

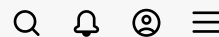
ПРОМО

«Молодая семья»: кому помогут с жильем

Узнать



Т—Ж



Учебник
 Сообщество
 Аптечка
 Дневники трат
 Инвестиции
 Права и обязанности

Инвестиции 16.09.20 @ 100K

Как устроены торговые роботы?

84 Сохранить



Сейчас на бирже очень популярны торговые роботы. Есть люди, которые активно этих роботов продают: якобы они автоматически торгуют на бирже, делают это быстрее человека в 1000 раз, и можно получить прибыль в размере 20—50% в месяц. Куча положительных отзывов, негативных крайне мало. Но мне не верится, что у этих инструментов инвестирования такая доходность.

Еще у крупных продавцов роботов есть свои партнерские программы — каким-то образом они активно зарабатывают бешеные деньги. Помогите, пожалуйста, разобраться, действительно ли это рабочая схема.

Алексей

Алексей, действительно, торговые роботы, которые автоматически торгуют на бирже, существуют. И да, они могут делать это в 1000 раз быстрее человека.

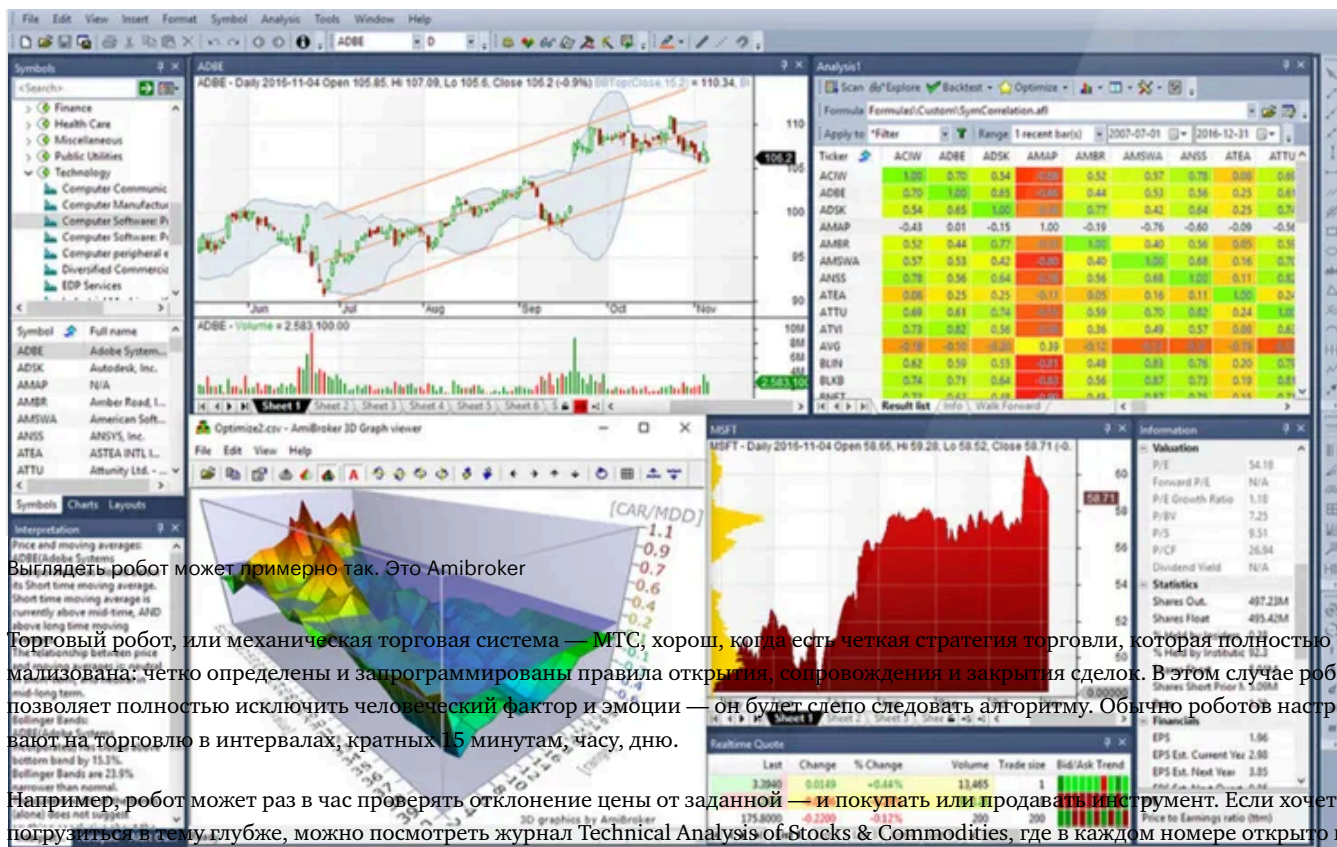
Михаил Шардин
 строил торговых роботов

Но что касается доходности и тем более покупки подобного торгового робота, то тут есть нюансы. О них и хочу рассказать.

Что за роботы и для чего они нужны

Торговый робот — это не двуногий андроид из металла и пластика, а компьютерная программа, которая обычно работает в связке с интерфейсом брокера. Как правило, связующим звеном выступает [терминал QUIK](#). Но некоторые брокеры предоставляют и прямой доступ к собственному API — программному интерфейсу «клиент — сервер», в котором на сервере прописаны все команды, а клиент использует эти команды и получает то, что ему необходимо в данный момент. Например, подает торговые приказы или смотрит текущие позиции.

Большинство торговых роботов не пишут с нуля, а используют существующие программные решения. Довольно популярны программы Amibroker, Astrend, Equis Metastock Professional, Excel, Neuro, TSLab, Ninja Trader, Matlab, Metatrader, Omega Research Prosuite & Tradestation, Quik, Wealth-Lab Developer. Да, Quik тоже попадает в этот список [за счет встроенных языков программирования](#): QPILE, или QUIK Programmable Interface and Logic Environment, и QLUA — это встроенный интерпретатор скриптового языка LUA.



Выглядеть робот может примерно так. Это AmiBroker

Торговый робот, или механическая торговая система — МТС, хорош, когда есть четкая стратегия торговли, которая полностью формализована: четко определены и запрограммированы правила открытия, сопровождения и закрытия сделок. В этом случае робот позволяет полностью исключить человеческий фактор и эмоции — он будет слепо следовать алгоритму. Обычно роботов настраивают на торговлю в интервалах, кратных 15 минутам, часу, дню.

Например, робот может раз в час проверять отклонение цены от заданной — и покупать или продавать инструмент. Если хочется погрузиться в тему глубже, можно посмотреть журнал Technical Analysis of Stocks & Commodities, где в каждом номере открыто публикуют коды торговых систем, адаптированные для разных программ. Например, в июльском выпуске за 2019 год в центре внимания — статья Виталия Апирина «Полосы экспоненциального отклонения».



Пять полезных сервисов для инвестора

👍 43 💬 91 📌 291

Еще бывают так называемые высокочастотные роботы, которые могут совершать тысячи сделок за секунду, — HFT, high-frequency trading. Про это есть хорошая книга Майкла Льюиса «Flash Boys. Высокочастотная революция на Уолл-стрит».

Но для высокочастотного трейдинга надо иметь минимальный пинг — промежуток времени, за который сигнал, отосланный с рабочего сервера, проходит через сеть до другого сервера и возвращается обратно, — до биржи и в идеале находится в том же самом здании, что и сама биржа.

Зачем вообще нужны торговые роботы? Конечно, чтобы зарабатывать. Роботы не устают и могут вести торговлю 24 часа в сутки 7 дней в неделю. Они могут обрабатывать одновременно десятки инструментов. Разберемся, почему обещания какой-либо доходности, особенно 20—50%, — это нереально.

А как инвестировать

Быстрые и нескучные уроки о том, как вкладывать с умом

Изучить

Причина 1: аналитическая

Московская биржа совместно с брокерскими компаниями ежегодно проводит конкурс «Лучший частный инвестор» — ЛЧИ.

Из итоговой статистики 2019 года видно, что самые активные участники конкурса, которые просто не могут быть людьми с таким количеством заявок и сделок, необязательно попадают в статистику лучших.

Организаторы конкурса ЛЧИ не указывают в явном виде, используется автоматический торговый алгоритм или ведется торговля руками. Но несколько десятков тысяч сделок за четыре месяца проведения конкурса однозначно говорят о применении алгоритмов. Например, там есть участник с 30 703 сделками и доходностью 172,60%, а есть участник, который совершил 657 058 сделок, но получил всего 1,69% дохода. Из этого можно сделать вывод, что алгоритмы тоже бывают разными: какие-то приносят их создателям доход, а какие-то нет.



Разбираем инвестиции в ETF через сервис «Ямми»

👍 4 💬 12 📌 4

Статистика конкурса «Лучший частный инвестор» 2019 года, отсортированная по активности: у некоторых участников были выставлены сотни тысяч заявок и заключены десятки тысяч сделок, но доходность большинства не впечатляет

Причина 2: логическая

Допустим, вы разработали алгоритм или считаете, что нашли какую-то локальную неэффективность на рынке. Дальше вы запрограммировали это, провели тесты на истории и подобрали необходимые параметры для работы, еще раз все проверили и запустили эту механическую торговую систему на реальном счете.

Допустим, что робот делает 20% в месяц. «Допустим», потому что **тесты на истории не гарантируют, что в дальнейшем будет хоть какая-то доходность**. Произведем расчеты из предположения, что у нас есть 300 000 Р и некий волшебный алгоритм, который гарантированно делает 20% в месяц.

Во что 20% в месяц превратят 300 000 Р за год

Январь	300 000 Р
Февраль	360 000 Р
Март	432 000 Р
Апрель	518 400 Р
Май	622 080 Р
Июнь	746 496 Р
Июль	895 795 Р
Август	1 074 954 Р
Сентябрь	1 289 945 Р
Октябрь	1 547 934 Р
Ноябрь	1 857 521 Р
Декабрь	2 229 025 Р

Из этой таблицы видно, что за год вложения увеличатся почти в восемь раз — и это при доходности только 20%. А вот что будет, если найти Грааль и брать 50% доходности ежемесячно.

Во что 50% в месяц превратят 300 000 Р за год

Январь	300 000 Р
Февраль	450 000 Р
Март	675 000 Р
Апрель	1 012 500 Р
Май	1 518 750 Р
Июнь	2 278 125 Р
Июль	3 417 188 Р
Август	5 125 781 Р
Сентябрь	7 688 672 Р
Октябрь	11 533 008 Р
Ноябрь	17 299 512 Р
Декабрь	25 949 268 Р

Первоначальный капитал увеличится почти в 90 раз всего за год. Возникает разумный вопрос: зачем отдавать кому-то курицу, которая несет золотые яйца? Если какой-то алгоритм работает, то любой разумный человек будет заинтересован в том, чтобы о нем знало как можно меньше людей: **чем больше инвесторов пользуются алгоритмом, тем быстрее он перестает работать**. Вероятнее всего, создатели пытаются выжать последние соки из уже отработавшего алгоритма, поэтому и пытаются продавать его, иногда со всем за смешные деньги. В нашей рубрике «Под прищуром» мы уже как-то разбирали один торговый робот и объяснили, **почему не стоит его покупать**.

К тому же именно с торговыми роботами есть дополнительные нюансы. Алгоритм принятия решений может быть скрыт или запутан. Может продаваться и так называемый черный ящик, в котором невозможно понять логику алгоритма. Это значит, что

в определенной фазе рынка алгоритм может работать хорошо, а в другой может за несколько сделок слить весь депозит. Чтобы написать торгового робота, не требуются особые знания. Любой программист в состоянии разобраться с этим. Другой вопрос: зачем ему этим заниматься?

А что касается партнерских программ, то бешеные деньги там могут делать как раз создатели таких программ, и никакого отношения к торговым роботам такой бизнес может не иметь. На поверку это оказывается обычным сетевым маркетингом и, возможно, пирамидой, куда привлекают все новых и новых членов, заманивая чем-то неизвестным, но привлекательным и очень доходным, одновременно не предоставляя аудированных отчетов о прошлых результатах.



Как работает финансовая пирамида

👍 40 💬 27 📌 30

Если у вас есть вопрос об инвестициях, личных финансах или семейном бюджете, пишите. На самые интересные вопросы ответим в журнале.

Задать вопрос

➔ Подписаться на автора

инвестиции

акции

👍 35 📌 32



Вот что еще мы писали по этой теме



5 фактов об отчете «Всеинструменты-ру» за девять месяцев 2024 года

👍 10 💬 12 📌 9



Президент утвердил поправки в налоговый кодекс: что изменится для инвесторов

👍 34 💬 27 📌 64



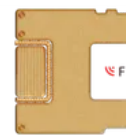
«Золото» с Мэттью Макконахи: реальность и вымысел

👍 18 💬 9 📌 3



Больше СПГ богу СПГ: инвестируем в Oneok

👍 8 💬 2 📌



Инвестиция потому что по карточке

👍 3 💬 ... 📌

Сообщество

Kulya · 18.01

Фото питомца: кошка Маечка в позе «буханки» на пуфике ...

Смбат Алиханян · 18.01

Я зарегистрировал бизнес в ОАЭ и потратил на это около 11 000 \$...

Алексей Лавриков · 18.01

Как настроить ChatGPT под свои задачи: мои советы ...

Bookisha · 18.01

Вы читаете личные телеграм-каналы? ...

Раиль Шарипкулов · 18.01

Я сделал трейдинг своим основным источником дохода и превратил его в бизнес ...

Ольга Баева · 18.01

«5500 рублей за это?»: как я выявила 5 проблем в питании в частном детском саду ... 2

Алена Елина · 18.01

Моя бьюти-находка: сыворotka-филлер от морщин Natura Siberica — «anti-age» ROYAL CAVIAR ...

Диляра Таюрская · 18.01

Фото питомцев: кот и пес сидят на диване ... 1

Bookisha ·

Я прочитал книжные с детства и р чем они за ...

Алена Елин

Рекоменду «Лолита» в

Популярное за неделю



Лучшие ноутбуки для работы: 9 удачных моделей

👍 67 💬 161 📌 237



Резерв и запас — в чем разница?

👍 26 💬 67 📌 29



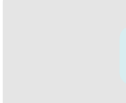
Как заключить договор на обслуживание газового оборудования

👍 19 💬 99 📌 41



Мнение: гостевой брак позволяет мужчинам наслаждаться отношениями без лишних обязательств

👍 58 💬 851 📌 30



Я помогала мазут на пл

👍 102 💬 1



Вакансии


Сообщить о проблеме

О проекте

Контакты

Политика конфиденциальности

Правила пользования сайтом

 АО «ТБанк», лицензия №2673
2025 journal@tbank.ru

