

empenoso

20 июл 2025 в 11:33

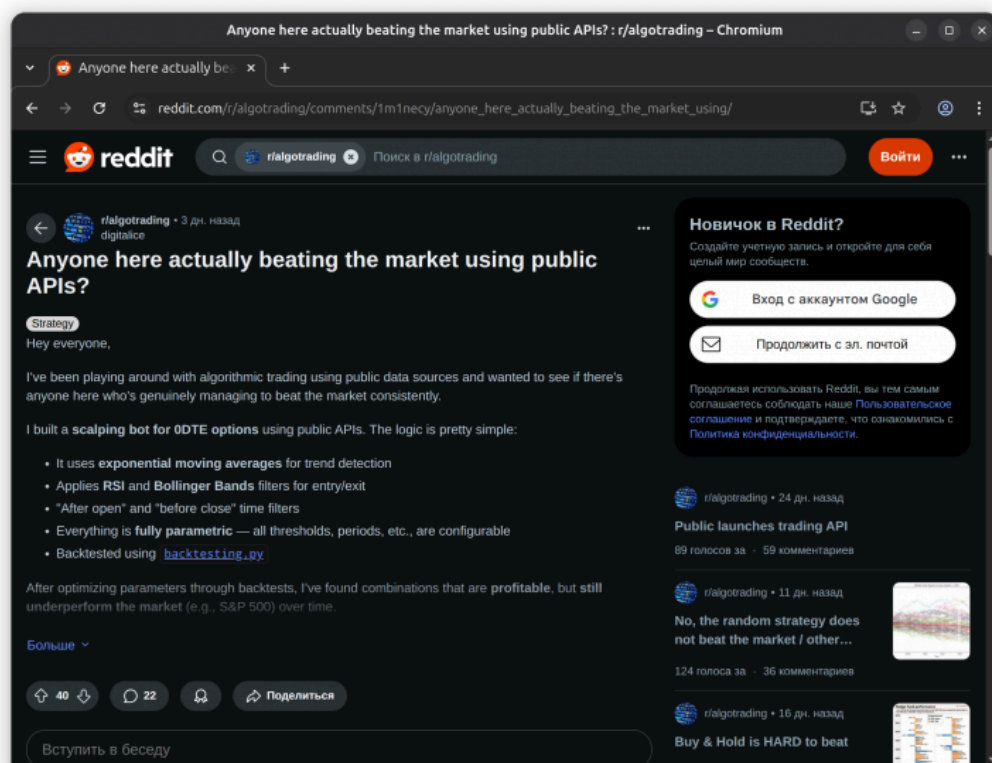
## Как трейдер с Reddit пытался обыграть рынок с Python и public API — и почему у него не вышло

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/algorithmictrading](#). Участник поделился своим опытом создания скальпинг-бота для торговли ODTE 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`

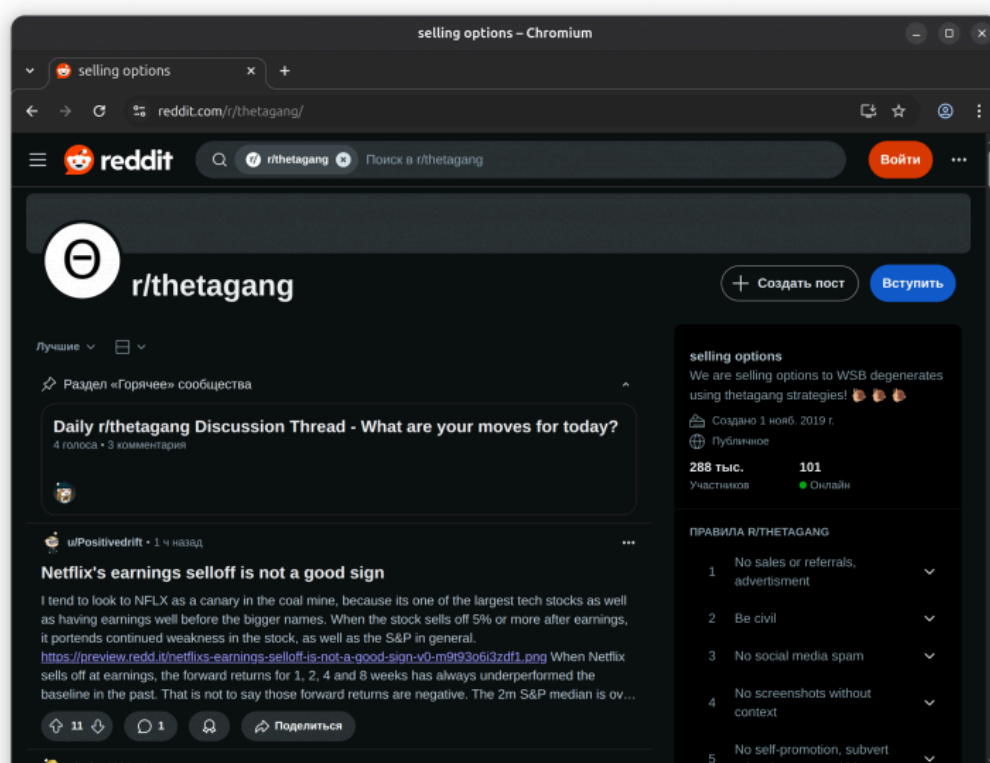
Несмотря на оптимизацию его робот в долгосроке **всё равно не обыгрывает индекс S&P500**.

## 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](https://www.reddit.com/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. OTE 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/algorithmictrading/comments/1dke40v](https://www.reddit.com/r/algorithmictrading/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

Подписаться

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



256

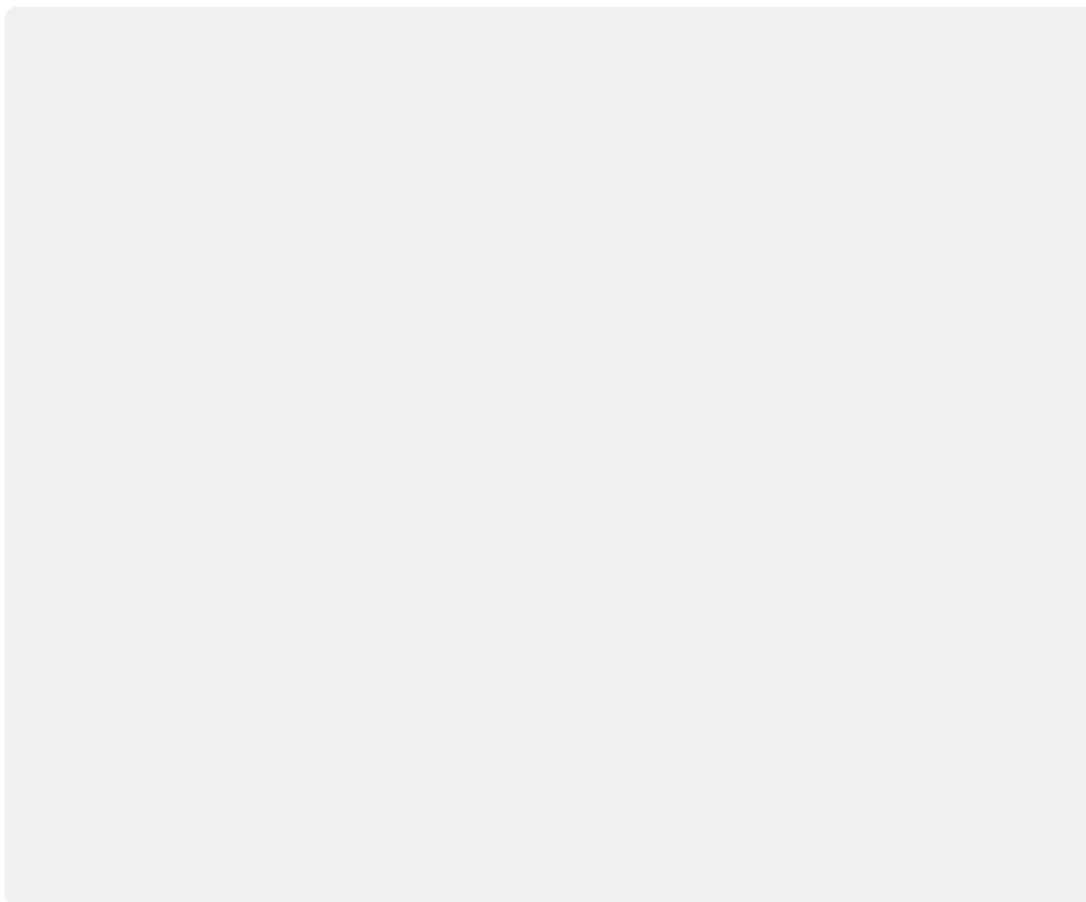
Карма

355.6

Общий рейтинг

**Михаил Шардин** @empenoso

Автоматизация / Data &amp; 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 3K

Ретроспектива

+19

3

2



CreatorLAB

22 часа назад

## Конфигуратор микроконтроллеров STM8S103/105

10 мин 10K

+18

39

8



dronnix

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



1С-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