

Хабр



КАК СТАТЬ АВТОРОМ



Учиться новому



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

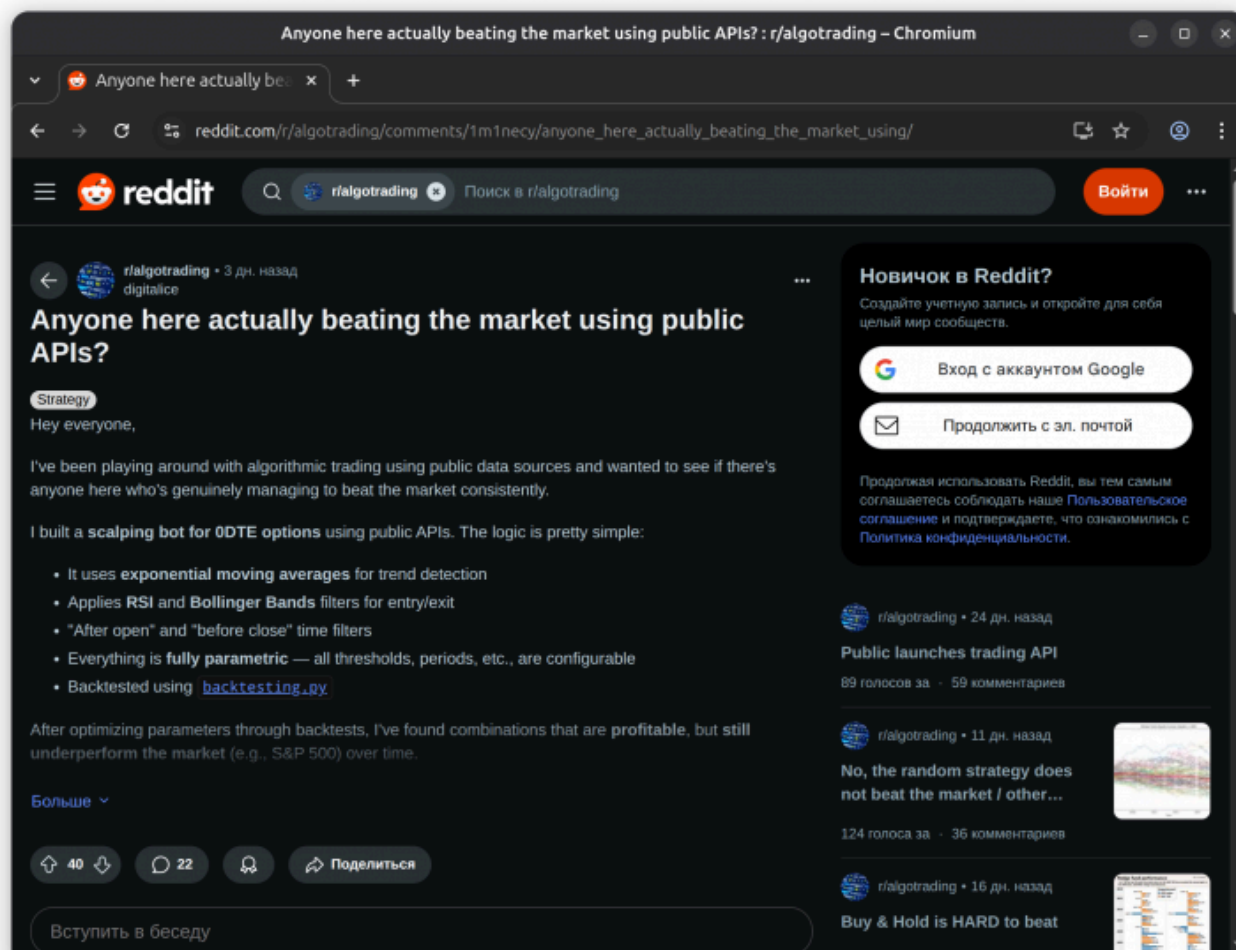
На днях наткнулся на интересную дискуссию в англоязычном сообществе алгоритмических трейдеров [на Reddit в r/algotrading](#). Участник поделился своим опытом создания скальпинг-бота для торговли 0DTE опционами (опционы с экспирацией в день торговли) и задался вопросом: "Есть ли здесь кто-то, кто реально обыгрывает рынок с помощью публичных API?".

РЕКЛАМА



IT-пинбол

Играй и выигрывай AirPods Max!



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**.



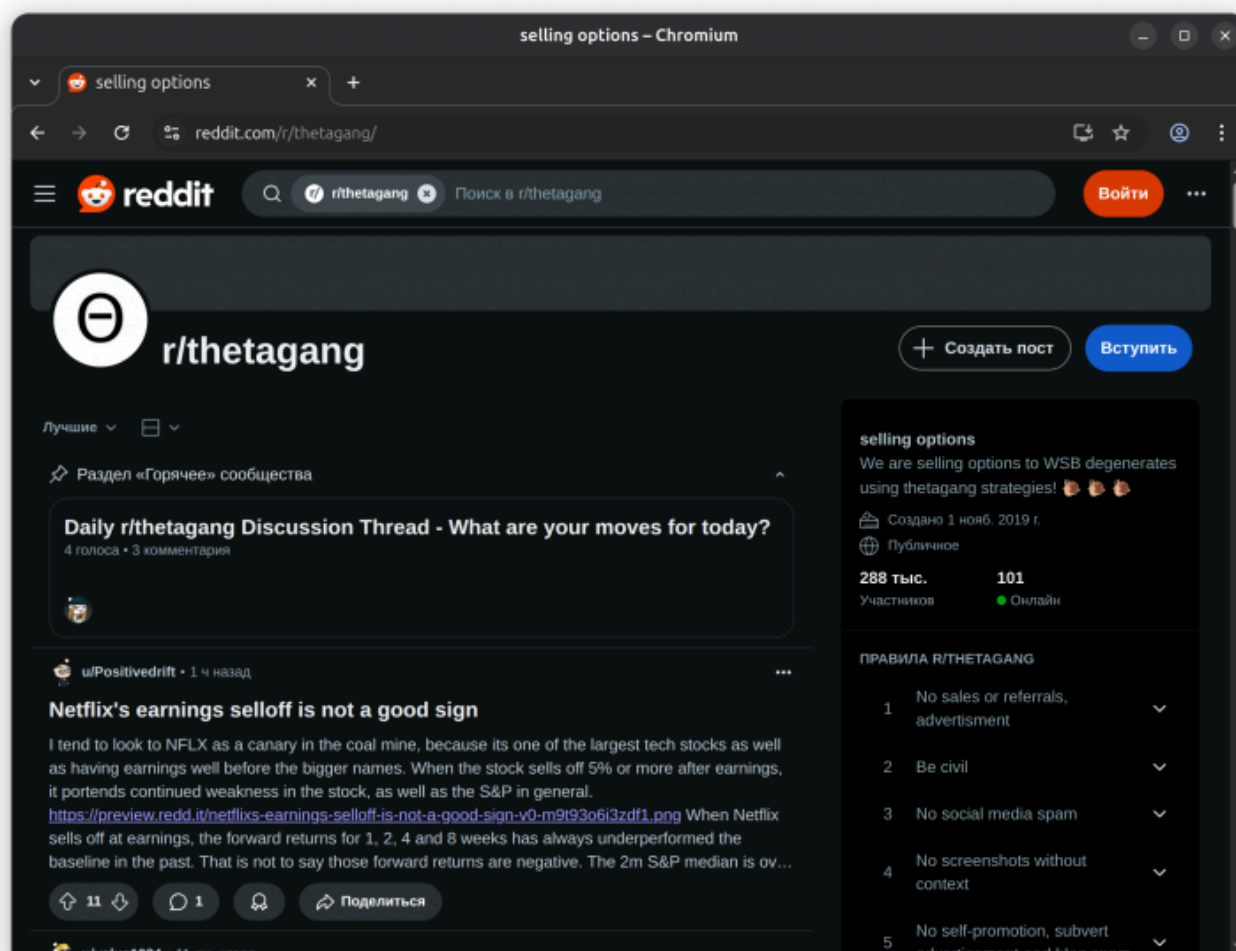
**IT-пинбол**

Играй и выигрывай AirPods Max!

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 ставить слишком высокие премии, чтобы избежать риска.



**IT-пинбол**

Играй и выигрывай AirPods Max!

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»](#)



**IT-пинбол**

Играй и выигрывай AirPods Max!

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

**208**

Карма

**167.2**

Рейтинг

**Михаил Шардин** [@empenoso](#)

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

[Подписаться](#)

[Сайт](#) [Сайт](#) [Github](#)

**IT-пинбол**

Играй и выигрывай AirPods Max!

 Комментировать

## Публикации

ЛУЧШИЕ ЗА СУТКИ

ПОХОЖИЕ



km1337

17 часов назад

### Чисто русский переезд в другой дата-центр

 7 мин 5.5K +74 22 6

20 часов назад

### Зарплаты IT-специалистов в первой половине 2025: +2%, рост замедлился

 6 мин 11K +38 15 44

Dmitry\_zm

18 часов назад

### Koda: AI-помощник разработчика – бесплатно, без VPN, с поддержкой русского языка

 Простой 3 мин 4K

IT-пинбол

Играй и выигрывай AirPods Max!

**M\_Y\_L\_T**

19 часов назад

**Чтобы построить корабль из дерева, мне нужно 350 часов и 50 тысяч рублей. Но готовый я не продам: для меня он бесценный**

**Простой**

3 мин



7.6K

**+33**

17



52

**DAN\_SEA**

15 часов назад

**Про гидроабразивную резку**

**Средний**

12 мин



1.5K

**Обзор****+24**

12



1

**vazhendima**

22 часа назад

**Что такое FinOps, зачем он нужен в 2025 году и с чем его едят**

**Простой**

8 мин



1.7K

**Обзор****+24**

17



32

**Lunathecat**

19 часов назад

**Компактный девятивольтовый повербанк для гитарного педалборда (или роутера)**

**Простой**

8 мин



1.2K

**Тutorial****+21**

7



4

**IT-пинбол**

Играй и выигрывай AirPods Max!

## Жизненный цикл фичи в коммутаторе: от идеи через QA до прода

 Простой  11 мин  806

Обзор

 +18

 12

 0



**GrishinAlex**

20 часов назад

## Как настроить Kafka в DBaaS от Selectel: подробный разбор параметров конфигурации

 Простой  7 мин  682

Обзор

 +18

 5

 0



**LesnoyChelovek**

14 часов назад

## Postgres Pro TDE — безопасность и производительность

 Средний  18 мин  663

Обзор

 +16

 6

 2

## Исследование: как и где ML-специалисты используют ИИ. Расскажите о своем опыте

Опрос

Показать еще

### ИСТОРИИ



**IT-пинбол**

Играй и выигрывай AirPods Max!

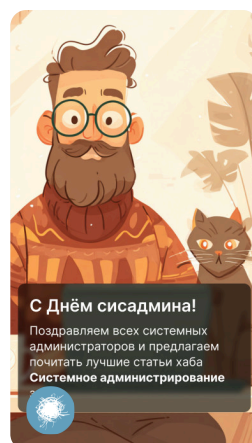




**Как изменить реальность за окном за секунду?**



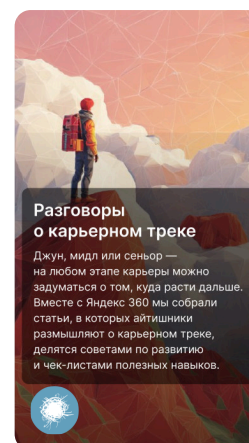
**Топ-7 годных статей из блогов компаний**



**С Днём сисадмина!**



**История Яндекс Почты**



**Как расти в ИТ: советы, гайды и опыт сеньоров**

Соб  
со с  
Прив  
Карьер  
работ  
по ду  
пр

**Курс  
до 6**

## ВАКАНСИИ

### Junior Golang Developer

от 100 000 до 140 000 ₽ · ITK academy · Казань · Можно удаленно

### Системный аналитик

от 85 000 ₽ · ITK academy · Казань · Можно удаленно

### Senior Mobile-Backend QA Engineer (Automation)

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

### Эксперт по web-разработке

до 220 000 ₽ · Гринатом · Москва

### Вебмастер - Фулстек разработчик / Junior Middle FullStack Developer

от 2 000 € · Midshore Development · Белград

[Больше вакансий на Хабр Карьере](#)

## МИНУТОЧКУ ВНИМАНИЯ



**IT-пинбол**

Играй и выигрывай AirPods Max!



Сколько хостов выдерживает  
один админ? Вот и узнаем

Турбо

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

Промо

Запускаем лучшие статьи с  
Хабра в космос

## БЛИЖАЙШИЕ СОБЫТИЯ



**IT-пинбол**

Играй и выигрывай AirPods Max!



15 августа

## BigData MeetUp от 43Tech

Санкт-Петербург • Онлайн

Разработка

Больше событий в календаре

Хабр



IT-пинбол

Играй и выигрывай AirPods Max!

Техническая поддержка

© 2006–2025, Habr



**IT-пинбол**

Играй и выигрывай AirPods Max!