

Паспорт курсовой работы

по дисциплине «Автоматизированные системы обработки данных финансовых рынков», 1
семестр

1. Методика оценки.

Задание: Реализовать средствами MQL4 автоматизированную торговую систему, реализующую торговую стратегию в соответствии с темой работы.

Структура:

- Описание торговой стратегии.
- Перечень индикаторов, используемых в алгоритме.
- Подробное описание алгоритма, реализованного в советнике.
- Результаты оптимизации советника.
- Оценка эффективности советника на исторических данных.

Этапы выполнения и защиты:

- Ознакомиться с описанием торговой стратегии.
- Определить все индикаторы, необходимые для реализации стратегии.
- Реализовать алгоритм стратегии на языке MQL4.
- Провести оптимизацию параметров советника на исторических данных.
- Оценить эффективность работы советника с использованием различных коэффициентов (Шарпа, Сортино и др.)

Оцениваемые позиции:

- Соответствие полученной ТС описанию стратегии.
- Качество проведенной оптимизации параметров.
- Правильность оценки эффективности.

2. Критерии оценки.

- работа считается **не выполненной**, если отсутствует рабочий вариант советника, оценка составляет 0 баллов.
- работа считается выполненной **на пороговом** уровне, если имеется работающий советник с незначительными отклонениями от исходной стратегии, оценка составляет 10 баллов.
- работа считается выполненной **на базовом** уровне, если работа советника полностью соответствует исходной стратегии, проведена оптимизация параметров и оценка эффективности, оценка составляет 25 баллов.
- работа считается выполненной **на продвинутом** уровне, если студентом в работу советника внесены дополнительные улучшения, повышающие его эффективность, оценка составляет 30 баллов.

3. Шкала оценки.

В общей оценке по дисциплине баллы за работы учитываются в соответствии с правилами балльно-рейтинговой системы, приведенными в рабочей программе дисциплины. Оценка за курсовую работу получается путем деления полученных баллов на 0,3 и округления до целых вверх.

4. Примерный перечень тем курсового проекта (работы).

Реализация стратегии «Слон и моська»
Реализация стратегии «Ключ»
Реализация стратегии «Поглощение с подтверждением»
Реализация стратегии «Линии прошлого дня»
Реализация стратегии «Двухфрактальная свеча»
Реализация стратегии «Гуппи»
Реализация стратегии «3 бара»
Реализация стратегии «МА-веер + паттерны»
Реализация стратегии «Опорные свечи»
Реализация стратегии «Зебра»
Реализация стратегии «Радуга»
Реализация стратегии «Аллигатор и фрактал»
Реализация стратегии «Пробойный фрактал»
Реализация стратегии «SMA108»
Реализация стратегии EBB-1
Реализация стратегии EBB-2
Реализация стратегии «Окно МА»
Реализация стратегии «Метод площадей + паттерны»
Реализация стратегии «Линии баланса»
Реализация стратегии «Три экрана Элдера»

5. Перечень вопросов к защите курсового проекта (работы).

- Трендовые индикаторы.
- Фигуры РА.
- Линии поддержки и сопротивления.
- Каналы и тренды.
- Осцилляторы.
- Линии Фибоначи.
- Полосы Боллинджера.
- Тестирование и оптимизация советника.
- Основы риск-менеджмента.
- Структура типового советника.