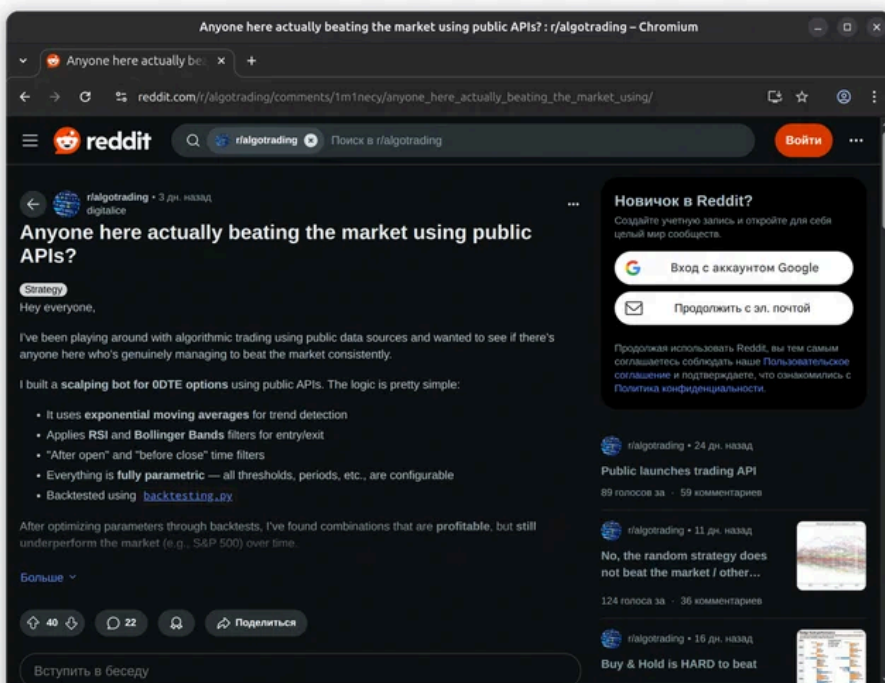




empenoso 1 месяц назад Лига Инвесторов

"Волшебные" индикаторы сливают: как реддитовский алготрейдер пытался обыграть рынок и что из этого ВЫШЛО

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 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:

Войти

Логин

Пароль

Войти

Создать аккаунт

[Забыли пароль?](#)

или продолжите с



Войти с Яндекс ID



Войти через VK ID



Промокоды



Работа



Курсы



Реклама



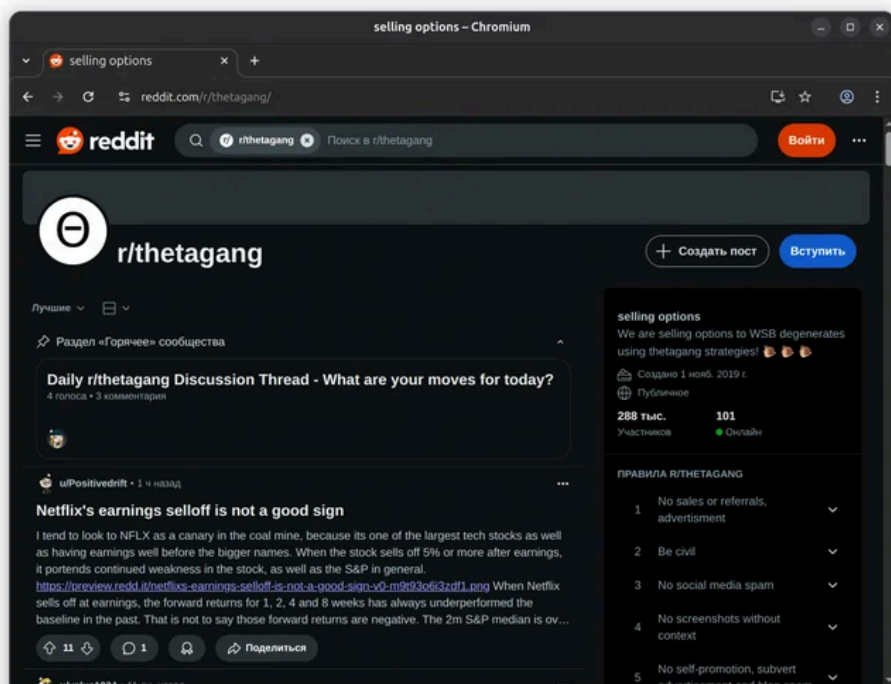
Игры



Пополнение Steam

"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/thetang](#). 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. 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

Пикабу Игры
+1000 бесплатных
онлайн игр



Кулинарные истории
Казуальные, Новеллы,
Симуляторы

Играть

Топ прошлой недели

- AlexKud
51 пост
- StenNews
2 поста
- Oskanov
8 постов

[Посмотреть весь топ](#)

Лучшие посты недели

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.

Рассылка Пикабу:
отправляем самые
рейтинговые материалы за 7
дней 🔥

Укажите [Подписаться](#)

Нажимая кнопку
«Подписаться на рассылку»,
я соглашаюсь с [Правилами](#)
[Пикабу](#) и даю согласие на
[обработку персональных](#)
[данных](#).

Помощь	Правила
Кодекс Пикабу	соцсети
Команда	О
Пикабу	рекомендация
Моб.	х
приложение	О компании

Промокоды Биг Гик
Промокоды Lamoda
Промокоды МВидео
Промокоды Яндекс Директ
Промокоды Отелло
Промокоды Aroma Butik
Промокоды Яндекс
Путешествия
Постила
Футбол сегодня



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»](#)

22 июля 2025 года



1



0

4.9K



Лига Инвесторов

11.5K постов • 7.9K подписчиков

[Добавить пост](#)

[Подписаться](#)



Правила сообщества

1. Необходимо соблюдать правила Пикабу
2. Запрещены посты, не относящиеся к тематике сообщества
3. Запрещается откровенная реклама

4. Нельзя оскорблять участников сообщества.

Чтобы оставить комментарий, необходимо [зарегистрироваться](#) или [войти](#)

● — ■ —

—
—
—
—
—
—

● — ■ —

—
—
—
—
—
—

● — ■ —

—
—
—
—
—
—

