

Хабр



КАК СТАТЬ АВТОРОМ



Зарплаты IT-специалистов



Войти



empenoso

20 июл в 11:33

Как трейдер с Reddit пытался обыграть рынок с Python и public API — и почему у него не вышло

Простой

2 мин

1.7K

Проектирование API*, Финансы в IT

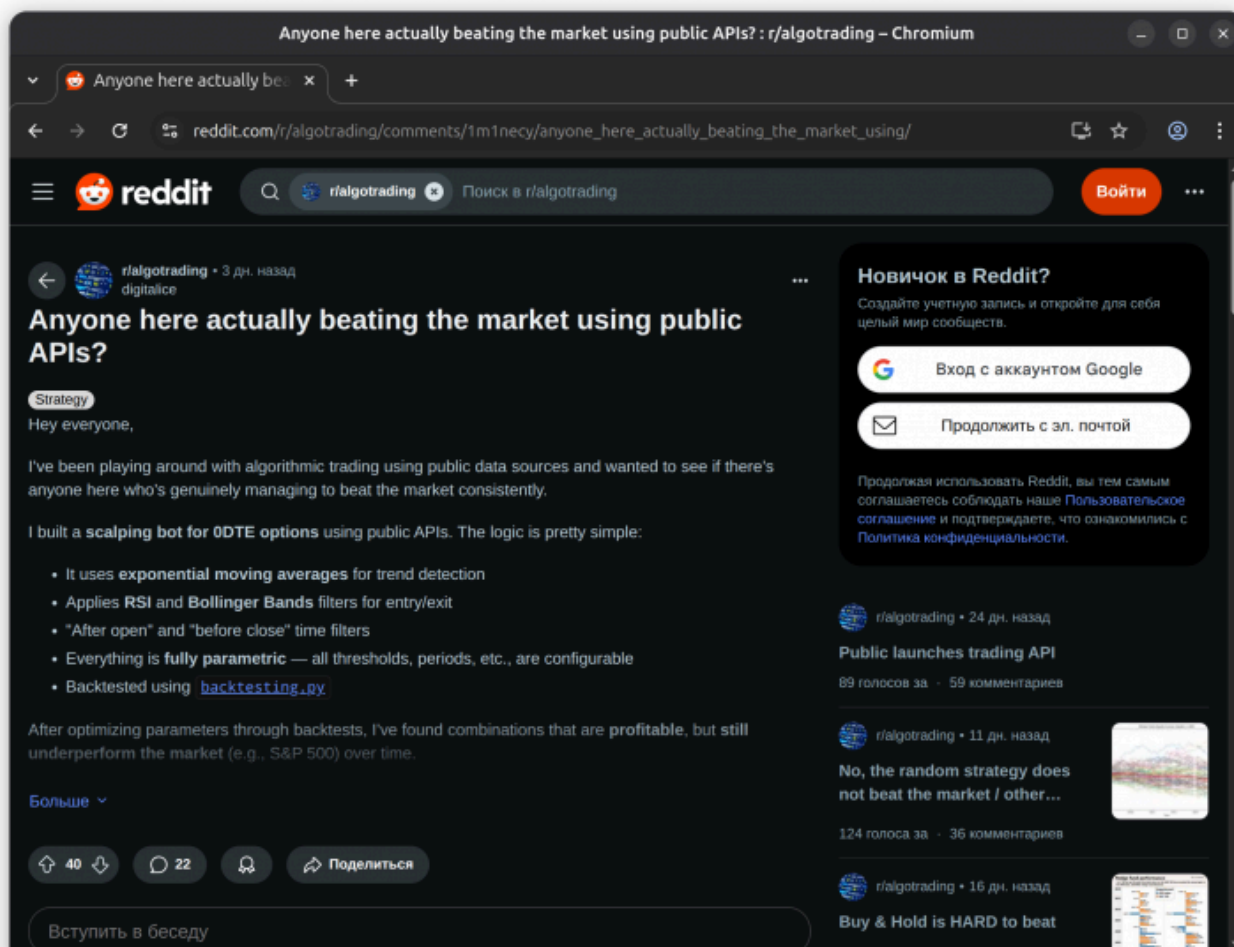
Мнение

На днях наткнулся на интересную дискуссию в англоязычном сообществе алгоритмических трейдеров [на Reddit в r/algotrading](#). Участник поделился своим опытом создания скальпинг-бота для торговли 0DTE опционами (опционы с экспирацией в день торговли) и задался вопросом: "Есть ли здесь кто-то, кто реально обыгрывает рынок с помощью публичных API?".

РЕКЛАМА

**ИТ-пром: сказ о нём**

Сила айти-решений на заводах



Он использовал простую логику:

- Скользящие средние (EMA) для тренда
- RSI + Bollinger Bands для фильтрации входов
- Вход только "после открытия" и выход "до закрытия"
- Всё настраивается через параметры
- Бэктестинг через Python библиотеку backtesting.py

Несмотря на оптимизацию его робот в долгосроке **всё равно не обыгрывает индекс S&P500**.



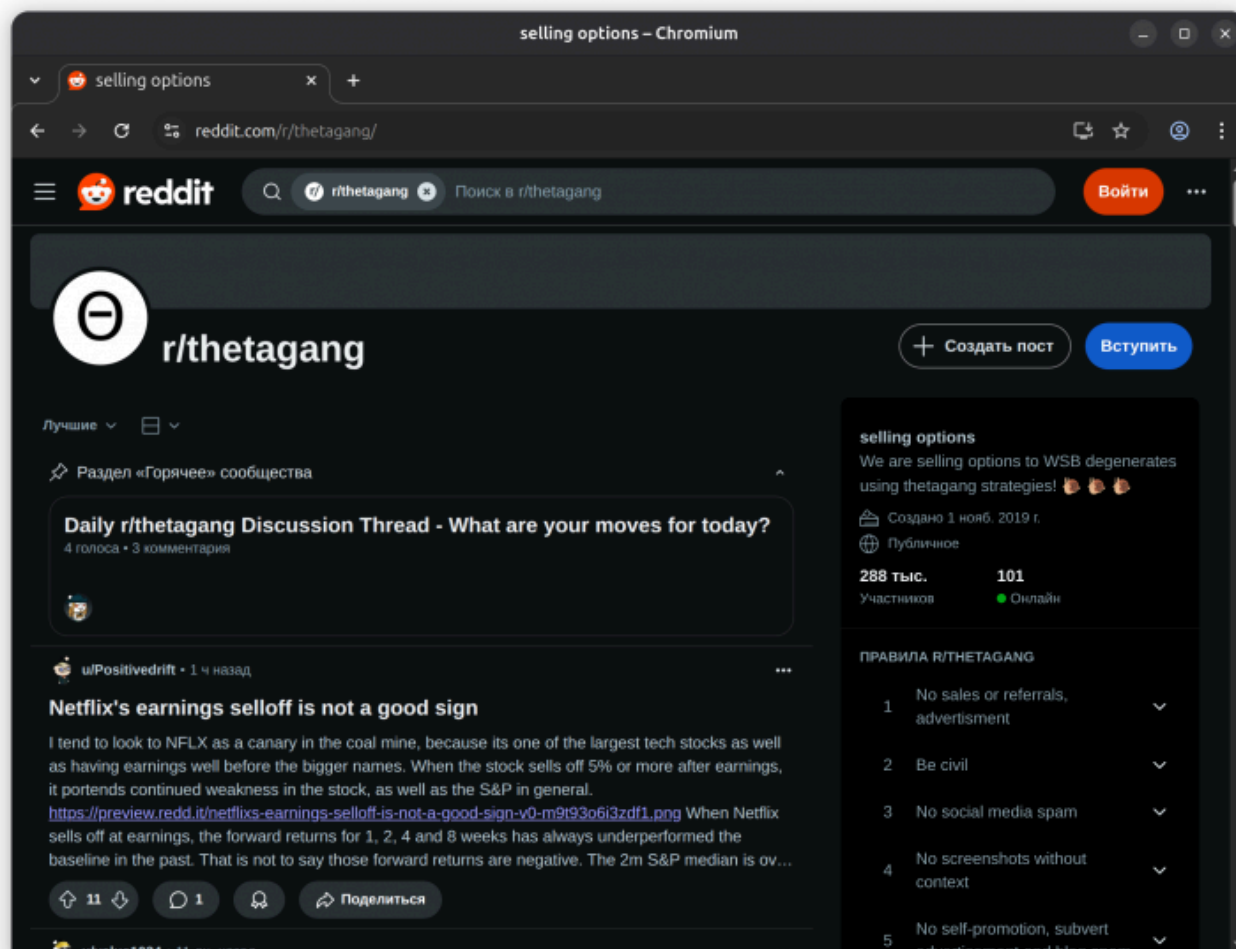
ИТ-пром: сказ о нём

Сила айти-решений на заводах

Другой участник раскритиковал подход автора поста.

"Вы используете EMA, RSI, полосы Боллинджера - те же стандартные индикаторы технического анализа, которые предоставляет каждый брокер. Большинство дневных трейдеров терпят неудачу, верно? Так почему вы думаете, что можно получить прибыль, глядя на те же индикаторы, что и все остальные?"

Три направления, где еще можно найти "альфу" (по версии Reddit)



Помимо критики этот более опытный участник выделил три направления, где по его мнению можно искать прибыль:

1. **Сбор премий за риск (продажа опционов):** не пытаться угадать направление, а зарабатывать на временном распаде. Отсылка к популярному движению [r/thetagang](https://www.reddit.com/r/thetagang/).

Главное здесь — не столько прогнозы, сколько грамотное управление риском.



ИТ-пром: сказ о нём

Сила айти-решений на заводах

устойчивых решений, таких как возврат к среднему и импульсы. Это уже ближе к

классическому "стат арбитражу".

3. **"Настоящая альфа" в неэффективностях:** поиск неэффективностей в низколиквидных инструментах или сложнооцениваемых активах.

А что с Россией? Проблема адаптации

Здесь начинается самое интересное. 0DTE опционы - это специфика американского рынка, где такие инструменты торгуются массово. Прямого аналога с ежедневной экспирацией, как на SPX, у нас нет. Но по духу и стилю торговли ближе всего:

1. **Недельные опционы в день экспирации (каждый четверг):** в последний день торгов они превращаются в те самые "zero-day" опционы. Вся премия - это внутренняя стоимость, а гамма взлетает до небес. Однако стоит учитывать, что рынок опционов в России заметно менее ликвиден, особенно за пределами самых популярных страйков и фьючерсных контрактов. Это ограничивает возможности как для входа и выхода, так и для систематической торговли.
2. **Фьючерсы:** это не опционы, но это де-факто главный инструмент для интрадей-скальпинга и краткосрочных спекуляций в России. Ликвидность, высокое плечо, волатильность - все, что нужно для алготрейдера, ищущего быстрые движения.
3. **Торговля на вечерней сессии:** Сниженная ликвидность и специфические движения "вечерки" создают среду, где могут работать стратегии, основанные на неэффективностях или возврате к среднему после закрытия основной сессии.

Дискуссия

Согласны ли вы с выводами reddit-сообщества? Реально ли найти конкурентное преимущество, которое позволяет трейдеру или инвестору систематически получать прибыль, используя только публичные данные?

Если интересна оригинальная ветка на Reddit — вот она:

[reddit.com/r/algotrading/comments/1dke40v](https://www.reddit.com/r/algotrading/comments/1dke40v)

Автор: Михаил Шардин

 [Моя онлайн-визитка](#)

 [Telegram «Умный Дом Инвестора»](#)



ИТ-пром: сказ о нём

Сила айти-решений на заводах

Теги: [алгоритмическая торговля](#)

Хабы: [Проектирование API](#), [Финансы в IT](#)

Редакторский дайджест



Присылаем лучшие статьи раз в месяц



Оставляя свою почту, я принимаю [Политику конфиденциальности](#) и даю согласие на получение рассылок

**212**

Карма

63.3

Рейтинг

Михаил Шардин [@empenoso](#)

[Автоматизация](#) / [Данные](#) / [Финансы](#) / [Умные дома](#)

[Подписаться](#)

[Сайт](#) [Сайт](#) [GitHub](#)



ИТ-пром: сказ о нём

Сила айти-решений на заводах

 Комментировать

Публикации

ЛУЧШИЕ ЗА СУТКИ

ПОХОЖИЕ

**Tirarex**

13 часов назад

Как я делал сеть на 2,5 гигабита с минимальным бюджетом — апгрейд, доступный каждому



Простой



9 мин



11K

Тutorial



+41



81



34

**Erwinmal**

17 часов назад

Сэндвич, сэр? История британских бутербродов от аристократических салонов до вокзальных буфетов



Простой



13 мин



3K

Ретроспектива



+41



20



2

**oneastok**

18 часов назад

ИТ-пром: сказ о нём

Сила айти-решений на заводах

[Обзор](#)[Перевод](#) +22 56 14**iLushkersky**

14 часов назад

Жизнь на Марсе? (снова)

**Простой**

3 мин



2.3K

 +17 5 10**TrexSelectel**

15 часов назад

Nintendo Virtual Boy: неожиданное возрождение виртуальной реальности из 90-х



5 мин



1.1K

 +14 3 3**mio_anni**

18 часов назад

От мини-ЭВМ и перфокарт к IDE и фреймворкам. Как поменялось программирование за 50 лет — взгляд изнутри



12 мин



1.9K

 +12 15 35**RED_OS_M**

18 часов назад

Станислав Петров: «Ключевые отличия РЕД ОС М от Android – вовсе не в интерфейсе»

**Средний**

8 мин



6.5K

[Интервью](#)**ИТ-пром: сказ о нём**

Сила айти-решений на заводах

**Albert_Wesker**

18 часов назад

Миф о быстром и медленном пути выполнения программы

**Средний**

11 мин



1.5K

Обзор

Перевод

+9

16

0

**kilokanat**

5 часов назад

Механическая клавиатура LARKeyboard

**Простой**

5 мин



487

Тutorial

+8

4

2

**beeline_cloud**

9 часов назад

Научный «дипфейк»? Как галлюцинации нейросетей — и другие проблемы — просачиваются в академические статьи

**Простой**

8 мин



874

Аналитика

+8

11

2

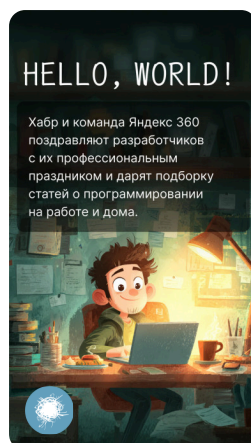
«Раньше играл в Танки, сейчас веду кибертурниры» — истории современных студентов

Турбо

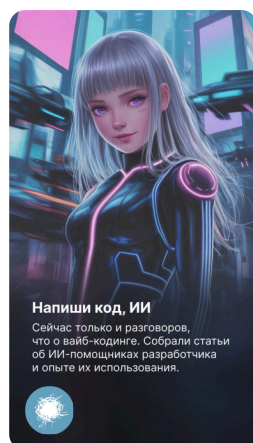
Показать еще

**ИТ-пром: сказ о нём**

Сила айти-решений на заводах



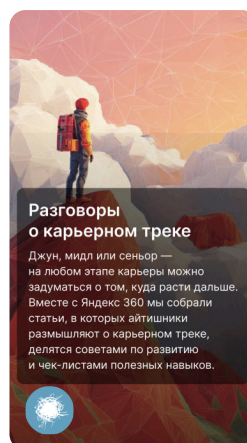
Чай, торт и код: с Днём программиста!



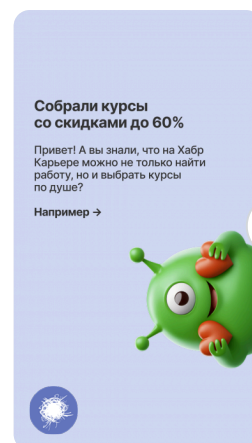
Made in AI



Чего хотят лиды в бигтехе?



Как расти в IT: советы, гайды и опыт сеньоров



Курсы со скидками до 60%

КУРСЫ

Python-разработчик

По мере набора группы

Профессия Веб-разработчик

По мере набора группы

Профессия: Фронтенд-разработчик

По мере набора группы

Инженер по тестированию

По мере набора группы

Аналитик данных

По мере набора группы

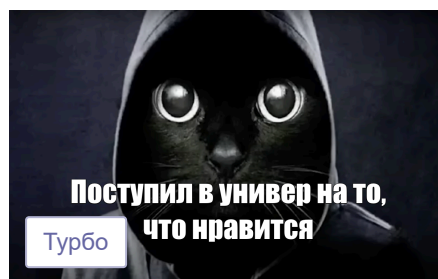
[Больше курсов на Хабр Карьере](#)

МИНУТОЧКУ ВНИМАНИЯ

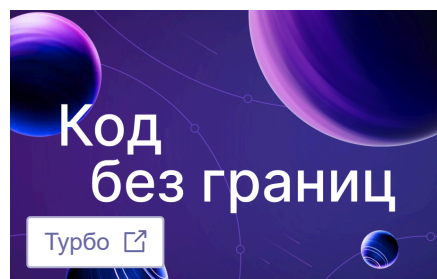


ИТ-пром: сказ о нём

Сила айти-решений на заводах



Где обучают вести кибертурниры и разрабатывать игры

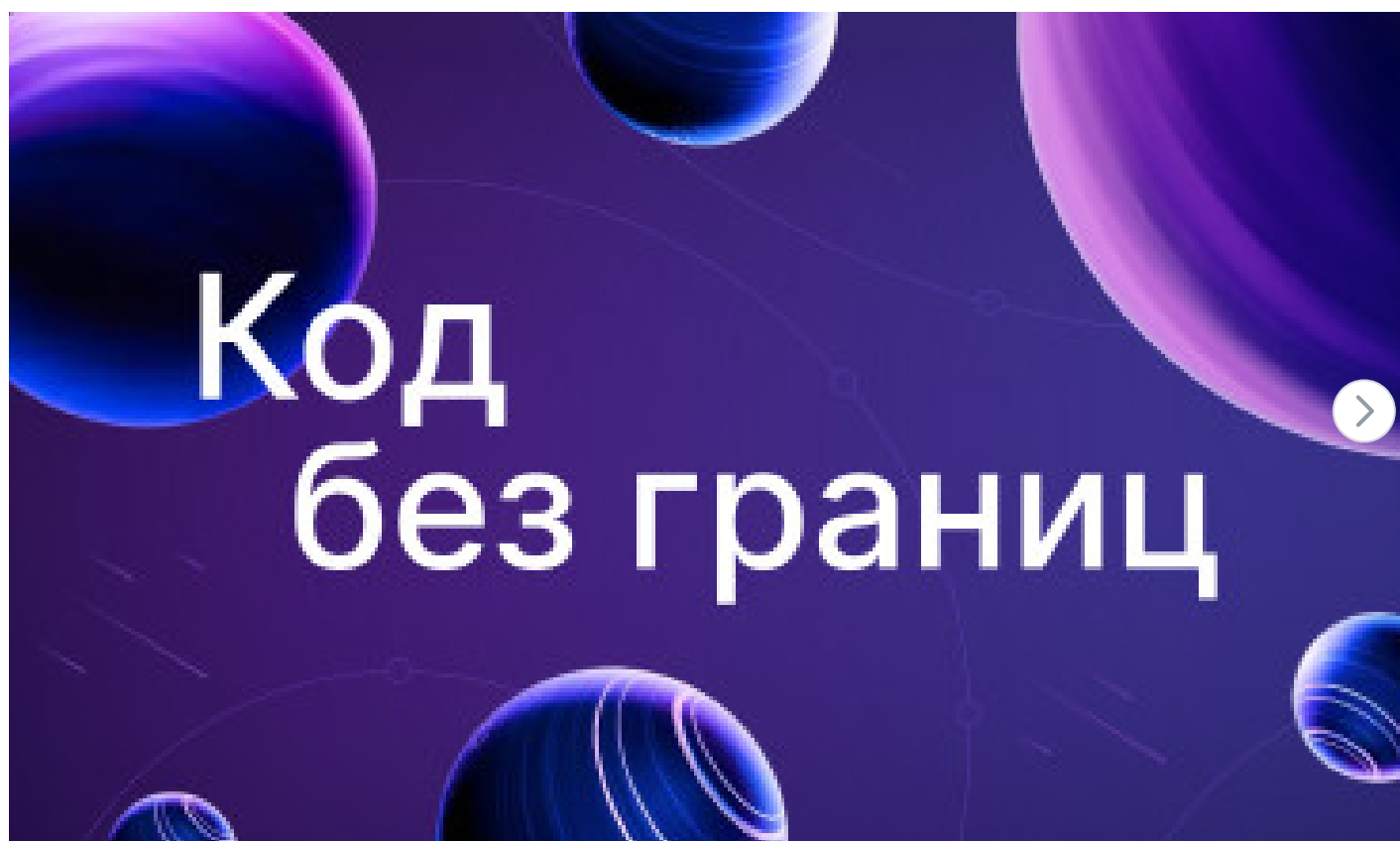


Отправь свой open source проект на конкурс и выиграй грант



Цифровизация на максималках: чем живёт ИТ-пром

БЛИЖАЙШИЕ СОБЫТИЯ



3 сентября — 31 октября

Программа грантов для развития open source проектов «Код без грани

Онлайн

Разработка



ИТ-пром: сказ о нём

Сила айти-решений на заводах

Хабр



🌐 Настройка языка

Техническая поддержка

© 2006–2025, Habr



ИТ-пром: сказ о нём

Сила айти-решений на заводах