

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

1.6K

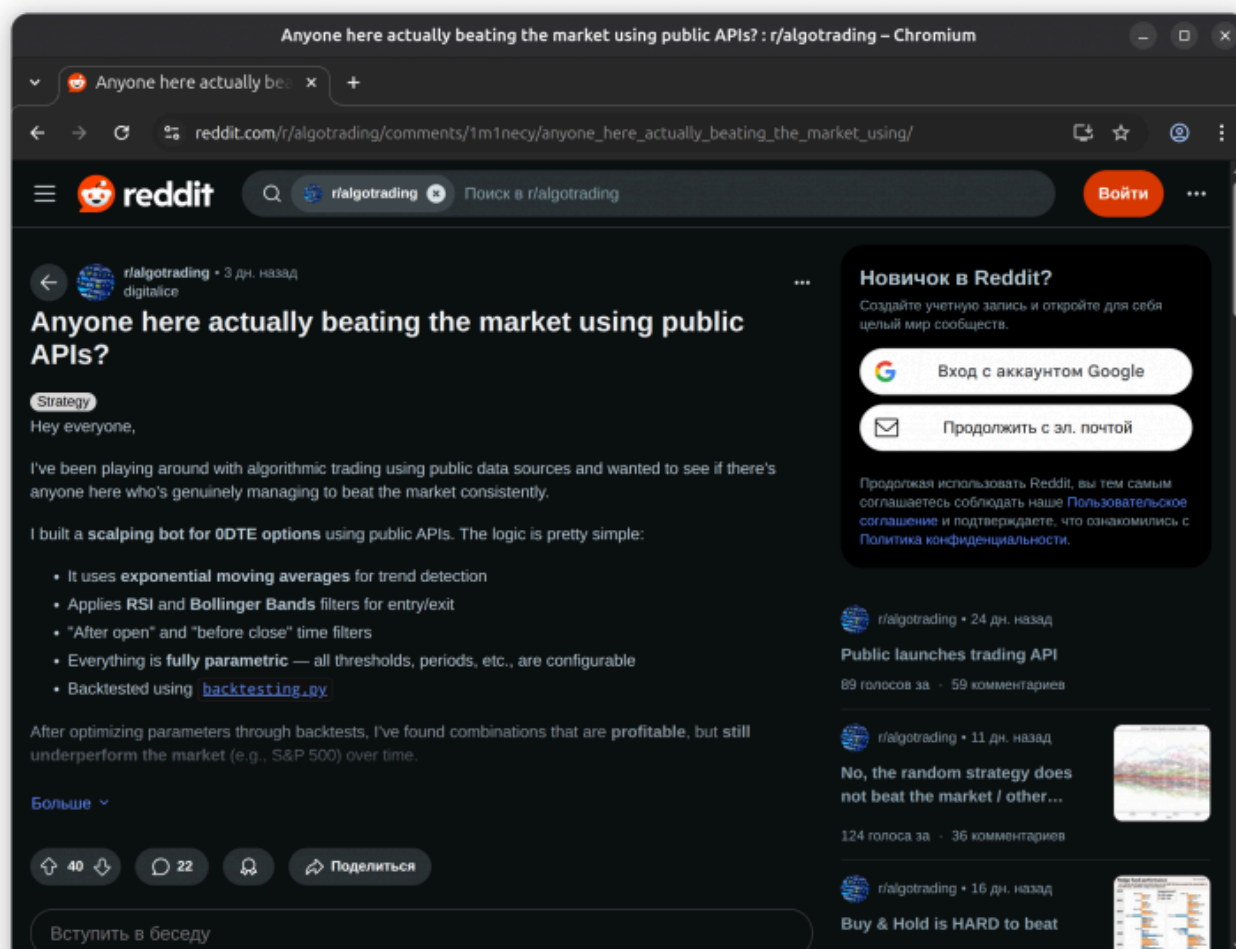
Проектирование API*, Финансы в IT

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?".

**Тест на отпускника**

Проверь, готов ли ты к отпуску



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**.



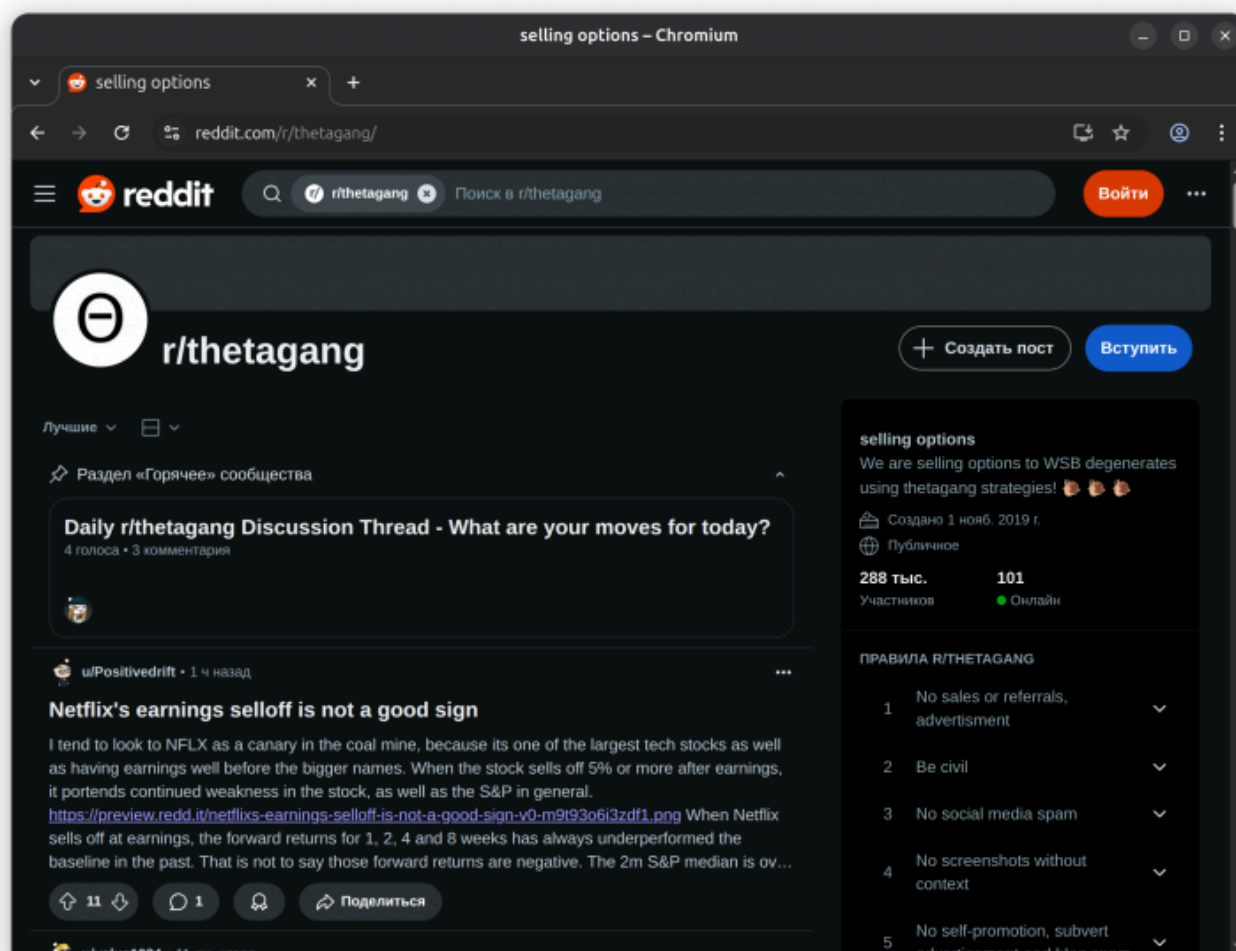
Тест на отпускника

Проверь, готов ли ты к отпуску

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/).



Тест на отпускника

Проверь, готов ли ты к отпуску

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»](#)



Тест на отпускника

Проверь, готов ли ты к отпуску

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

**211**

Карма

191.3

Рейтинг

Михаил Шардин [@empenoso](#)

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

[Подписаться](#)

[Сайт](#) [Сайт](#) [GitHub](#)



Тест на отпускника

Проверь, готов ли ты к отпуску

 Комментировать

Публикации

ЛУЧШИЕ ЗА СУТКИ

ПОХОЖИЕ

**alexeybashuk**

16 часов назад

Они «запатентовали» на себя обычное слово, а потом потребовали с нас пять миллионов рублей. Вот что было дальше



Простой



6 мин



7.4K

Кейс



+70



30



29

**beget_com**

20 часов назад

«Инженеры, делайте хуже!» — как в 1924 году родилось запланированное устаревание



5 мин



6.4K

Ретроспектива



+46



32



137

**RationalAnswer**

22 часа назад

**Тест на отпускника**

Проверь, готов ли ты к отпуску

 5 мин  12K[Дайджест](#) +35 14 75**alizar**

18 часов назад

Lottie — новый стандарт векторной анимации



Простой



7 мин



3.3K

[Обзор](#) +32 28 9**IlinValery**

20 часов назад

Как мы сделали робота-комплектующика: от идеи до первого прототипа



Простой



9 мин



2K

 +32 22 7**omyhosts**

13 часов назад

Что на самом деле делала кнопка «Турбо»



5 мин



6.5K

[Ретроспектива](#) +31 18 26**alan_dani**

22 часа назад

Я перепробовал все приложения для списков дел и в итоге остался с .txt файлом

**Тест на отпускника**

Проверь, готов ли ты к отпуску

 +31 35 35

interpres

14 часов назад

Самодельная монтировка телескопа на ESP32



Средний



9 мин



2.4K

Обзор

Перевод

 +30 30 13

romanova_ase

18 часов назад

Геоданные в PostgreSQL: зачем нужен PostGIS и как он работает



11 мин



2.5K

 +25 39 3

Albert_Wesker

17 часов назад

Создаём собственный системный вызов в Linux 6.8



Средний



4 мин



1.9K

Тutorial

Перевод

 +20 51 3

Ловкость рук — и приз ваш! Играйте в пинбол, побеждайте, забирайте награды!

Турбо

Показать еще



Тест на отпускника

Проверь, готов ли ты к отпуску



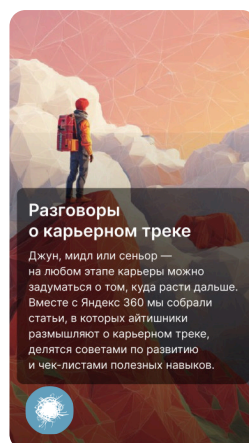
В поисках пятого элемента ИТ



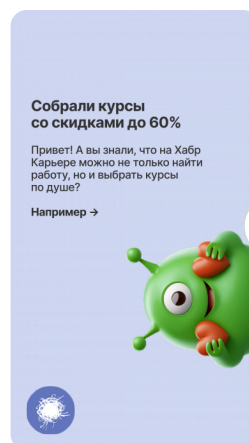
Твой вид из окна в стиле киберпанк



Топ-7 годных статей из блогов компаний



Как расти в ИТ: советы, гайды и опыт сеньоров



Курсы со скидками до 60%

ВАКАНСИИ

Системный/бизнес аналитик

от 280 000 до 300 000 ₽ · Vital Partners · Можно удаленно

Golang Developer

от 75 000 до 125 000 ₽ · ITK academy · Краснодар · Можно удаленно

Mobile-Backend QA Engineer (Automation)

от 250 000 до 300 000 ₽ · SMALL · Можно удаленно

QA engineer

до 200 000 ₽ · Wanted · Москва · Можно удаленно

Инженер ручного тестирования в команду ИЖС

от 200 000 до 350 000 ₽ · ДОМ.РФ · Москва · Можно удаленно

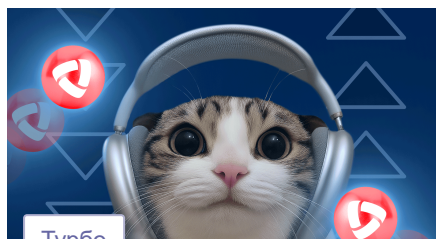
[Больше вакансий на Хабр Карьере](#)

МИНУТОЧКУ ВНИМАНИЯ



Тест на отпускника

Проверь, готов ли ты к отпуску



Турбо

IT-пинбол: цех стоит, кот грустит, все играют

IT-комикс

Смогу ли я? Комикс для будущих айтишников



Опрос

Да начнётся битва: выбираем лучший IT-бренд работодателя

БЛИЖАЙШИЕ СОБЫТИЯ



Тест на отпускника

Проверь, готов ли ты к отпуску



28 – 29 августа

X Медплатформа: Всероссийская онлайн-конференция по медицинскому бизнесу

Онлайн

Другое

[Больше событий в календаре](#)

Хабр



Тест на отпускника

Проверь, готов ли ты к отпуску

Техническая поддержка

© 2006–2025, Habr



Тест на отпускника

Проверь, готов ли ты к отпуску