**ТЕХНИЧЕСКОЕ ЗАДАНИЕ**

**на разработку механической торговой системы**

| **Позиция** | **Описание** |
| --- | --- |
| Общие требования | Способ исполнения, комплектация, документация и прочее |
| Выполнить описанную ниже механическую торговую систему (далее Стратегию) на языке C#. Конечный файл должен быть в виде подключаемого модуля (динамической библиотеки dll) к программе FalconTrade с описанием возможностей модуля в виде справочной информации в формате PDF. Приложить исходный код |
| Торговая платформа | Название торговой платформы (FalconTrade или Acceleration LUA) |
| FalconTrade |
| Полное название | Название торговой стратегии полностью |
| Пересечение двух скользящих средних |
| Краткое название | Название торговой стратегии в сокращенном виде |
| Cross2MA |
| Описание | Общее описание работы стратегии |
| Торговля по сигналам пересечения двух скользящих средних Moving Average с разными периодами. Периоды и способ сглаживания задаются в настройках индикаторов QUIK.  Покупать, когда скользящая средняя с меньшим периодом пересекает скользящую среднюю снизу вверх, продавать – пересекает сверху вниз |
| Инструменты | Общие сведения об используемых инструментах |
| Акции на МосБирже и СПБ, фьючерсы на МосБирже |
| Источник данных | Общие сведения об используемых индикаторах, источниках данных |
| Графики и таблицы QUIK:   1. Временной интервал баров от 1 минуты до 1 дня; 2. Два индикатора Moving Average. Параметры индикаторов задаются в QUIK |
| Торговые данные | Информация о состоянии стратегии, выводимая на экран монитор |
| Значения индикаторов на последней свече |
| Параметры | Значения и правила, используемые для настройки стратегии |
| 1. Отступ для открытия позиции в пунктах OpenOffset; 2. Отступ для закрытия позиции в пунктах CloseOffset; 3. Выбор свечей для условий – возможность сравнивать значения индикаторов на последних двух свечах, на двух свечах перед последней и т.д. до трех периодов. |
| Лонг | Правила (условия) открытия длинной позиции |
| Скользящая средняя с меньшим периодом пересекает скользящую среднюю с большим периодом снизу вверх  MAfast[1] > Maslow [1] и Mafast[2] < Maslow [2] и Price >= MAfast[1] + OpenOffset,  где  MAfast – скользящая средняя с меньшим периодом  MAslow – скользящая средняя с большим периодом  [1], [2] – индексы свечей: 1-вторая справа, 2-третья справа (значения индикаторов на первой свече справа не учитывать).  Цена заявки: Рыночная |
| Закрыть Лонг | Правила (условия) закрытия длинной позиции |
| Скользящая средняя с меньшим периодом меньше скользящей средней с большим периодом  MAfast[1] < MAslow [1] и Price <= MAfast[1] - CloseOffset  Цена заявки: Рыночная |
| Шорт | Правила (условия) открытия короткой позиции, если она предусмотрена |
| Скользящая средняя с меньшим периодом пересекает скользящую среднюю сверху вниз  MAfast[1] > MAslow [1] и MAfast[2] < MAslow [2] и Price <= MAfast[1] - OpenOffset  Цена заявки: Рыночная |
| Закрыть Шорт | Правила (условия) закрытия короткой позиции |
| Скользящая средняя с меньшим периодом больше скользящей средней с большим периодом  MAfast[1] > MAslow[1] и Price >= MAfast[1] + CloseOffset  Цена заявки: Рыночная |
| Графическое представление работы стратегии | Рисунок(и) с изображенными на нем графиком цены и используемыми индикаторами, а также сделками с указанием их направления |
|  |
| Стоп-заявки | Описание работы стоп-заявок |
| Стоп-заявки типа тейк-профит и стоп-лимит с алгоритмом скользящего стоп-лосс. Параметры стоп-заявок должны соответствовать параметрам в QUIK |
| Дополнительные параметры | Прочие параметры и требования стратегии |
| 1. Закрывать позицию в конце торгового дня рыночной заявкой |