

РЕКЛАМА

Хабр Карьера
Актуальные навыки для рынка
Учитесь тому, за что готовы больше платить

Хабр Курсы — инвестиция в себя

 **емpenoso**
20 июл 2025 в 11:33

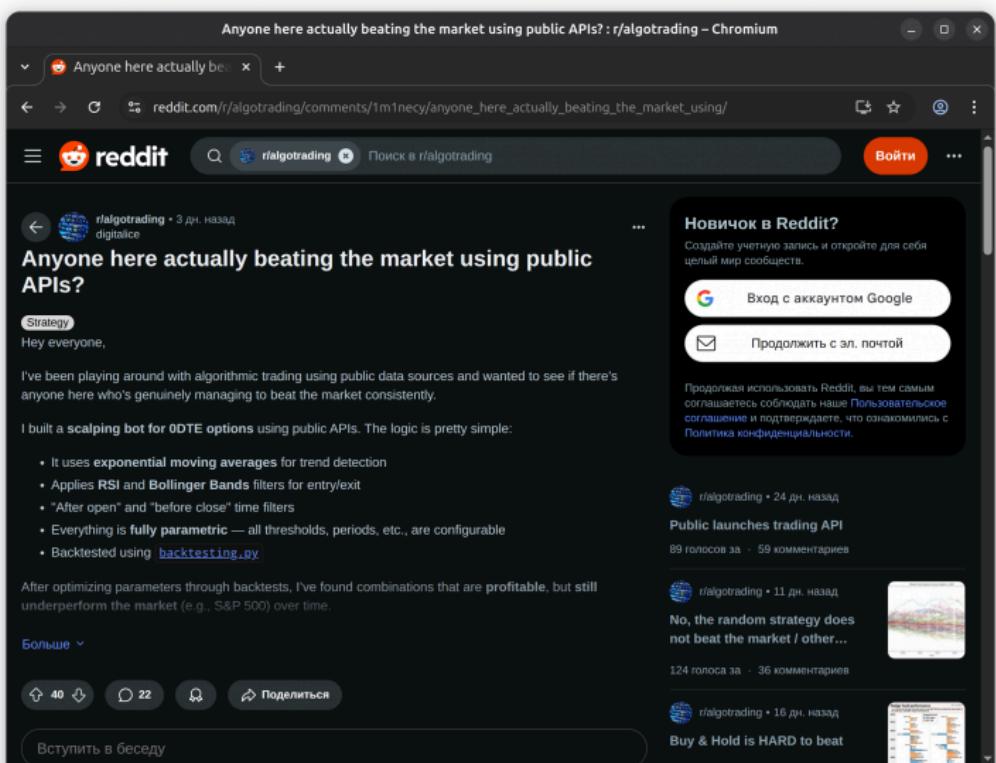
Как трейдер с Reddit пытался обыграть рынок с Python и public API — и почему у него не вышло

 Простой  2 мин  1.2K

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 ODTÉ опционами (опционы с экспирацией в день торговли) и задался вопросом: "Есть ли здесь кто-то, кто реально обыгрывает рынок с помощью публичных API?".



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

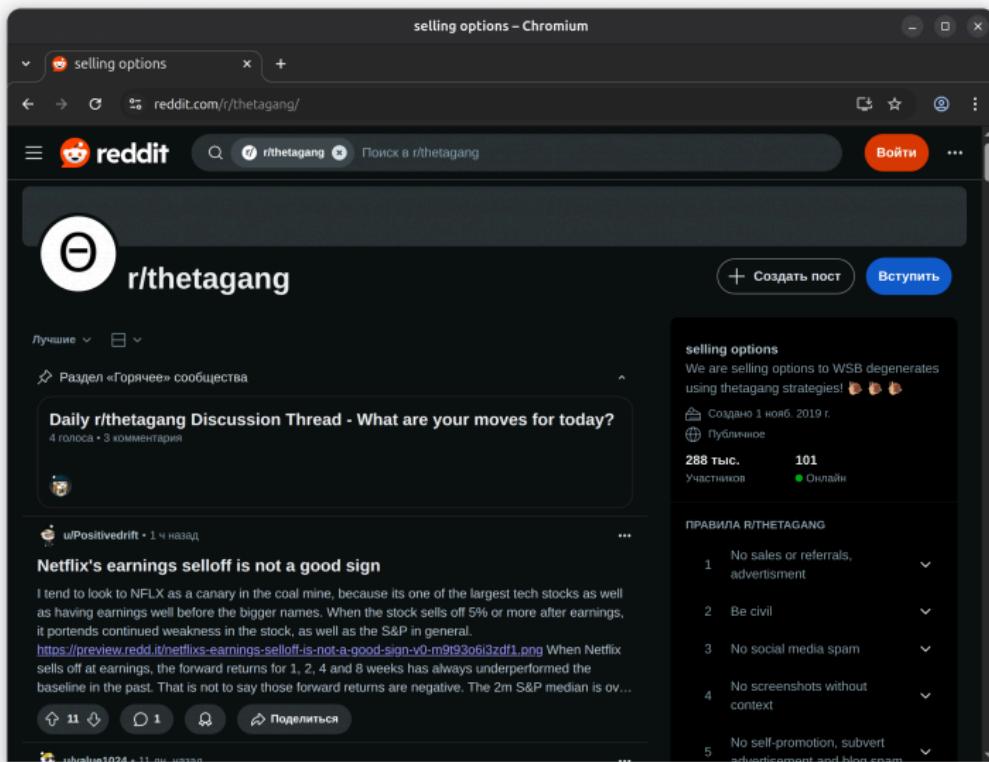
Несмотря на оптимизацию его робот в долгосроке **всё равно не обыгрывает индекс S&P500**.

Почему стандартные индикаторы это дорога в никуда?

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](#). Главное здесь - не столько прогноз, сколько грамотное управление риском.
2. **Эксплуатация рыночных аномалий (Mean Reversion & Momentum)**: поиск устойчивых явлений, таких как возврат к среднему и импульс. 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. ODTЕ 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/algorithmic_trading/comments/1dke40v/](https://www.reddit.com/r/algorithmic_trading/comments/1dke40v/)

Автор: Михаил Шардин

 [Моя онлайн-визитка](#)

 [Telegram «Умный Дом Инвестора»](#)

22 июля 2025 года

Теги: алгоритмическая торговля

Хабы: Проектирование API, Финансы в IT

Редакторский дайджест

Присылаем лучшие статьи раз в месяц

Электропочта

Подписаться

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



256

355.6

Карма Общий рейтинг

Михаил Шардин @empenoso

Автоматизация / Data & ML / Финансы / Smart Home

[Подписаться](#)[Сайт](#) [Сайт](#) [GitHub](#)

Комментарии 1

Публикации

[ЛУЧШИЕ ЗА СУТКИ](#) [ПОХОЖИЕ](#)**DrArgentum**

7 часов назад

Ненормальные непотребства, трюки, хаки и алгоритмы на C

Простой

10 мин

3.7K

[Обзор](#)

+25

33

9

**Sivchenko_translate**

6 часов назад

std::move ничего никуда не двигает: подробный рассказ о категориях значений в C++

35 мин

3.4K

Перевод

+21

34

3

**TrexSelectel**
6 часов назад

Полезные ресурсы для тестировщиков: подборка от специалистов Selectel

3 мин

2.7K

Мнение

+21

7

0

**shiru8bit**
6 часов назад

Игра во время загрузки игры

Простой

15 мин

3К

Ретроспектива

+19

3

2

**CreatorLAB**
22 часа назад

Конфигуратор микроконтроллеров STM8S103/105

10 мин

10K

+18

39

8

**dronnx**
8 часов назад

Black-White Array: новая структура данных с $O(\log N)$ аллокаций

Средний

8 мин

5.1K

Обзор

+17

39

2

**beget_com**
8 часов назад

Автомобили-конструкторы, кафе с удалёнными официантами и отстреливающиеся батареи: 15 проектов промдизайна 2025

6 мин

5.2K

Кейс

+16

2

1

**Grishandin**
8 часов назад

Закономерности в данных вместо догадок: как мы помогаем студентам дойти до конца курса

Средний 8 мин 3.9K

Кейс

+16

5

0

 sergbe
8 часов назад

Рецензия на книгу «Принципы модернизации программных архитектур»

Простой 9 мин 4.8K

Мнение

+14

7

0

 stasvetokhin
9 часов назад

Как выбрать идею для инди-игры и не потратить годы впустую

Простой 8 мин 5K

Кейс

+13

10

2

Упрощаем клиентский путь с помощью Цифрового профиля

Турбо

Показать еще

КУРСЫ



1C-программист

По мере набора группы



Python-разработчик

По мере набора группы



Frontend-разработчик

По мере набора группы



Профессия Графический дизайнер PRO

По мере набора группы



HR Бизнес-Партнер

По мере набора группы

Больше курсов на Хабр Карьере

МИНУТОЧКУ ВНИМАНИЯ



Бигтех или промышленность —
сделай свой выбор



От безумных стартапов
до стажировки на «Импульсе Т1»



Облако, где инфраструктура
становится невидимой

БЛИЖАЙШИЕ СОБЫТИЯ



25 ноября 2025 – 16 января 2026

Сезон «ИИ в разработке»

Онлайн

Разработка

Другое

Больше событий в календаре

Хабр



Настройка языка

Техническая поддержка

© 2006–2026, Habr