

о положить под елку Афродите
что — ведьме?

Показываем тут

пikabu

Горячее Лучшее Свежее Подписки Сообщества

empenoso 2 месяца назад Лига биржевой торговли

Как я решил вернуться в алготрейдинг после 10 летнего перерыва

Самое главное, что никакого отношения к слову **алко** это не имеет.

В течении нескольких лет я торговал в связке программы технического анализа AmiBroker + торговый терминал QUIK через .tri и .trr файлы в основном на фьючерсах на срочном рынке. Не могу сказать что это было неудачным опытом, но со временем я узнал про распределение активов (Asset allocation) и понял что очень сложно соревноваться с бенчмарком в виде фондового индекса.

МТС

Московская Гигабитная Сеть

www.kbpa.ru

Форумы | Кабинет | Поиск | Выход | Онлайн | FAQ | Форумчик | Календарь | Чат | Квиты

Дорогие наши прекрасные женщины, мы вас ОЧЕНЬ любим!

Трейдинг >> Системы

Как отличить работающую МТС от подогнанной под кривую

Решил формализовать признаки, по которым работающая система отличается от подогнанной под кривую. Выделил 8 таких признаков и размещаю их в порядке убывания тяжести (от самых опасных к наименее опасным).

1. Первый признак. Система должна содержать в себе здравую идею, а не быть просто бессмысленной комбинацией индикаторов.

Рассмотрим пример конкретной системы:

Enter Long

LinRegSlope(C, opt1) > 0

AND

Cross(RSquared(C, opt2), opt3)

Enter Short

LinRegSlope(C, opt1) < 0

AND

Cross(RSquared(C, opt2), opt3)

Opt1 = 24 - 120 с шагом 12

Opt2 = 24 - 240 с шагом 12

Opt3 = 0.5 - 0.9 с шагом 0.1

Использовать на часовых графиках.

В данном случае используются 2 индикатора - линейной регрессии и R-квадрат. Вот и разберемся с ними подробнее.

Форум форекс кб паук <http://forex.kbpauk.ru/> (в 2024 уже не работает)

В теории это означает что можно купить индекс и забыть об этом, заниматься своими делами, бизнесом, семьей - а индекс растёт (ну или падает, смотря какое время) и для этого не нужно прикладывать никаких действий.

А за связкой AmiBroker + QUIK постоянно нужно было присматривать, следить не отвалился ли адаптер импорта через .tri файл. А ещё иметь несколько виртуальных машин с установленными копиями Windows на каждой виртуалке на одном физическом компьютере для разных брокеров. Возможна была установка только одной пары AmiBroker + QUIK на одну винду. Всё это мне не особо нравилось.

В 2024 году захотелось что-то лёгкое - без Windows и современное - через API интерфейс. Желательно бесплатное для пользователя. Несколько лет назад я уже пытался узнать появились ли у российских брокеров API для работы с ними, но так и не собрался. Этой осенью я стал активно искать информацию - какой брокер имеет АПИ для работы с физлицами. Не смог найти никакой сводной таблицы и нашёл только три варианта:

- ФИНАМ
- Алор

Используйте аккаунт Яндекса для входа на сервис

Безопасный вход без дополнительной регистрации на сайте

Войти с Яндекс ID

Логин

Пароль

Войти

Создать аккаунт

Забыли пароль?

или продолжите с

Войти с Яндекс ID

Войти через VK ID

Промокоды

Работа

Курсы

Реклама

Игры

Пополнение Steam

О сообществе сообщества

Лига биржевой торг...

3 207 постов • 8 17 ...

Подписаться

Сообщество посвящено обсуждению биржевой торговли.

Правила сообщества

Управление сообществом

A.Stoun Администратор

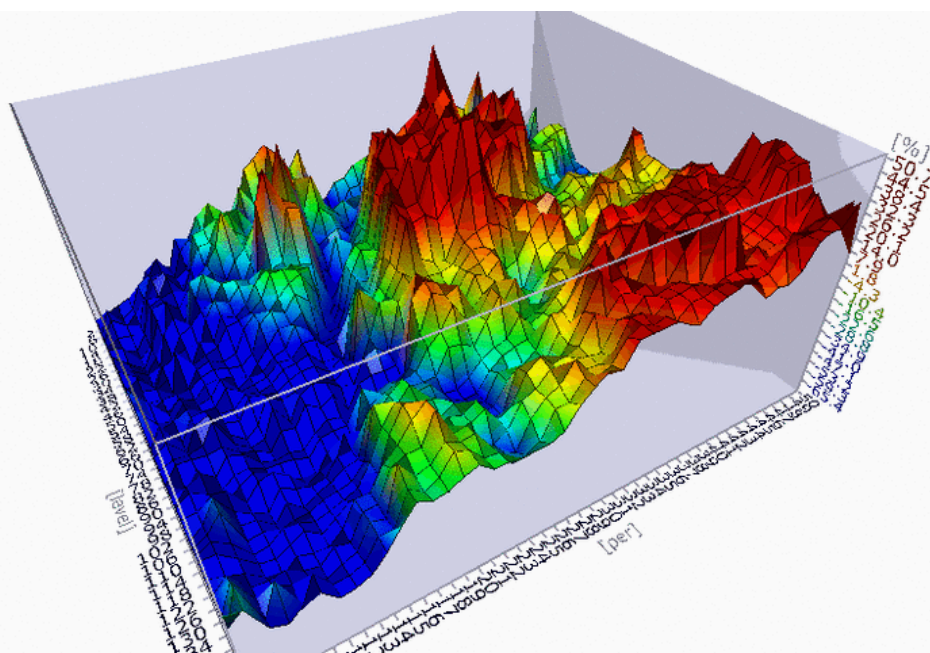
Skhokh Модератор

- **Тинькофф Инвестиции**
- (на полноту сведений не претендую и буду рад узнать ещё варианты брокеров с АПИ)

По субъективным причинам я выбрал работать с T-Bank Invest API (это бывший Тинькофф) через среду выполнения JavaScript Node.JS.

Немного моей истории, 2008-2012 годы: AmiBroker + QUIK

AmiBroker – это платформа для технического анализа, которая позволяет пользователям создавать свои собственные индикаторы и скрипты. Она также может интегрироваться с другими программами, такими как MetaTrader, NinjaTrader и даже с торговыми терминалами, включая QUIK.



AmiBroker 3D Optimization Chart

В AmiBroker'е мне очень нравилась его функция 3D Optimization Chart. На мой взгляд она позволяла избежать переподгонки показателей под кривую истории. Оптимизация в бэк-тестере поддерживалась функцией optimize. Синтаксис этой функции был следующий:

```
переменная = optimize("Описание", default, min, max, step);
```

переменная - это обычная переменная их языка AFL, которой присваивается значение, возвращаемое функцией оптимизации.

В режиме оптимизации функция optimize возвращает последовательные значения от минимума до максимума (включительно) с шагом.

"Описание" - это строка, которая используется для идентификации переменной оптимизации и отображается как имя столбца в списке результатов оптимизации.

default — это значение по умолчанию, которое оптимизирует возврат функции в режимах исследования, индикатора, комментария, сканирования и обычного бэктеста.

min — минимальное значение оптимизируемой переменной

max — максимальное значение оптимизируемой переменной

шаг — это интервал, используемый для увеличения значения от минимума до максимума.

QUIK – это торгово-информационная система, предназначенная для предоставления участникам фондового рынка доступа к биржевым данным в реальном времени. Она используется многими брокерами и трейдерами для совершения операций на фондовых рынках.

РЕКЛАМА

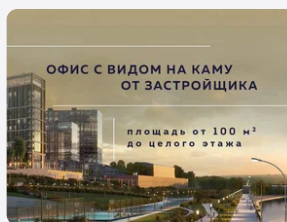


Фрезер Makita по выгодной цене!

В наличии. Выгодные цены. Самовывоз/доставка. Всё для дома, дачи, стройки и ремонта.

makita.vseinstrumenti.ru

РЕКЛАМА



Офисы с видом на Каму от застройщика....

Офисы по вашему проекту в новом бизнес центре на набережной. Оставьте заявку!

okulova.uds18.ru

Топ прошлой недели

- IFermer
3 поста
- ZaTaS
5 постов
- Animalrescued
38 постов

[Посмотреть весь топ](#)

Когда AmiBroker подключался к QUIK, он получал данные в реальном времени от торговой системы QUIK и использовал их для построения графиков, создания индикаторов и выполнения других аналитических задач. Пользователь мог также настроить систему так, чтобы она автоматически исполняла сделки через QUIK на основе определенных условий.

Для подключения AmiBroker к QUIK необходимо было установить соответствующий плагин или модуль. Это позволяло платформе AmiBroker получать данные от QUIK и обрабатывать их для дальнейшей работы.

Пример логов работы:

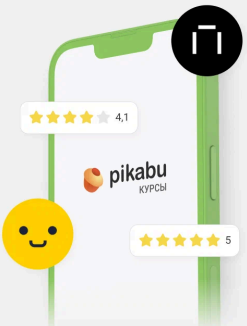
```
09.10.2009 11:00:31: [2208:2212] Получено уведомление о выполнении транзакции ,
TRANS_ID=807263520;CLASSCODE=SPBFUT;ACTION=NEW_ORDER;SECCODE=GMZ9;ACCOUNT
=SPBFUT0087W;PRICE=37692;QUANTITY=2;OPERATION=S;CLIENT_CODE=48560/48560;TYPE=
L;EXECUTION_CONDITION=;CHECK_LIMITS=;MARKET_MAKER_ORDER=;STATUS=3;TRANS_NAM
E="Ввод заявки"; DESCRIPTION="[FORTS] Заявка N 761722396 успешно зарегистрирована";
ORDER_NUMBER=761722396; 09.10.2009 14:04:30: [2208:1172] Получено уведомление об
отправке транзакции ,
TRANS_ID=2087816784;CLASSCODE=SPBFUT;ACTION=NEW_ORDER;SECCODE=VBZ9;ACCOUNT
=SPBFUT0087W;PRICE=6333;QUANTITY=12;OPERATION=S;CLIENT_CODE=48560/48560;TYPE=
L;EXECUTION_CONDITION=;CHECK_LIMITS=;MARKET_MAKER_ORDER=;STATUS=0;TRANS_NAM
E="Ввод заявки"; DESCRIPTION="Отправлена транзакция"; 09.10.2009 14:04:30: [2208:2212]
Получено уведомление о выполнении транзакции ,
TRANS_ID=2087816784;CLASSCODE=SPBFUT;ACTION=NEW_ORDER;SECCODE=VBZ9;ACCOUNT
=SPBFUT0087W;PRICE=6333;QUANTITY=12;OPERATION=S;CLIENT_CODE=48560/48560;TYPE=
L;EXECUTION_CONDITION=;CHECK_LIMITS=;MARKET_MAKER_ORDER=;STATUS=3;TRANS_NAM
E="Ввод заявки"; DESCRIPTION="[FORTS] Заявка N 763167846 успешно зарегистрирована";
ORDER_NUMBER=763167846; 09.10.2009 15:10:10: [2208:1172] Завершен процесс
отправления транзакций из файла , Входной файл-"C:\Program Files\Quik5\MTS\input.tri",
Выходной файл-"C:\Program Files\Quik5\MTS\output.tro", Файл с журналом-"C:\Program
Files\Quik5\MTS\log.trg", отправлено транзакций-3, выполнено транзакций-3
```

Насколько я понимаю AmiBroker (создан в Польше) уже несколько лет не обновляется:
последний выпуск в 2015 году, а обновления в 2017 году.


QUIKом я уже очень давно не пользовался, но по скриншотам на сайте я понял что программа внешне за последние годы не особенно изменилась.

Ещё немного моей истории, 2008-2012 годы: КБ ПАУК и Technical Analysis of STOCKS & COMMODITIES

Раньше я был активным пользователем форума КБ ПАУК. Вот даже нашёл файл HTML файл с интересующей меня темой, который пролежал 20 лет:



★★★★★ 4,1


pikabu
курсы

★★★★★ 5

Хочешь обучиться новой профессии?

Удобный каталог курсов от проверенных онлайн-школ с отзывами


ПЕРЕЙТИ

Лучшие посты недели

Рассылка Пикабу: отправляем самые рейтинговые материалы за 7 дней 🔥

УказатьПодписаться

Нажимая кнопку «Подписаться на рассылку», я соглашаюсь с [Правилами Пикабу](#) и даю согласие на обработку персональных данных.



Новости Пикабу

ПомощьНаграды

Кодекс ПикабуКонтакты

РекламаО проекте

О компанииЗал славы

Промокоды

Скидки

Работа

Курсы

Блоги

Купоны Мегамаркет

Купоны Спортмастер

Купоны М.Видео

Купоны Aliexpress

Купоны Lamoda

Мобильное приложение



Форум форекс кб паук <http://forex.kbpauk.ru/> (в 2024 уже не работает)

Я много изучал тему посвященную AmiBroker'y. И спрашивал там. Выкладывал примеры из бумажного журнала [Technical Analysis of STOCKS & COMMODITIES](#).

Сейчас, в 2024 году форум недоступен, но если кто-то хочет ностальгии, то [нашёл его архивную копию](#).

Форум форекс кб паук <http://forex.kbpauk.ru/> (в 2024 уже не работает)

Правда архивная копия немного бесполезна, потому что самые интересные разделы открывались только после входа по логину и паролю.

2024 год, сейчас: T-Bank Invest API + неофициальный SDK Node.JS. Описание функций торгового робота

Примерная структура робота

Осенью 2024 года решил написать торгового бота, создать структуру программы которая будет работать через API брокера.

Торговый робот должен содержать:

1. Список бумаг - с которым он будет работать.
2. Условие покупки.
3. Условие продажи.
4. CSV файл учёта
5. Управление деньгами - процент входа.
6. Логирование всех действий.
7. Отображение информации, скорее всего через веб-сервер.
8. Иметь модуль бектестинга.

T-Bank Invest API + Node.JS:

Решил пока не лезть в срочный рынок и попробовать поработать с самими оборотистыми акциями на Московской бирже. Остаётся только их найти.

В этой статье я распишу как создал два модуля на Node.js:

1. Взаимодействие с T-Bank Invest API `tinkoffClient.js`
2. Модуль, который ищет акции с самым большим оборотом за три последних месяца `searchTradingVolumes.js`

Проект представлен на Гитхабе: <https://github.com/empenoso/SilverFir-TradingBot>.

`SilverFir-TradingBot\src\grpc\tinkoffClient.js`

Модуль `tinkoffClient.js` — это специализированный клиент, разработанный для взаимодействия с T-Bank Invest API, российской брокерской платформой. Основная цель этого модуля — предоставить боту на основе Node.js, доступ к финансовым данным для алгоритмической торговли или анализа рынка.

Вот его функциональность:

Основные функции:

1. Авторизация и настройка:

- Модуль использует [API-токены для аутентификации](#).
- Он поддерживает как тестовую (песочницу), так и продовую среду, хотя по умолчанию он использует среду песочницы.
- Заголовки API включают необходимый токен авторизации и тип контента для JSON-коммуникации.

2. Универсальный механизм вызова API:

- Метод `callApi()` служит гибкой утилитой для отправки POST-запросов на конечные точки API Tinkoff.
- Он обрабатывает отправку полезной нагрузки и отчеты об ошибках, предоставляя подробную обратную связь по сбоям (через журналы).

3. Извлечение данных "японских свечей":

- Метод `getCandles()` извлекает данные свечей для заданного финансового инструмента (тикера) за указанные интервалы.
- Он вычисляет временной диапазон на основе предоставленного интервала и извлекает серию свечей из сервиса рыночных данных. Это необходимо для анализа рынка, технических индикаторов и торговых стратегий.
- Обрабатывает до 1000 свечей за запрос и обеспечивает регистрацию ошибок, если запрос не выполняется или возвращает пустые данные.

Зависимости и утилиты:

- **Moment.js:** Используется для форматирования дат и расчета временных диапазонов, что имеет решающее значение при работе с финансовыми данными за различные периоды времени.
- **Axios:** Обрабатывает HTTP-запросы к конечным точкам API.
- **Службы ведения журналов:** реализует настраиваемую систему журналов для вывода файлов и консоли, помогая в отладке и отслеживании операций.

SilverFir-TradingBot\src\searchTradingVolumes.js

Модуль searchTradingVolumes.js является частью SilverFir-TradingBot, разработан для определения акций на Московской бирже (MOEX) с наибольшими объемами торгов за последние три месяца. Нужен чтобы отбросить неликвид.

Вот подробный обзор функций модуля:

Основные функции:

1. Фильтрация акций с MOEX (Московской биржи):

- Модуль использует T-Bank Invest API для получения полного списка доступных акций.
- Фильтрует результаты, чтобы сосредоточиться конкретно на акциях, торгуемых на **REAL_EXCHANGE_MOEX**, гарантируя, что будут рассмотрены только акции Мосбиржи.
- Отфильтрованный список включает в себя важную информацию, такую как FIGI (глобальный идентификатор финансового инструмента), тикер, ISIN и название, которые затем регистрируются для отслеживания и анализа.

2. Извлечение исторических данных по объему торгов:

- Для каждой акции, идентифицированной на этапе фильтрации, модуль извлекает **ежедневные данные свечей** (OHLCV - открытие, максимум, минимум, закрытие, объем) с помощью T-Bank Invest API.
- Он извлекает данные за последние три месяца, рассчитывая общий объем торгов за этот период.
- Этот шаг имеет решающее значение для измерения рыночной активности и определения наиболее активно торгуемых акций.

1. Определение 15 лучших акций по объему:

- После сбора данных по объему торгов модуль ранжирует все акции на основе их общего объема торгов за трехмесячный период.
- Затем он выбирает 15 лучших акций, которые считаются имеющими самый высокий оборот, что делает их наиболее активными на рынке.

3. Ведение журнала и подготовка конфигурации:

- 15 лучших акций регистрируются с соответствующими тикерами и идентификаторами FIGI для дальнейшего использования.
- Эти данные также подготавливаются для включения в конфигурацию бота, что позволяет легко интегрировать их в другие части торговой стратегии.

Зависимости и утилиты:

- **Moment.js**: используется для манипулирования датами, в частности для генерации временных диапазонов (три месяца) для запросов исторических данных.
- **TinkoffClient**: это выделенный клиент бота для взаимодействия с API Tinkoff Invest, облегчающий коммуникацию, необходимую для получения данных по акциям и свечам.
- **Служба пользовательского ведения журнала**: модуль использует систему ведения журнала, которая регистрирует информацию как в консоли, так и во внешних файлах, помогая отслеживать фильтрацию акций, расчеты объема и любые ошибки, возникающие во время взаимодействия с API.

Результат выполнения скрипта searchTradingVolumes.js

```
2024-10-06 07:25:48 [INFO]: Отфильтрованных акций 170 штук.
2024-10-06 07:25:50 [INFO]: Топ 15 акций по объему за последние три месяца: [
{
  "ticker": "GRNT",
  "figi": "TCS10A0JV532",
  "totalVolume": 7092179306
},
{
  "ticker": "VTBR",
  "figi": "BBG004730ZJ9",
  "totalVolume": 5906896857
},
{
  "ticker": "MTLR",
  "figi": "BBG004S68598",
  "totalVolume": 5047115732
},
{
  "ticker": "UWGN",
  "figi": "BBG008HD3V85",
  "totalVolume": 4423660125
},
{
  "ticker": "RNFT",
  "figi": "BBG00F9XX7H4",
  "totalVolume": 1775061013
},
{
  "ticker": "EUTR",
  "figi": "TCS00A1002V2",
  "totalVolume": 1270913208
},
{
  "ticker": "SNGSP",
  "figi": "BBG004S681M2",
  "totalVolume": 1092911599
},
{
  "ticker": "GAZP",
  "figi": "BBG004730RP0",
  "totalVolume": 1027429605
},
{
  "ticker": "ROSN",
  "figi": "BBG004731354",
  "totalVolume": 983187493
},
{
```



```
"ticker": "SBER",
"figi": "BBG004730N88",
"totalVolume": 940111321
},
{
"ticker": "SGZH",
"figi": "BBG0100R9963",
"totalVolume": 929574444
},
{
"ticker": "AFLT",
"figi": "BBG004S683W7",
"totalVolume": 632806638
},
{
"ticker": "VKCO",
"figi": "TCS00A106YF0",
"totalVolume": 595704137
},
{
"ticker": "RUAL",
"figi": "BBG008F2T3T2",
"totalVolume": 542242519
},
{
"ticker": "TATN",
"figi": "BBG004RVFFC0",
"totalVolume": 538004844
}
}
```

2024-10-06 07:25:50 [INFO]:

Вставка в config.js:

2024-10-06 07:25:50 [INFO]:

securitiesToMonitorTikerArray:

```
["GRNT","VTBR","MTLR","UWGN","RNFT","EUTR","SNGSP","GAZP","ROSN","SBER","SGZH","AFLT","VKCO","RUAL","TATN"]
```

2024-10-06 07:25:50 [INFO]:

securitiesToMonitorFigiArray:

```
["TCS10A0JV532","BBG004730ZJ9","BBG004S68598","BBG008HD3V85","BBG00F9XX7H4","TCS00A1002V2","BBG004S681M2","BBG004730RP0","BBG004731354","BBG004730N88","BBG0100R9963","BBG004S683W7","TCS00A106YF0","BBG008F2T3T2","BBG004RVFFC0"]
```

2024-10-06 07:25:50 [INFO]:

Для использования в скрипте [download_md.sh](#) в одну колонку:

```
TCS10A0JV532
BBG004730ZJ9
BBG004S68598
BBG008HD3V85
BBG00F9XX7H4
TCS00A1002V2
BBG004S681M2
BBG004730RP0
BBG004731354
BBG004730N88
BBG0100R9963
BBG004S683W7
TCS00A106YF0
BBG008F2T3T2
BBG004RVFFC0
```

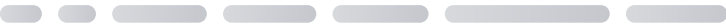
Итоги

Проект представлен на Гитхабе: <https://github.com/empenoso/SilverFir-TradingBot>. Новые модули будут загружаться по мере написания и тестирования.

Модуль `tinkoffClient.js` для T-Bank Invest API представлен пока только частично.

Автор: Михаил Шардин

7 октября 2024 г.



5 4K

Эмоции

РЕКЛАМА

-30%
25 390 ~~36 795~~₽
Надувной ПВХ водный остров на 4-6 человек

-29%
2 010 ~~2 871~~₽
Набор для выживания 48 в 1

-47%
1 455 ~~2 796~~₽
Кроссовки и кеды TangDuoYa

Лига биржевой торговли
3.2K постов • 8.2K подписчика

Добавить пост

Подписаться ...

Правила сообщества

- 1. Необходимо соблюдать правила Пикабу;
- 2. Оффтопик (то есть посты, не связанные с тематикой сообщества) запрещены.

Все комментарии Автора

Раскрыть 5 комментариев

Чтобы оставить комментарий, необходимо [зарегистрироваться](#) или [войти](#)

