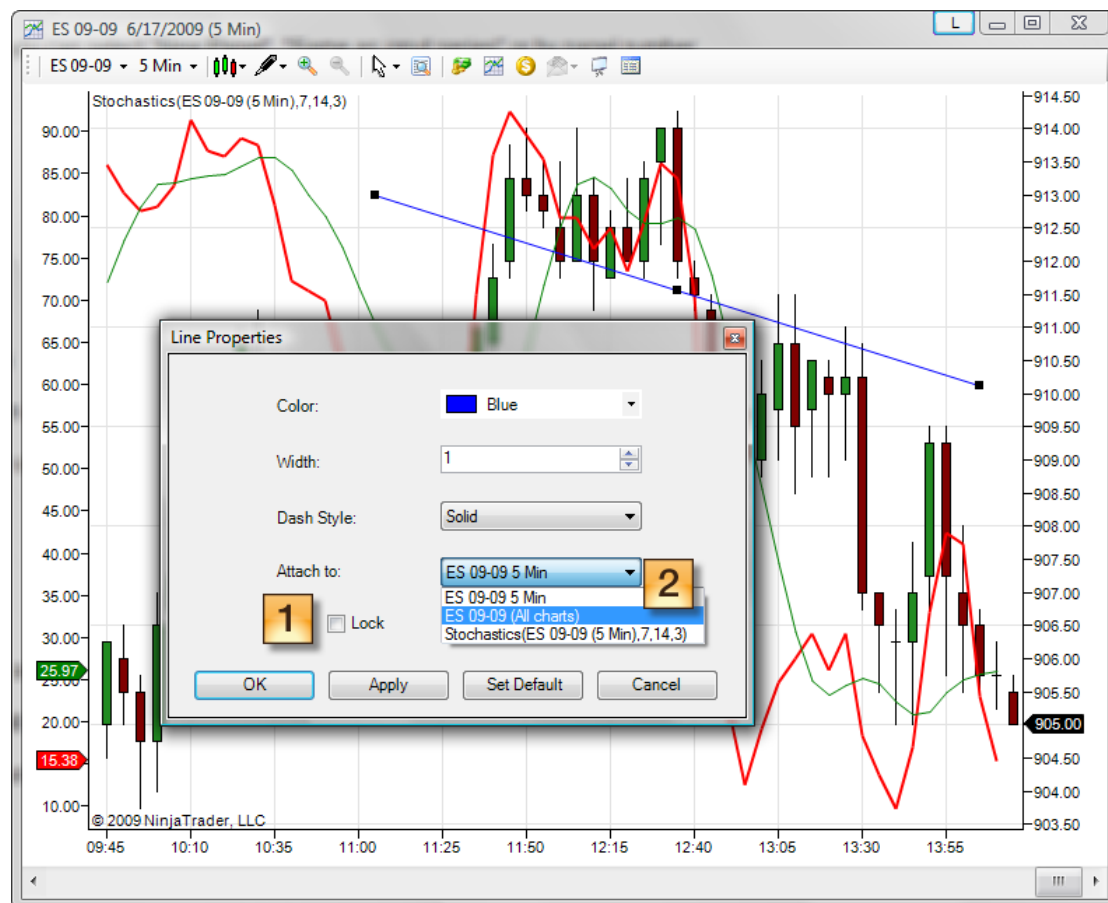
Lineare als auch logarithmische Charts sind nun verfügbar.

Flexibles Chart Panel Management



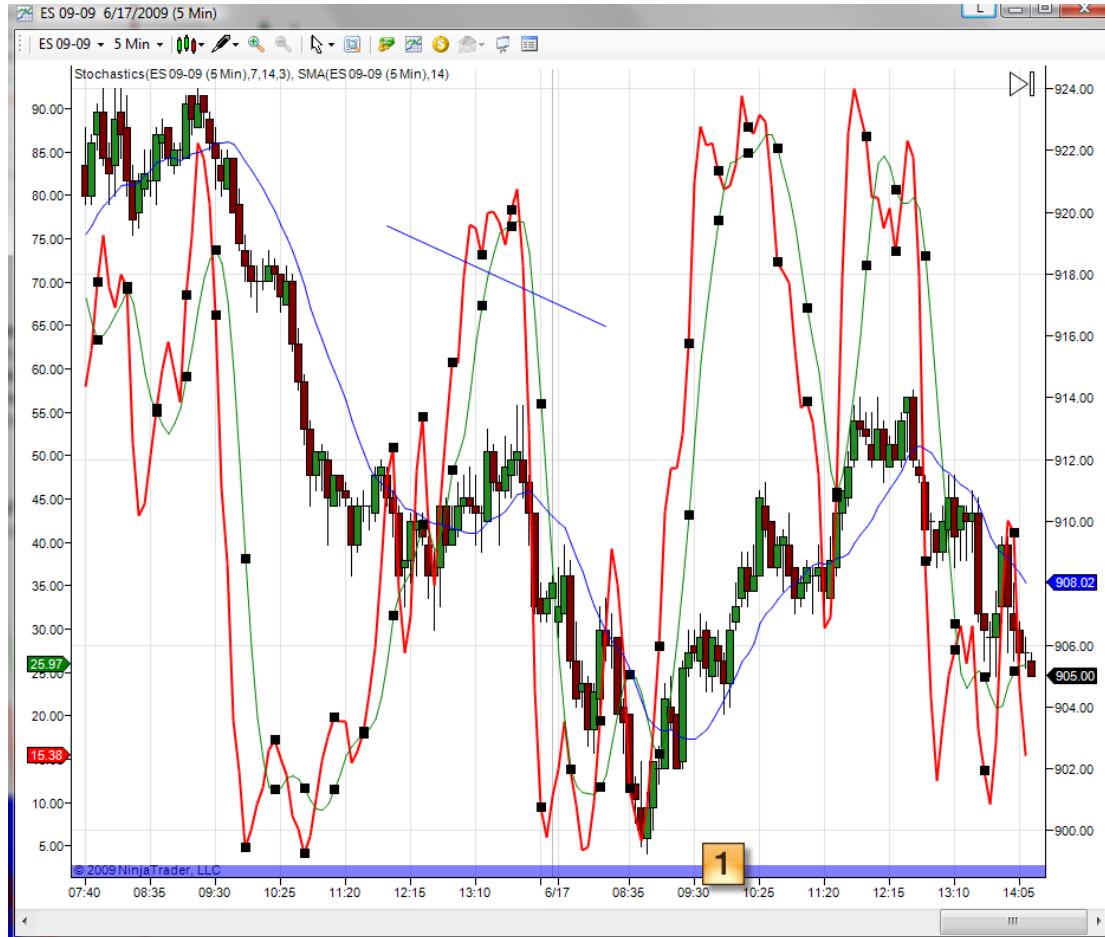
Enhanced Drawing Tools

Viele verbesserte Zeichen Tools werden nun unterstützt.



Drag & Drop of Chart Objects

Drag&Drop wird nun unterstützt.



Verbessertes Global Cross Hair

Chart Trader

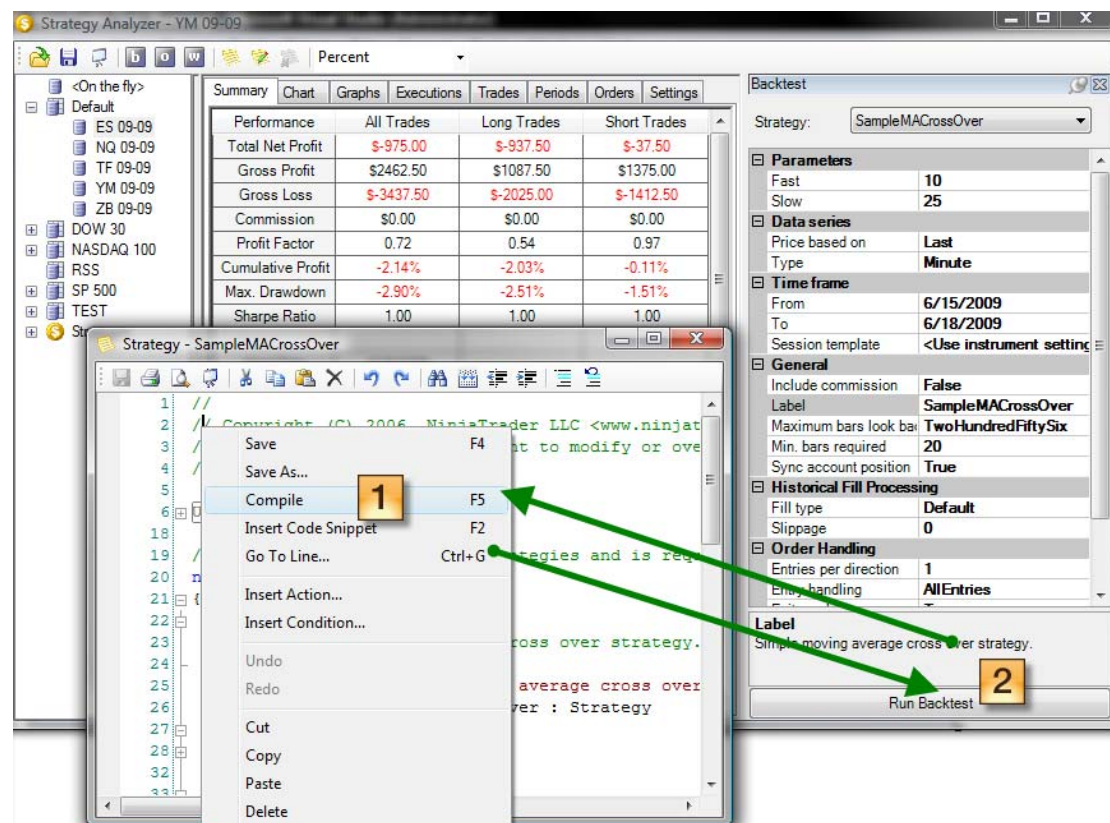
Die angezeigten Orders im Chart haben nun eine Auto-Scale Funktion. Somit wird die Übersichtlichkeit verbessert.

Strategy Analyzer Enhancements

Performance Enhancements

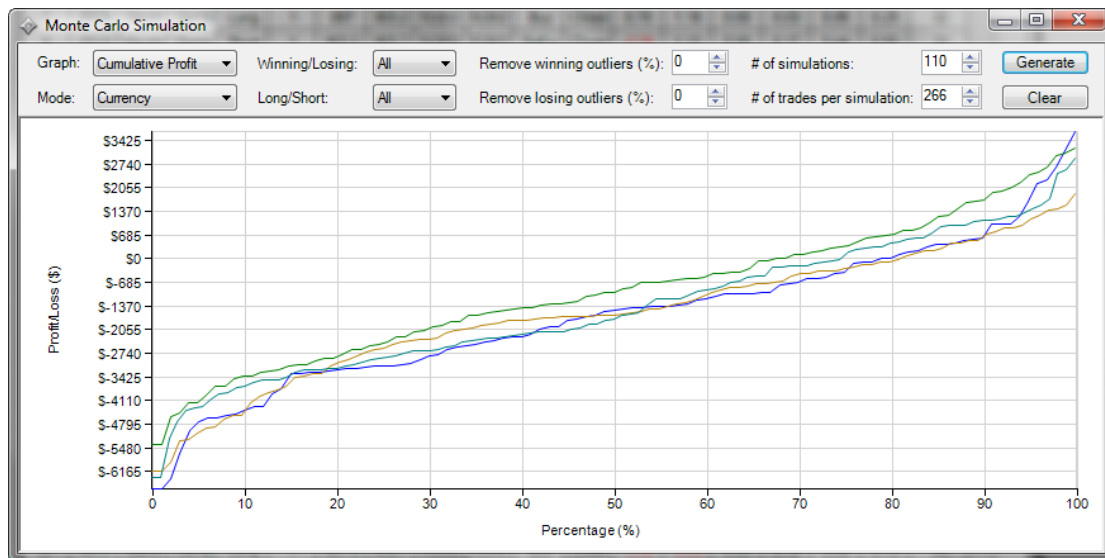
Walk-Forwards als auch Optimierungen unterstützen nun Multi-Core Prozessoren.

Improved Strategy Development/Backtesting



New Monte Carlo Analysis

Monte Carlo Analysen sind nun verfügbar



Combined Results

Das Backtesting von Baskets wird verfügbar sein

SampleMACrossOver - COMBINED RESULTS - Strategy Analyzer

Percent

Instruments

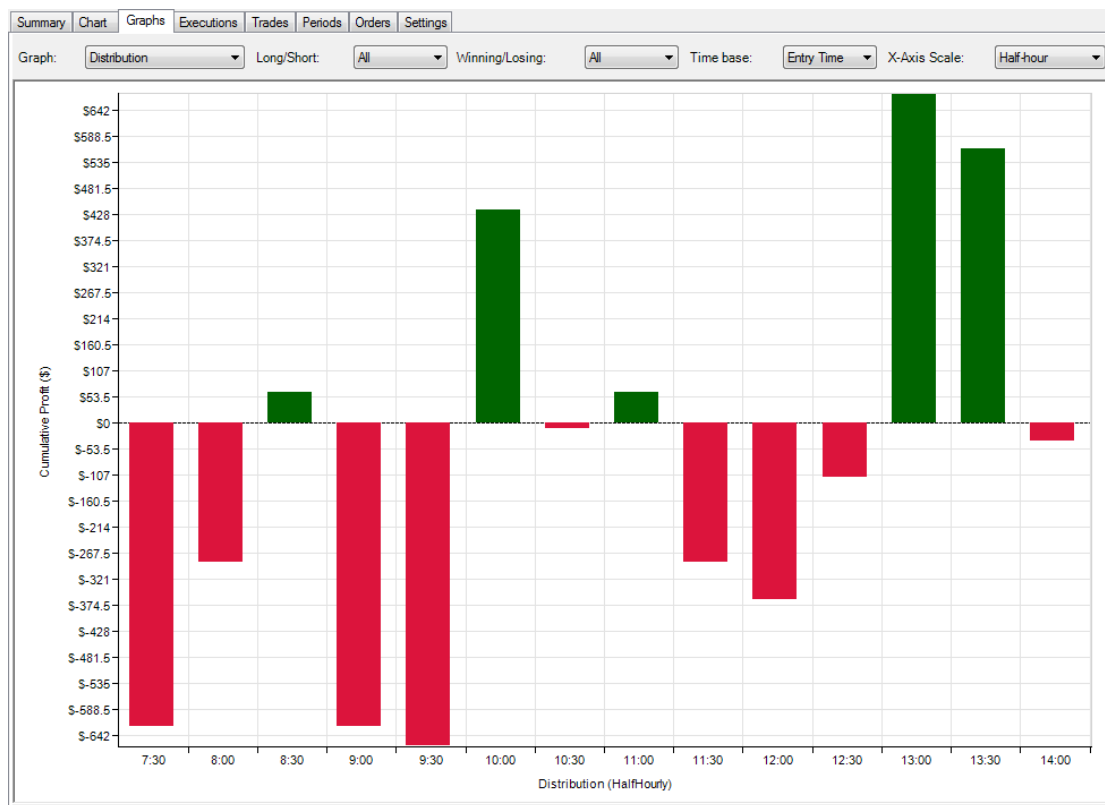
Instrument	Performan	Total Net	Gross Pro	Gross Los	Profit Fact	Cumulativ	Max. Dra	Total # of	Percent Profi
ES 09-09	0.89	(\$1,212.5	\$9,937.5	(\$11,150.	0.89	-2.56 %	-5.34 %	266	39.85 %
NQ 09-09	0.89	(\$855.00)	\$6,890.0	(\$7,745.0	0.89	-2.88 %	-5.08 %	280	40.71 %
TF 09-09	1.14	\$1,500.0	\$12,450.	(\$10,950.	1.14	2.62 %	-6.28 %	225	40.00 %
YM 09-09	1.01	\$65.00	\$9,410.0	(\$9,345.0	1.01	0.11 %	-3.17 %	278	40.29 %
ZB 09-09	1.13	\$1,656.2	\$14,359.	(\$12,703.	1.13	1.44 %	-2.21 %	196	43.37 %
COMBINED RESULT	1	\$1,153.7	\$53,046.	(\$51,893.	1.00	-0.47 %	-4.47 %	1245	40.72 %

Summary Settings

Performance	All Trades	Long Trades	Short Trades
Total Net Profit	\$1153.75	\$-41.25	\$1195.00
Gross Profit	\$53046.88	\$26961.88	\$26085.00
Gross Loss	\$-51893.13	\$-27003.13	\$-24890.00
Commission	\$0.00	\$0.00	\$0.00
Profit Factor	1.00	0.99	1.01
Cumulative Profit	-0.47%	-0.24%	-0.23%
Max. Drawdown	-4.47%	-3.33%	-2.83%
Sharpe Ratio	1.00	1.00	1.00
Start Date	6/1/2009		
End Date	6/16/2009		

Strategy Wizard Verbesserungen

New Compile Button Nun kann immer compiled werden. Im Gegensatz zur 6.5 Version, dort war dies nur am Ende des Wizards möglich.



Allgemeine NinjaScript Verbesserungen

**Verbessertes 3rd Party Vendor License
Management**

New OnFundamentalData() Method

Historical Data Import

**Changed Volume from type "int" to type
"long"**

Connectivity Adapter Verbesserungen



Zen-Fire Adapter -

Verwendung der neuesten API

*Der Durchschnittspreis wird nun von der API
berechnet*

Verbesserte Reconnect Logik