

Во время посещения сайта вы соглашаетесь с использованием файлов [cookie](#)

Хорошо



Михаил Шардин ★

личный блог

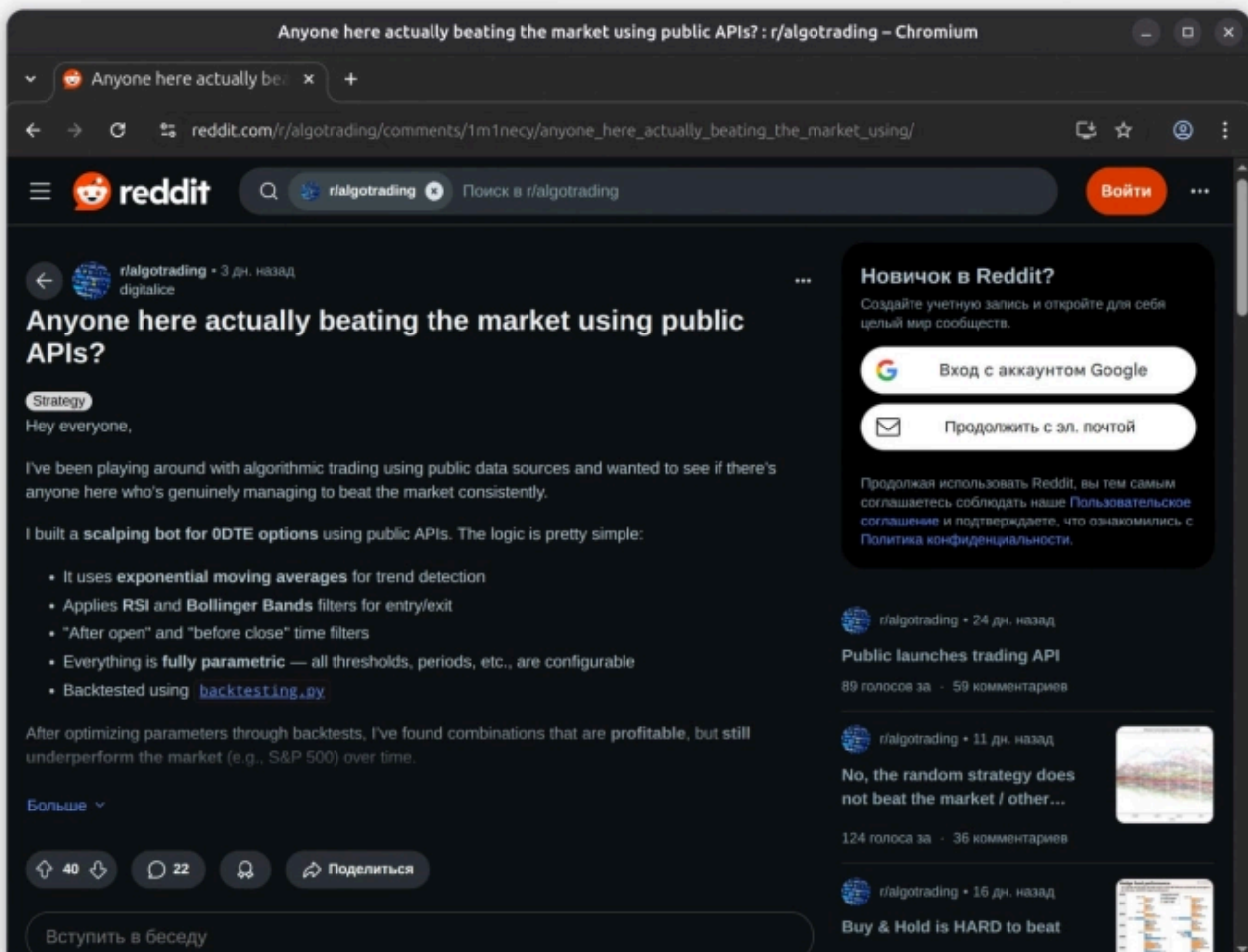


22 июля 2025, 05:58

+ Подписаться

Индикаторы - это ловушка? Что говорят алготрейдеры о "реальной альфе"

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?».



Откройте счёт в ВТБ Мои Инвестиции

Введите текст комментария

- 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**.

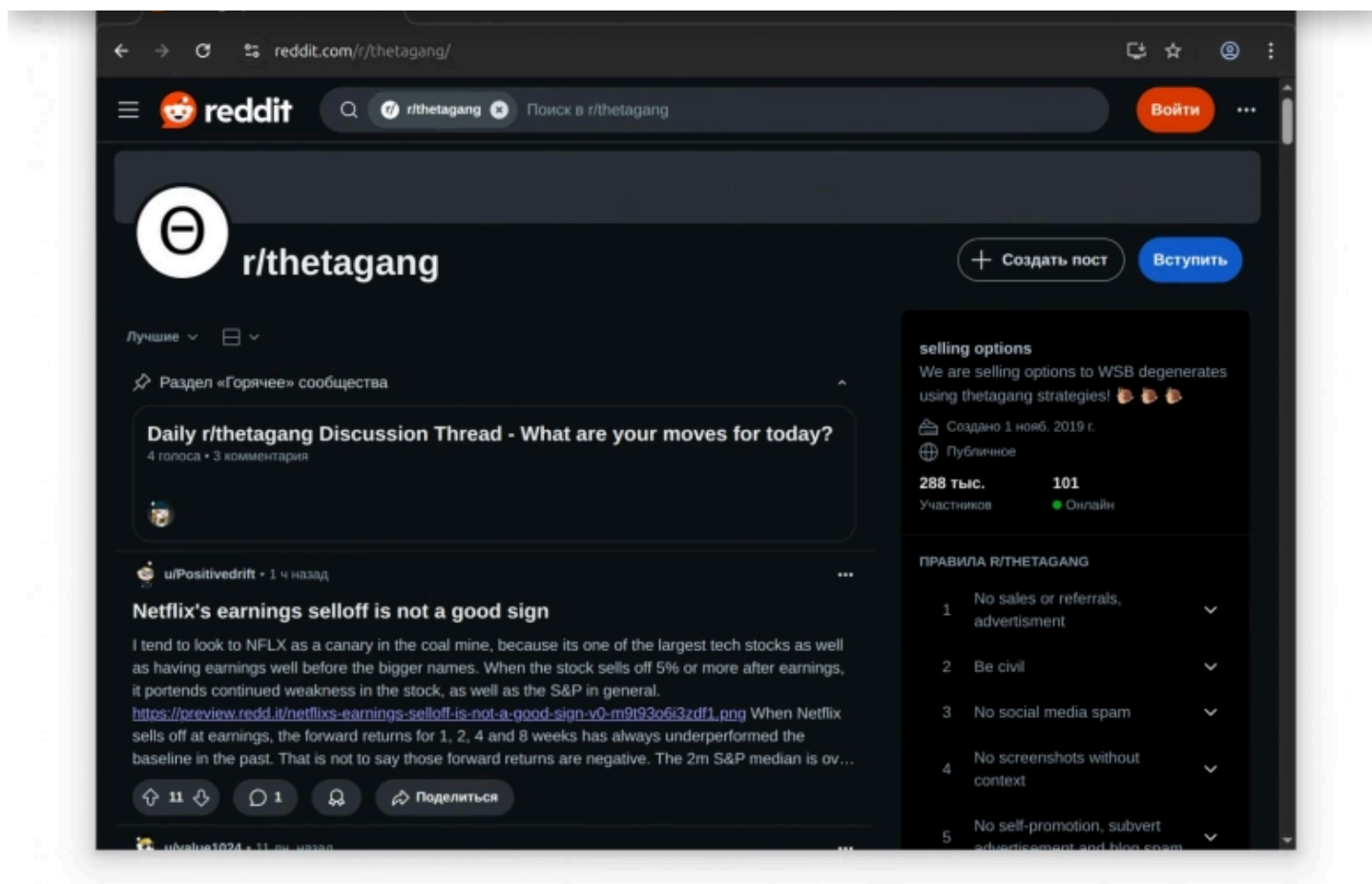
Почему стандартные индикаторы это дорога в никуда?

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)

Откройте счёт в ВТБ Мои Инвестиции



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

Откройте счёт в ВТБ Мои Инвестиции

превращаются в те самые «злые акулы» опционов. Вот 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

Автор: Михаил Шардин

 [Моя онлайн-визитка](#)

 [Telegram «Умный Дом Инвестора»](#)

22 июля 2025 года

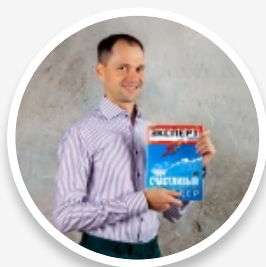
торговые роботы

5.5K 

☆ 4

💬 15

❤️ 16



Михаил Шардин

📍 Пермь

👤 257 📊 2 502

📅 с 23 января 2019

Откройте счёт в ВТБ Мои Инвестиции



22 июля 2025, 08:02

Всегда можно сказать «Вы просто не умеете готовить»... Таким образом накинуть тумана таинственности и скрытых умении 🤖

Думаю, так устроены люди, когда видят



ожидают



🤖 итп. итд.

Бредовость, но на самом деле с этим очень-очень сложно бороться.

Гипотезу о том что рынок всегда повторяется, или о том что рынок не меняется, поддерживает большинство, поддерживают книги, учителя, преподаватели. Идея максимально комфортна, она удобна мозгу, сразу представляешь всякое)) Думаю всем знакомо «Рынки не меняются, потому что люди не меняются. А люди не меняются потому что психология». Вот так хитро вырулили на психологию, хотя при чем тут психология? Разве сделки мы совершает закрытыми глазами чисто психологически? Мы все психи?))

Гипотеза о повторяемости рынка, о скрытых постоянных «неэффективностях», о каких то устойчивых «закономерностях» настолько популярна, настолько вбита в головы людей, что люди даже после череды потерь игнорирует реальность.

— Показать 3 ответа



ves2010

22 июля 2025, 08:08



Надо спрашивать за индикаторы тех кто уже нашел альфу и успешно торгует...

Мысль в том что альфа это та самая неэффективность рынка которая позволяет делать деньги. И при помощи технических средств в виде индикаторов эта альфа торгуется.

Т.е индикаторы не делают альфу... альфу делает сам рынок... вид индикатора это вариант инженерного решения...



Откройте счёт в ВТБ Мои Инвестиции

можно торговать долгоживущие производные на наждак. QQQ как база и все остальное.

— Показать 2 ответа



Assetman

22 июля 2025, 10:27



Алготрейдеры признали все таки, что классический рынок торговать не умеют?

— Показать 1 ответ



Ещё 5 комментариев

Напишите комментарий...



ОТПРАВИТЬ

Читайте на SMART-LAB

ЗА ПОЛУГОДИЕ, ЗАКОНЧИВШЕЕСЯ 30 ИЮНЯ 2025 ГОДА (НЕАУДИРОВАННЫЙ)
(в миллионах российских рублей, за исключением прибыли на акцию)

Показатель	За полугодие, закончившееся	
	30 июня 2025 года	30 июня 2024 года
ВЫРУЧКА	16	171 233
СЕБЕСТОИМОСТЬ РЕАЛИЗАЦИИ	17	(144 254)
ВАЛОВАЯ ПРИВЫЛЬ	26 989	41 627
Коммерческие, общедоступные и административные расходы	18	(35 723)
Прочие операционные доходы	19	1 983
Прочие операционные расходы		(115)
Изменение справедливой стоимости инвестиционной недвижимости		328
ОПЕРАЦИОННЫЙ УБЫТОК (ПРИВЫЛЬ)	(7 539)	3 720
Финансовые доходы	20	505
Финансовые расходы	20	(26 632)
УБЫТОК ДО НАЛОГОВ НА ПРИВЫЛЬ	(33 666)	(12 386)
Доходы на налоги на прибыль	8 527	2 036
Чистый убыток (чистая прибыль)	(25 139)	(10 350)

М.Видео - есть ли в мультивселенной компания, где миноритариям что-то достанется?

М.Видео меняет формат допэмиссии. Ранее акционеры одобрили допэмиссию до 500 млн новых акций по закрытой подписке — о...



Mozgovik

03:51



ДАЙДЖЕСТ ПО РЕЙТИНГОВЫМ ДЕЙСТВИЯМ В ВЫСОКОДОХОДНОМ СЕКТОРЕ, ПОРТФЕЛЕ PROBONDS ВДО И РОЗНИЧНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ОБЛИГАЦИЙ ЗА...

● ПАО «ЕВРОТРАНС» АКРА подтвердило кредитный рейтинг на уровне A-(RU) ПАО «ЕвроТранс» — один из крупнейших независимых топливных операторов на рынке Московского региона...

Откройте счёт в ВТБ Мои Инвестиции

рынков акции и облигации — это определенно благоприятное событие, но на практике рынок...



БКС Мир инвестиций

13.09.2025

Установите приложение Смартлаба:



RuStore



AppGallery



App Store



[О смартлабе](#)

[Реклама](#)

[Полная версия](#)



[Московская Биржа](#) является спонсором ресурса smart-lab.ru
Источник: [ПАО Московская Биржа](#)

Откройте счёт в ВТБ Мои Инвестиции