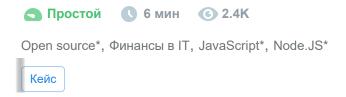




Работа в «песочнице» с торговым роботом на Московской бирже

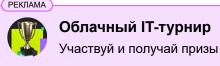


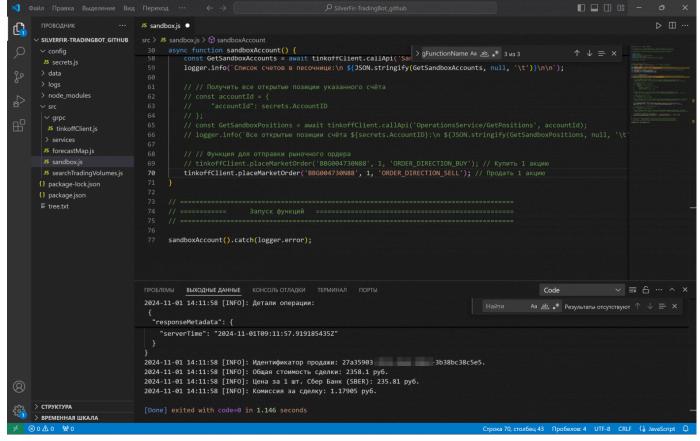
Перед тем как использовать торгового робота на живых деньгах хочется всё протестировать на демо-счете (или «песочнице»). Это когда программные ошибки не имеют особой стоимости.

Я планирую использовать робота на Московской бирже, через АПИ одного из брокеров. Чтобы частному инвестору начать торговать на бирже нужен брокерский счет. Однако минимальное число российских брокеров имеют свои АРІ (на текущий момент я знаю только ФИНАМ, Алор, Тинькофф Инвестиции). По субъективным причинам я выбрал работать с T-Bank Invest API (это бывший Тинькофф) через среду выполнения JavaScript Node.JS.

В статье разбираюсь как используя песочницу:

- 1. Открыть счёт.
- 2. Пополнить баланс счёта рублями через специальный запрос.
- 3. Посмотреть все свои открытые счета в песочнице.
- 4. Купить 1 акцию.
- 5. Продать 1 акцию.





Операция продажи через OrdersService/PostOrder

SilverFir-TradingBot\src\sandbox.js

Этот код Node.js взаимодействует с API Tinkoff Invest, позволяя имитировать торговые операции на виртуальном счете, что позволяет протестировать некоторые функции API в ручном режиме. Вот что делает этот код:

1. Импорт модулей

- secrets : импортирует ключи доступа и идентификаторы из внешнего файла конфигурации (secrets), что помогает защитить конфиденциальную информацию.
- logger : импортирует модуль ведения журнала, который записывает журналы в файл или консоль. Это важно для отслеживания активности бота и отладки.
- logFunctionName : импортирует утилиту для получения имен функций, что упрощает ведение журнала текущего контекста функции.
- TinkoffClient : импортирует клиентский модуль для взаимодействия с API Tinkoff

 Invest Этот клиент обрабатывает запросы к API



- API_TOKEN : получает токен API (в режиме песочницы) из внешнего файла конфигурации (secrets) для аутентификации.
- tinkoffClient : создает экземпляр TinkoffClient с токеном песочницы, настраивая связь API для среды песочницы.

3. Функции песочницы

- sandboxAccount() : это основная функция, демонстрирующая различные операции с учетной записью песочницы, с несколькими действиями, которые в настоящее время закомментированы.
- logFunctionName(): регистрирует имя функции в консоли, что полезно для отслеживания в сложных приложениях.
- GetSandboxAccounts : получает все открытые позиции указанного счёта.

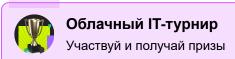
Закомментированные операции:

- OpenSandboxAccount: регистрирует новый счет в песочнице, что позволит начать тестирование заново.
- SandboxPayIn: зачисляет средства на счет в песочнице в российских рублях (RUB). Здесь указанная сумма составляет 30 000 руб.
- CloseSandboxAccount: закрывает указанный счет в песочнице, используя его accountId, что позволяет выполнить сброс после тестирования.
- **GetSandboxPositions**: извлекает и регистрирует все открытые позиции для указанного идентификатора счета.
- placeMarketOrder: отправляет рыночные ордера на покупку и продажу указанного инструмента (здесь ВВG004730N88). Это позволит протестировать функциональность размещения ордеров в песочнице.

Ошибки

• sandboxAccount().catch(logger.error): запускает sandboxAccount асинхронно и регистрирует любые обнаруженные ошибки.

Эта структура кода демонстрирует, как взаимодействовать с виртуальным торговым счетом



```
JS sandbox.js X
                                                                                                                                                                                                                        ▶ Ⅲ ..
Ф
                                            30 async function sandboxAccount() {
                                                         // const CloseSandboxAccount = await tinkoffClient.callApi('SandboxService/CloseSandboxAccount', accountId);
// logger.info(`Закрытие счёта в песочнице:\n ${JSON.stringify(CloseSandboxAccount, null, '\t')}\n\n');
          JS tinkoffClient.js
         JS forecastMap.js
                                                        const GetSandboxAccounts = await tinkoffClient.callApi('SandboxService/GetSandboxAccounts');
logger.info('Список счетов в песочнице:\n ${JSON.stringify(GetSandboxAccounts, null, '\t')}\n\n');
          JS sandbox.js
         JS searchTradingVolumes.js
        {} package-lock.json
        {} package.json

    tree.txt

                                                                                                                                                                                                           Code
                                            2024-11-02 07:25:30 [INFO]: Список счетов в песочнице:
                                                            "status": "ACCOUNT_STATUS_OPEN",
                                                            "openedDate": "2024-10-01T12:19:14.135019Z"
                                                             "accessLevel": "ACCOUNT_ACCESS_LEVEL_FULL_ACCESS"
      > структура
       > временная шкала
```

Запрос SandboxService/GetSandboxAccounts

```
// Импорт необходимых модулей const secrets = require('../config/secrets'); // Ключи доступа и идентификаторы

const logger = require('./services/logService'); // Логирование в файл и консоль const logFunctionName = require('./services/logFunctionName'); // Получение имени функц const TinkoffClient = require('./grpc/tinkoffClient'); // модуль для взаимодействия с A const API_TOKEN = secrets.TbankSandboxMode; const tinkoffClient = new TinkoffClient(API_TOKEN);

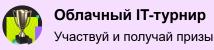
async function sandboxAccount() {

// https://tinkoff.github.io/investAPI/swagger-ui/#/SandboxService/SandboxService_G logger.info(`Запуск функции ${JSON.stringify(logFunctionName())}\n`);

// // Регистрации счёта в песочнице
// const OpenSandboxAccount = await tinkoffClient.callApi('SandboxService/OpenSandb

Облачный IT-турнир
Участвуй и получай призы
```

```
// const RUB = {
         "accountId": secrets.AccountID,
         "amount": {
             "nano": 0, // Дробная часть отсутствует
   //
             "currency": "RUB",
             "units": 30000, // Сумма в рублях
   //
   //
        }
   // };
   // const SandboxPayIn = await tinkoffClient.callApi('SandboxService/SandboxPayIn',
   // logger.info(`Пополнение баланса счёта песочницы:\n ${JSON.stringify(SandboxPayIn
   // // Закрытие счёта в песочнице
   // const accountId = {
   // "accountId": secrets.AccountID
   // };
   // const CloseSandboxAccount = await tinkoffClient.callApi('SandboxService/CloseSan
   // logger.info(`Закрытие счёта в песочнице:\n ${JSON.stringify(CloseSandboxAccount,
   // Посмотреть счета в песочнице
   const GetSandboxAccounts = await tinkoffClient.callApi('SandboxService/GetSandboxAc
   logger.info(`Список счетов в песочнице:\n ${JSON.stringify(GetSandboxAccounts, null
   // // Получить все открытые позиции указанного счёта
   // const accountId = {
   // "accountId": secrets.AccountID
   // };
   // const GetSandboxPositions = await tinkoffClient.callApi('OperationsService/GetPo
   // logger.info(`Bce открытые позиции счёта ${secrets.AccountID}:\n ${JSON.stringify
   // // Функция для отправки рыночного ордера
   // tinkoffClient.placeMarketOrder('BBG004730N88', 1, 'ORDER_DIRECTION_BUY'); // Куп
   // tinkoffClient.placeMarketOrder('BBG004730N88', 1, 'ORDER_DIRECTION_SELL'); // Пр
}
// -----
// ======= Запуск функций ===================================
// -----
sandboxAccount().catch(logger.error);
```



Я не ждал какого-то особо быстродействия. Для человека это очень быстро, но вот для робота это медленно. Это придётся учесть при разработке торговой стратегии.

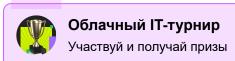
```
[Running] node "d:\Synology ...\SilverFir-TradingBot_github\src\sandbox.js"
2024-11-01 14:11:57 [INFO]: Запуск функции "sandboxAccount"
2024-11-01 14:11:58 [WARN]: Операция продажи выполнена успешно для Сбер Банк (SBER) (ВВ
2024-11-01 14:11:58 [INFO]: Детали операции:
  "orderId": "27a35903-2134-4aaf-XXXX-3b38bc38c5e5",
  "executionReportStatus": "EXECUTION_REPORT_STATUS_FILL",
  "lotsRequested": "1",
  "lotsExecuted": "1",
  "initialOrderPrice": {
    "currency": "rub",
   "units": "2358",
   "nano": 100000000
 },
  "executedOrderPrice": {
   "currency": "rub",
    "units": "235",
   "nano": 810000000
 },
  "totalOrderAmount": {
    "currency": "rub",
   "units": "2358",
    "nano": 100000000
 },
  "initialCommission": {
    "currency": "rub",
    "units": "1",
   "nano": 179050000
 },
  "executedCommission": {
    "currency": "rub",
   "units": "1",
    "nano": 179050000
  },
  "figi": "RRG00/730N22"
     Облачный IT-турнир
     Участвуй и получай призы
     currency: rub,
```

```
"units": "235",
    "nano": 810000000
  },
  "orderType": "ORDER_TYPE_MARKET",
  "message": "",
  "initialOrderPricePt": {
    "units": "0",
   "nano": 0
  },
  "instrumentUid": "e6123145-9665-43e0-XXXX-cd61b8aa9b13",
  "orderRequestId": "",
  "responseMetadata": {
    "trackingId": "d059748a138038d3XXXXX93783d61a99",
    "serverTime": "2024-11-01T09:11:57.919185435Z"
 }
}
2024-11-01 14:11:58 [INFO]: Идентификатор продажи: 27a35903-2134-4aaf-XXXX-3b38bc38c5e5
2024-11-01 14:11:58 [INFO]: Общая стоимость сделки: 2358.1 руб.
2024-11-01 14:11:58 [INFO]: Цена за 1 шт. Сбер Банк (SBER): 235.81 руб.
2024-11-01 14:11:58 [INFO]: Комиссия за сделку: 1.17905 руб.
[Done] exited with code=0 in 1.146 seconds
```

Для торгового робота 1,146 секунды от отправки ордера до его исполнения можно считать довольно медленным временем.

В высокочастотной торговле (HFT), где компании конкурируют за время исполнения менее миллисекунды, время обработки ордера более одной секунды будет непозволительно долгим. Стратегии HFT основаны на выполнении тысяч сделок за доли секунды, поэтому 1,146 секунды сделают этого робота неконкурентоспособным.

Напротив, для долгосрочной стратегии, такой как дневной торговый бот или свинг-трейдинг, это время может быть приемлемым. Скорость исполнения остается важной, но не такой критической, как в HFT. В этих случаях компромисс часто склоняется в сторону надежности и экономической эффективности, а не чистой скорости. Задержка в 1 секунду, как правило, не подорвет прибыльность в стратегии, где сделки исполняются с интервалом в несколько минут или даже часов.



течение нескольких дней или нескольких недель. Цель — извлечь прибыль из «колебаний»

цены, используя рыночный импульс, когда цены колеблются в рамках тренда или между уровнями поддержки и сопротивления.

Итоги

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

Автор: Михаил Шардин

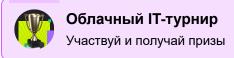
5 ноября 2024 г.

Только зарегистрированные пользователи могут участвовать в опросе. Войдите, пожалуйста.

Про какие виды торговли вы слышали?

80% Скальпинг	8
60% Дневная торговля	6
50% Торговля на колебаниях (свинг-трейдинг)	5
60% Алгоритмическая торговля	6
70% Высокочастотная торговля (НГТ)	7
60% Торговля на основе событий	6

Проголосовали 10 пользователей. Воздержался 1 пользователь.



Хабы: Open source, Финансы в IT, JavaScript, Node.JS





165 33 Карма Рейтинг

Михаил Шардин @empenoso

Разработчик

Подписаться

Электропочта



Сайт Сайт Github Telegram



ЭКСКАВАТОРЫ



X

Комментарии 10

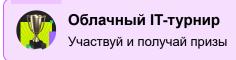
Публикации

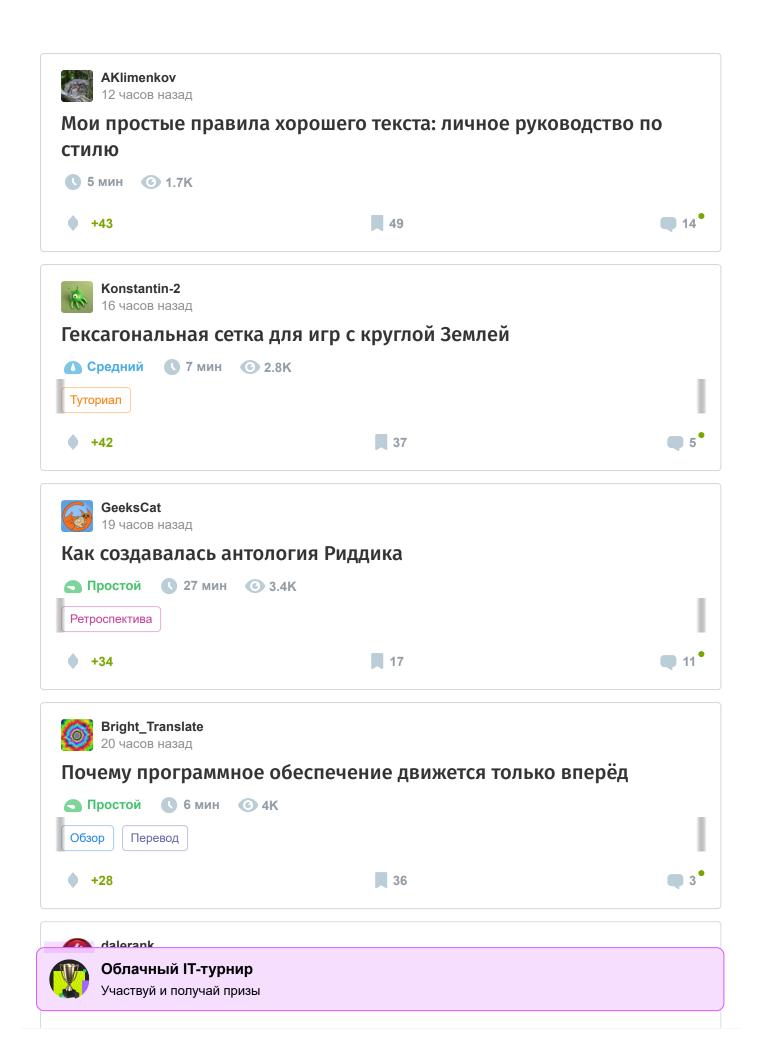
ЛУЧШИЕ ЗА СУТКИ ПОХОЖИЕ

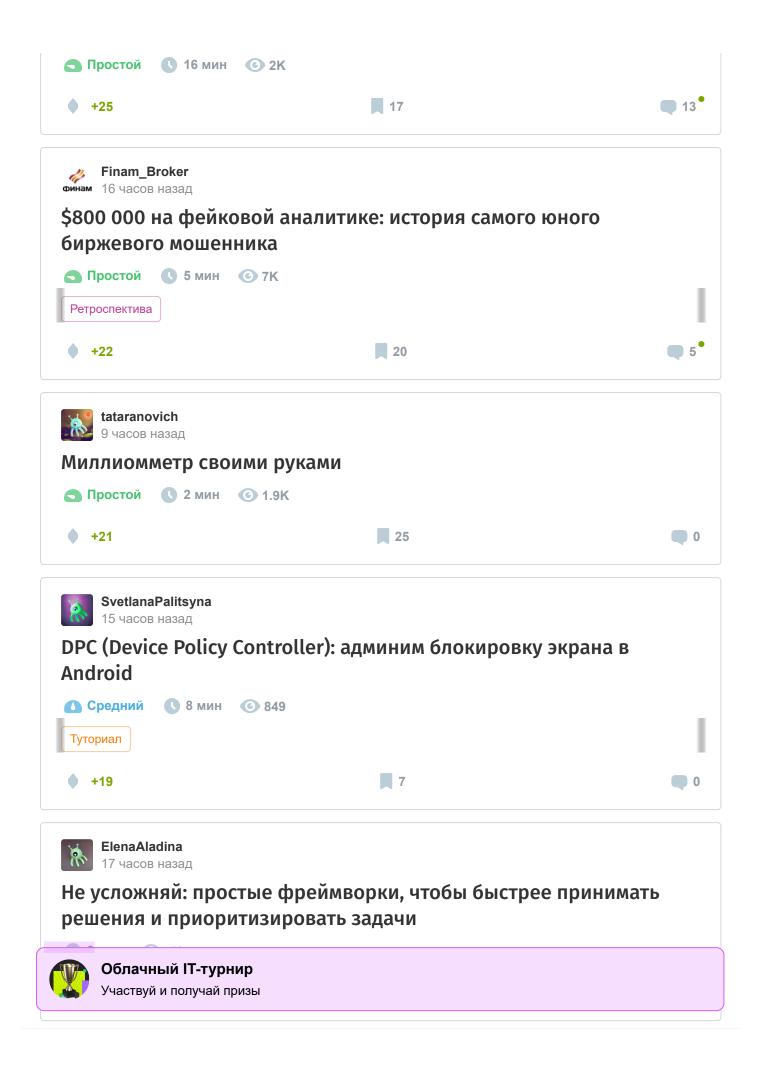


Ликуй, разработчик — всего 14 лет и QNX снова открыли









Как подружить ГОСТы и ИИ: первый металлургический ML-хакатон

Турбо

Показать еще

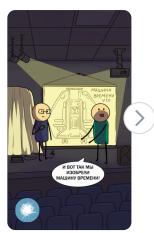
ИСТОРИИ











Выложены новые фото "Орла"

Спрошу у лида

Сладость или гадость?

Топ-7 годных статей из блогов компаний

Как продвинуть машину времени?

ВАКАНСИИ

NodeJS Бэкэнд разработчик

от 140 000 до 220 000 ₽ · Complex Cloud Solutions · Москва · Можно удаленно

JavaScript FullStack разработчик

от 80 000 до 130 000 ₽ · Rocket · Смоленск · Можно удаленно

JavaScript FullStack developer

до 220 000 ₽ · Wanted. · Санкт-Петербург

Fullstack JavaScript разработчик

от 30 000 до 80 000 ₽ · MakeDifference · Можно удаленно

NodeJS Developer



Облачный IT-турнир

Участвуй и получай призы

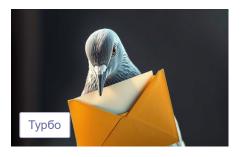
минуточку внимания



Курс на автоматизацию и облака: о трендах DevOps в России



Как работается айтишникам на металлургическом комбинате



Делаем защищенный почтовый ящик при помощи харденинга

РАБОТА

JavaScript разработчик

170 вакансий

React разработчик

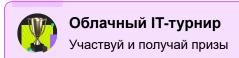
50 вакансий

Node.js разработчик

50 вакансий

Все вакансии

БЛИЖАЙШИЕ СОБЫТИЯ





8 октября – 4 декабря

ТурбоХакатон «Решения для электроэнергетики на базе искусственног интеллекта»

Онлайн

Разработка

Другое

Больше событий в календаре

