



Михаил Шардин

личный блог



07 октября 2024, 04:19

[+ Подписаться](#)

Как я решил вернуться в алготрейдинг после 10 летнего перерыва

Самое главное, что никакого отношения к слову алко это не имеет. В течении нескольких лет я торговал в связке программы технического анализа AmiBroker + торговый терминал QUIK через .tri и .trr файлы в основном на фьючерсах на срочном рынке. Не могу сказать что это было неудачным опытом, но со временем я узнал про распределение активов (Asset allocation) и понял что очень сложно соревноваться с бенчмарком в виде фондового индекса.

В теории это означает что можно купить индекс и забыть об этом, заниматься своими делами, бизнесом, семьёй — а индекс растёт (ну или падает, смотря какое время) и для этого не нужно прикладывать никаких действий. А за связкой AmiBroker + QUIK постоянно нужно было присматривать, следить не отвалился ли адаптер импорта через .tri файл. А ещё иметь несколько виртуальных машин с установленными копиями Windows на каждой виртуалке на одном физическом компьютере для разных брокеров. Возможна была установка только одной пары AmiBroker + QUIK на одну винду. Всё это мне не особо нравилось.

В 2024 году захотелось что-то лёгкое — без Windows и современное — через API интерфейс. Желательно бесплатное для пользователя. Несколько лет назад я уже пытался узнать появились ли у российских брокеров API для работы с ними, но так и не собрался. Этой осенью я стал активно искать информацию — какой брокер имеет АПИ для работы с физлицами. Не смог найти никакой сводной таблицы и нашёл только три варианта:

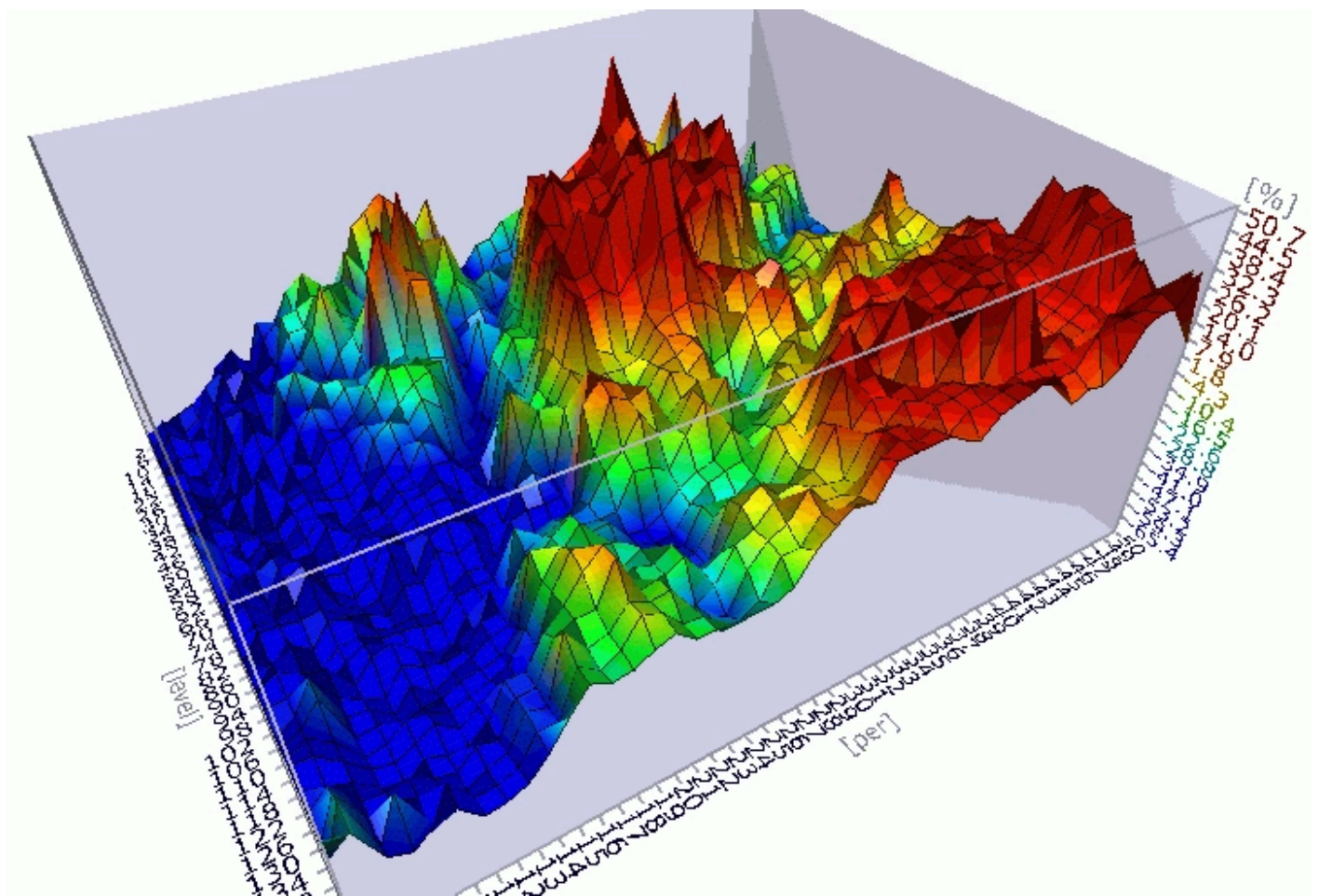
- [ФИНАМ](#)
- [Алор](#)
- [Тинькофф Инвестиции](#)
- (на полноту сведений не претендую и буду рад узнать ещё варианты брокеров с АПИ)

По субъективным причинам я выбрать работать с T-Bank Invest API (это бывший Тинькофф) через среду выполнения JavaScript Node.JS.

Немного моей истории, 2008-2012 годы: AmiBroker + QUIK

создавать свои собственные индикаторы и скрипты. Она также может интегрироваться с

Введите текст комментария



AmiBroker 3D Optimization Chart

В AmiBroker'е мне очень нравилась его функция 3D Optimization Chart. На мой взгляд она позволяла избежать переподгонки показателей под кривую истории. Оптимизация в бэк-тестере поддерживалась функцией `optimize`. Синтаксис этой функции был следующий:

```
<code>переменная = optimize("Описание", default , min , max , step );</code>
```

`переменная` — это обычная переменная их языка AFL, которой присваивается значение, возвращаемое функцией оптимизации. В режиме оптимизации функция `optimize` возвращает последовательные значения от минимума до максимума (включительно) с шагом. "Описание" — это строка, которая используется для идентификации переменной оптимизации и отображается как имя столбца в списке результатов оптимизации. `default` — это значение по умолчанию, которое оптимизирует возврат функции в режимах исследования, индикатора, комментария, сканирования и обычного бэктеста. `min` — минимальное значение оптимизируемой переменной, `max` — максимальное значение оптимизируемой переменной, `шаг` — это интервал, используемый для увеличения значения от минимума до максимума.

участникам фондового рынка доступа к биржевым данным в реальном времени. Она

Когда AmiBroker подключался к QUIK, он получал данные в реальном времени от торговой системы QUIK и использовал их для построения графиков, создания индикаторов и выполнения других аналитических задач. Пользователь мог также настроить систему так, чтобы она автоматически исполняла сделки через QUIK на основе определенных условий.

Для подключения AmiBroker к QUIK необходимо было установить соответствующий плагин или модуль. Это позволяло платформе AmiBroker получать данные от QUIK и обрабатывать их для дальнейшей работы.

Пример логов работы:

```
<code>09.10.2009 11:00:31: [2208:2212] Получено уведомление о выполнении транзакции  
09.10.2009 14:04:30: [2208:1172] Получено уведомление об отправке транзакции ,  
09.10.2009 14:04:30: [2208:2212] Получено уведомление о выполнении транзакции ,  
09.10.2009 15:10:10: [2208:1172] Завершен процесс отправления транзакций из файла
```

Насколько я понимаю AmiBroker (создан в Польше) уже несколько лет не обновляется: [последний выпуск в 2015 году, а обновления в 2017 году](#).

QUIKом я уже очень давно не пользовался, но по скриншотам на сайте я понял что программа внешне [за последние годы не особенно изменилась](#).

Ещё немного моей истории, 2008-2012 годы: КБ ПАУК и Technical Analysis of STOCKS & COMMODITIES

Раньше я был активным пользователем форума КБ ПАУК. Вот даже нашёл файл HTML файл с интересующей меня темой, который пролежал 20 лет:

Кур
Вредный крылат
Зарегистрирован: 15/11/2002
Ответы: 320
Накопления: с Киром

Как отличить работающую МТС от подогнанной под кривую
#21720 - 22/01/2004 16:34 [прикрепленные файлы](#) (848 загрузок)

Страниц в ветке: 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | >> (все)

Решил формализовать признаки, по которым работающая система отличается от подогнанной под кривую. Выделил 8 таких признаков и размещаю их в порядке убывания тяжести (от самых опасных к наименее опасным).

1. Первый признак. Система должна содержать в себе здравую идею, а не быть просто бессмысленной комбинацией индикаторов.

Рассмотрим пример конкретной системы:

```

Enter Long
LinRegSlope(C, opt1) > 0
AND
Cross(RSquared(C, opt2), opt3)

Enter Short
LinRegSlope(C, opt1) < 0
AND
Cross(RSquared(C, opt2), opt3)

Opt1 = 24 - 120 с шагом 12
Opt2 = 24 - 240 с шагом 12
Opt3 = 0.5 - 0.9 с шагом 0.1
  
```

Использовать на часовых графиках.

В данном случае используются 2 индикатора - линейной регрессии и R-квадрат. Вот и разберемся с ними подробнее.

Форум форекс кб паук <http://forex.kbpauk.ru/> (в 2024 уже не работает)

Я много изучал тему посвященную AmiBroker'у. И спрашивал там (привет Олег 000).

Выкладывал примеры из [бумажного журнала Technical Analysis of STOCKS & COMMODITIES](#).

Сейчас, в 2024 году форум недоступен, но если кто-то хочет ностальгии, то [нашёл его архивную копию](#).

Apprentice
Помощник
Зарегистрирован: 20/02/2003
Ответы: 2951
Накопления: в мастерской

KISS - простая система
#40544 - 11/07/2004 21:45 [прикрепленные файлы](#) (1223 загрузок)

Страниц в ветке: 1 | 2 | >> (все)

Известно, что на рынке Форекс существуют чётко выраженные циклы деловой активности - сессии, когда волатильность выше. Пример статистического расчёта таких циклов [можно увидеть здесь](#).

Теперь предположим следующее - пробой канала цен наиболее вероятен во время повышенной волатильности рынка - в сессии, а во время вне сессии наиболее вероятно боковое движение рынка или откат. Значит, во время повышения активности на рынке имеет смысл ставить ордера на пробой/переворот в обе стороны, а вне сессии - спать спокойно, если убытки ограничены стоп-лоссом, а то чтож это такое - сидеть перед монитором постоянно?

В ходе дальнейших исследований выяснилось, что такой показатель, как объём (Volume), который на форексе зачастую бывает именно тиковый, по некоторым инструментам коррелирует с волатильностью на 97-98%. Значит если брокер в датафайде даёт объём, то можно использовать для дальнейших расчётов именно его.

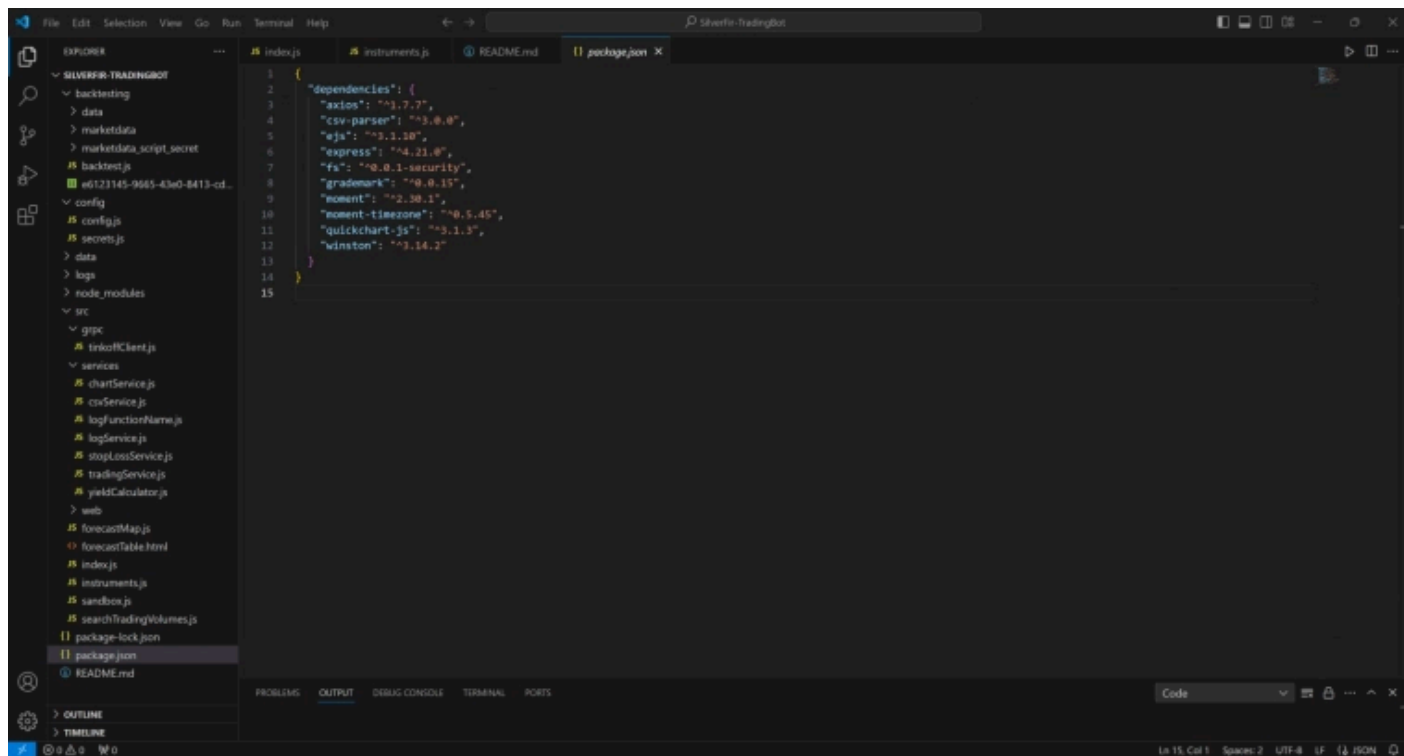
Теперь рассчитываем короткую среднюю от объёма, и длинную среднюю от объёма, сравниваем их, и - если короткая средняя больше длинной, то значит мы находимся в сессии, ставим ордера на пробой уровней в 2 стороны - если нет - то мы вне сессии, ставим только стоп лосс, если есть позиция.

Если начальная попытка верна, то вне сессии наблюдается боковой/откат, и ордера на пробой имеет смысл ставить по максимальному и минимальному значениям ценового коридора за период отката.

Для этого мы запоминаем точки пересечения короткой и длинной средней, и разницу между этими точками в барах используем для выбора максимального High и минимального Low для определения коридора.

Правда архивная копия немного бесполезна, потому что самые интересные разделы открывались только после входа по логину и паролю.

2024 год, сейчас: T-Bank Invest API + неофициальный SDK Node.JS. Описание функций торгового робота



Примерная структура робота

Осенью 2024 года решил написать торгового бота, создать структуру программы которая будет работать через API брокера.

Торговый робот должен содержать:

1. Список бумаг — с которым он будет работать.
2. Условие покупки.
3. Условие продажи.
4. CSV файл учёта
5. Управление деньгами — процент входа.
6. Логирование всех действий.
7. Отображение информации, скорее всего через веб-сервер.
8. Иметь модуль бектестинга.

T-Bank Invest API + Node.JS:

Решил пока не лезть в срочный рынок и попробовать поработать с самими оборотистыми

В этой статье я распишу как создал два модуля на node.js.

<code>searchTradingVolumes.js

Проект представлен на Гитхабе: <https://github.com/empenoso/SilverFir-TradingBot>.

SilverFir-TradingBot\src\grpc\tinkoffClient.js

```

17 constructor(apiToken) {
18   this.apiToken = apiToken;
19   // cepock peчeтaниe
20   this.apiUrl = "https://sandbox-invest-public-api.tinkoff.ru:443/rest/tinkoff-public-invest-api.contract.v1.";
21   // peчeтaниe cepock
22   // this.apiUrl = "https://invest-public-api.tinkoff.ru:443/rest/tinkoff-public-invest-api.contract.v1.";
23   // Пaсeчeнaя: https://russianinvestments.github.io/investAPI/url_difference/
24
25   this.headers = {
26     Authorization: `Bearer ${this.apiToken}`,
27     'Content-Type': 'application/json',
28   };
29
30   // Унивepсaльный мeтoд вызoвa кoнeчнeй тoчкe API Тинкoфф
31   async callApi(endpoint, payload = {}) {
32     try {
33       const response = await axios.post(`${this.apiUrl}${endpoint}`, payload, {
34         headers: this.headers,
35       });
36       // Вывoдeм oтвeт oт cepeвepa в кoнcoль, чтoбы лyчшe пoнять cтpyктyрy дaнныx
37       // logger.info('Oтвeт oт API T-Bank: \n ${JSON.stringify(response.data, null, 2)}');
38       return response.data;
39     } catch (error) {
40       logger.error('Oшeбкa зaпoсa ${endpoint}: ', error.response ? error.response.data : error.message);
41     }
42   }
43
44   // Пoлyчeниe cвeдeний пo инcтpyмeнтy
45   // https://russianinvestments.github.io/investAPI/marketdata/#getcandlesrequest
46   async getCandles(ticker, interval) {
47     try {
48       // Пoлyчaeм тeкyщyю дaтy и вpeмя
49       const now = new Date().toISOString();
50       // Дaтa нaчaлa в зaвecoимocти oт интepвaлa
51       const from = calculateFromDate(interval);
52     }
53   }
54
55   // ...
56
57   // ...
58
59   // ...
60
61   // ...
62
63   // ...
64
65   // ...
66
67   // ...
68
69   // ...
70
71   // ...
72
73   // ...
74
75   // ...
76
77   // ...
78
79   // ...
80
81   // ...
82
83   // ...
84
85   // ...
86
87   // ...
88
89   // ...
90
91   // ...
92
93   // ...
94
95   // ...
96
97   // ...
98
99   // ...
100  }

```

Модуль <code>tinkoffClient.js

— это специализированный клиент, разработанный для взаимодействия с T-Bank Invest API, российской брокерской платформой. Основная цель этого модуля — предоставить боту на основе Node.js, доступ к финансовым данным для алгоритмической торговли или анализа рынка.

Вот его функциональность:

Основные функции:

1. Авторизация и настройка:

- Модуль использует [API-токены для аутентификации](#).
- Он поддерживает как тестовую (песочницу), так и продовую среду, хотя по умолчанию он использует среду песочницы.
- Заголовки API включают необходимый токен авторизации и тип контента для JSON-коммуникации.

1. Универсальный механизм вызова API:

- Метод <code>callApi()
- служит гибкой утилитой для отправки POST-запросов на конечные точки API Tinkoff.

извлекает данные свечей для заданного финансового инструмента (тикера) за указанные интервалы.

Он вычисляет временной диапазон на основе предоставленного интервала и извлекает серию свечей из сервиса рыночных данных. Это необходимо для анализа рынка, технических индикаторов и торговых стратегий. Обработывает до 1000 свечей за запрос и обеспечивает регистрацию ошибок, если запрос не выполняется или возвращает пустые данные.

Зависимости и утилиты:

- Moment.js: Используется для форматирования дат и расчета временных диапазонов, что имеет решающее значение при работе с финансовыми данными за различные периоды времени.
- Axios: Обработывает HTTP-запросы к конечным точкам API.
- Службы ведения журналов: реализует настраиваемую систему журналов для вывода файлов и консоли, помогая в отладке и отслеживании операций.

SilverFir-TradingBot\src\searchTradingVolumes.js

```

54 } catch (error) {
55   logger.error('Ошибка при получении акций: ${error.message}');
56   throw error;
57 }
58 }
59
60 // Шаг 2: Получение свечей для каждой акции и суммирование объема за последние три месяца
61 async function getCandlesForStock(stock) {
62   try {
63     const today = moment().format('YYYY-MM-DD');
64     const threeMonthsAgo = moment().subtract(3, 'months').format('YYYY-MM-DD');
65
66     // // Логирование диапазона дат
67     // logger.info('Получение свечей для ак периода: ${threeMonthsAgo} - ${today}');
68
69     const candles = await tinkoffClient.getCandles(stock.figi, 'CANDLE_INTERVAL_DAY', threeMonthsAgo, today);
70
71     // logger.info('Данные первых трёх свечей ${stock.name}: \n ${JSON.stringify(candles.slice(0, 3), null, 2)}');
72     // logger.info('Данные последних трёх свечей ${stock.name}: \n ${JSON.stringify(candles.slice(candles.length-3, candles.length), null, 2)}');
73
74     // Суммируем объем за три месяца
75     const totalVolume = candles.reduce((sum, candle) => sum + parseInt(candle.volume), 0);
76
77     return {
78       ticker: stock.ticker,
79       figi: stock.figi,
80       totalVolume
81     };
82   } catch (error) {
83     logger.error('Ошибка при получении свечей для FIGI: ${stock.figi}, ошибка: ${error.message}');
84     throw error;
85   }
86 }
87
88 // Шаг 3: Основная функция для обработки volume и отображения 15 лучших результатов по объему
89 async function findTopStocksByTurnover() {
90   try {
91     // Получаем отфильтрованные акции
92

```

Модуль `searchTradingVolumes.js`

является частью SilverFir-TradingBot, разработан для определения акций на Московской бирже (MOEX) с наибольшими объемами торгов за последние три месяца. Нужен чтобы отбросить неликвид.

Вот подробный обзор функций модуля:

1. Фильтрация акций с MOEX (Московской биржи):

REAL_EXCHANGE_MOEX, гарантируя, что будут рассмотрены только акции Мосбиржи.

- Отфильтрованный список включает в себя важную информацию, такую как FIGI (глобальный идентификатор финансового инструмента), тикер, ISIN и название, которые затем регистрируются для отслеживания и анализа.
- Извлечение исторических данных по объему торгов:
 - Для каждой акции, идентифицированной на этапе фильтрации, модуль извлекает ежедневные данные свечей (OHLCV — открытие, максимум, минимум, закрытие, объем) с помощью T-Bank Invest API.
 - Он извлекает данные за последние три месяца, рассчитывая общий объем торгов за этот период.
 - Этот шаг имеет решающее значение для измерения рыночной активности и определения наиболее активно торгуемых акций.
 - Определение 15 лучших акций по объему:
 - После сбора данных по объему торгов модуль ранжирует все акции на основе их общего объема торгов за трехмесячный период.
 - Затем он выбирает 15 лучших акций, которые считаются имеющими самый высокий оборот, что делает их наиболее активными на рынке.
 - Ведение журнала и подготовка конфигурации:
 - 15 лучших акций регистрируются с соответствующими тикерами и идентификаторами FIGI для дальнейшего использования.
 - Эти данные также подготавливаются для включения в конфигурацию бота, что позволяет легко интегрировать их в другие части торговой стратегии.

Зависимости и утилиты:

- `Moment.js`: используется для манипулирования датами, в частности для генерации временных диапазонов (три месяца) для запросов исторических данных.
- `TinkoffClient`: это выделенный клиент бота для взаимодействия с API Tinkoff Invest, облегчающий коммуникацию, необходимую для получения данных по акциям и свечам.
- Служба пользовательского ведения журнала: модуль использует систему ведения журнала, которая регистрирует информацию как в консоли, так и во внешних файлах, помогая отслеживать фильтрацию акций, расчеты объема и любые ошибки, возникающие во время взаимодействия с API.

Результат выполнения скрипта `searchTradingVolumes.js`

```
<code>2024-10-06 07:25:48 [INFO]: Отфильтрованных акций 170 штук.
```

```
2024-10-06 07:25:50 [INFO]: Топ 15 акций по объему за последние три месяца: [
  {
```

```
    "ticker": "GRNT",
```

```
    "totalVolume": 7092179306
```



```
"ticker": "VTBR",
"figi": "BBG004730ZJ9",
"totalVolume": 5906896857
},
{
  "ticker": "MTLR",
  "figi": "BBG004S68598",
  "totalVolume": 5047115732
},
{
  "ticker": "UWGN",
  "figi": "BBG008HD3V85",
  "totalVolume": 4423660125
},
{
  "ticker": "RNFT",
  "figi": "BBG00F9XX7H4",
  "totalVolume": 1775061013
},
{
  "ticker": "EUTR",
  "figi": "TCS00A1002V2",
  "totalVolume": 1270913208
},
{
  "ticker": "SNGSP",
  "figi": "BBG004S681M2",
  "totalVolume": 1092911599
},
{
  "ticker": "GAZP",
  "figi": "BBG004730RP0",
  "totalVolume": 1027429605
},
{
  "ticker": "ROSN",
```

```
    "ticker": "SBER",
    "figi": "BBG004730N88",
    "totalVolume": 940111321
  },
  {
    "ticker": "SGZH",
    "figi": "BBG0100R9963",
    "totalVolume": 929574444
  },
  {
    "ticker": "AFLT",
    "figi": "BBG004S683W7",
    "totalVolume": 632806638
  },
  {
    "ticker": "VKCO",
    "figi": "TCS00A106YF0",
    "totalVolume": 595704137
  },
  {
    "ticker": "RUAL",
    "figi": "BBG008F2T3T2",
    "totalVolume": 542242519
  },
  {
    "ticker": "TATN",
    "figi": "BBG004RVFFC0",
    "totalVolume": 538004844
  }
]
```

2024-10-06 07:25:50 [INFO]:

Вставка в config.js:

2024-10-06 07:25:50 [INFO]:

securitiesToMonitorTikerArray: ["GRNT", "VTBR", "MTLR", "UWGN", "RNFT", "EUTR", "SNGSP

Для использования в скрипте `download_md.sh` в одну колонку:

```
TCS10A0JV532
BBG004730ZJ9
BBG004S68598
BBG008HD3V85
BBG00F9XX7H4
TCS00A1002V2
BBG004S681M2
BBG004730RP0
BBG004731354
BBG004730N88
BBG0100R9963
BBG004S683W7
TCS00A106YF0
BBG008F2T3T2
BBG004RVFFC0</code>
```

Итоги

Проект представлен на Гитхабе: <https://github.com/empenoso/SilverFir-TradingBot>. Новые модули будут загружаться по мере написания и тестирования.

Модуль `tinkoffClient.js`

для T-Bank Invest API представлен пока только частично.

Автор: [Михаил Шардин](#)

7 октября 2024 г.

торговые роботы

4.6K



7



71



33



Михаил Шар...

📍 Пермь

👤 53 📊 542

📅 с 23 января 2019

**Head of Algonaft'\$**

07 октября 2024, 06:24



T-bank?! 🤖 после этого да же читать дальше не стал.

**Михаил Шардин**

07 октября 2024, 06:51



Head of Algonaft'\$, а вариантов прямо очень много что ли?

**Head of Algonaft'\$**

07 октября 2024, 07:00



Михаил Шардин, да, вариантов алго очень много! В т.ч. без софта-прослойки! Да и Г_банк гавноброкер с повышенным комиссом... вы точно алго или все таки акло?

**Михаил Шардин**

07 октября 2024, 07:02



Head of Algonaft'\$, через квик?

**Head of Algonaft'\$**

07 октября 2024, 07:02



Михаил Шардин, еще раз... зачем вам софт прослойка? для чего?

**Михаил Шардин**

07 октября 2024, 07:05



Head of Algonaft'\$, я физ. лицо, выхожу с торговым алгоритмом на биржу, начинаю с небольших денег, не хочу платить за аренду и доступ. Какие мои варианты?

**Gambler <osaengine.ru>**

07 октября 2024, 11:16



Михаил Шардин, я собрал каталог на коленке со сборником решений для алготрейдинга

**Михаил Шардин**

07 октября 2024, 11:26



Gambler, негусто там инструментов

**Gambler <osaengine.ru>**

07 октября 2024, 12:43



Михаил Шардин, так это опенс сорс, и под МосБиржу)) Другого нет

Вот еще нашел недавно один сайт algotradinglib.com/en/soft/ там более бохато, но там всё вместе.

**T-800**

07 октября 2024, 13:00



Михаил Шардин, у Т-банка же комиссии конские, либо ваши рабочие ТЫ должны быть от дня, недели и выше. Сейчас комиссии много съедают. И да, по рынку входить не стоит. Только мейкерскими заявками.

**T-800**

07 октября 2024, 13:04



Михаил Шардин, кстати, 3D Optimization Chart есть в Ехеле, могу скинуть

**Михаил Шардин**

07 октября 2024, 13:20



T-800, было бы интересно

**T-800**

07 октября 2024, 13:34



Михаил Шардин, напомните мне завтра-послезавтра, я пока в отъезде. И емей напишите пришлю. В свое время я его взял у Константина Копыркина, а кто автор не знаю.

**УалиБакS**

сколько лет писать будете робота?

**Михаил Шардин**

07 октября 2024, 06:52



ВалиБакS, механизм уже написал — он работает. Логика самое главное.



0

**Михаил Шардин**

07 октября 2024, 06:54



ВалиБакS, с модулями бектестинга на Node.js проблемы — не могу подобрать рабочий.



0

**Среднеброд**

07 октября 2024, 10:37



Михаил Шардин, а почему Node.js?



0

**Михаил Шардин**

07 октября 2024, 11:27



Среднеброд, привычнее. Хотя чат гпт часто на питоне отвечает когда сложные вопросы.



0

**Среднеброд**

07 октября 2024, 13:06



Михаил Шардин, я пробовал использовать node.js. Не понравился, JS сомнительный с точки зрения надежности язык. Питон по факту годится только для тестов или для пред/пост обработки и анализа (там классные библиотеки), но я не понимаю тех, кто на питоне пишет сложное ПО (медленный, странный параллелизм, твоя программа через две недели как чужая выглядит и т.п.). Что-то «большое и светлое», которое должно работать годами 24/7 писал всегда на C#/Java/Kotlin.



+1

**Михаил Шардин**

07 октября 2024, 13:21



Среднеброд, больше вопрос привычки наверное.



+1



  +5 **Михаил Шардин**

07 октября 2024, 06:52



Дмитрий Овчинников, API это тоже готовое решение. А в квик через костыль.

  +1 **Дмитрий Овчинников**

07 октября 2024, 07:50



Михаил Шардин,
API это не решение а интерфейс.

  0 **Михаил Шардин**

07 октября 2024, 08:01



Дмитрий Овчинников, да.
Просто вы написали про готовые решения, но я не хотел пользоваться квиком. И смог найти только три АПИ от брокера.
Может быть можно как-то было выйти напрямую на биржу, но я начинаю с небольших денег и не хочу платить за аренду и доступ.
Ну и для Node.js вариантов не было. Поэтому стал писать.

  +2 **Дмитрий Овчинников**

07 октября 2024, 08:15



Михаил Шардин,
Все верно, нюанс только в том, что вы платите временем, правда меняете его на опыт, что неплохо.

  +1 **_rtx**

08 октября 2024, 09:25

  0 **Михаил Шардин**

07 октября 2024, 06:55



**amberfoxman**

07 октября 2024, 07:29

Дмитрий Овчинников, в своё время АПИ Тинькова показалось мне просто космическим инструментом, в хорошем смысле «не имеющим аналогов»

Купить, продать, узнать статус можно банально отправив запрос через, скажем, postman. Никаких промежуточных прокладок

У них, правда давно, были какие-то проблемы с несколькими счетами на аккаунте, не знаю, сейчас исправили или нет.

PS про autotrade впервые узнал, спасибо

PPS сам Т-АПИ сейчас не использую, хватает совсем простых инструментов, но с интересом слежу, что люди делают, например, впечатлила связка гугл-докс и т-апи, готовая табличка

**Среднеброд**

07 октября 2024, 10:30

Дмитрий Овчинников, а чего там изобретать? Если человек умеет программировать, то это не проблема.

**Дмитрий Овчинников**

07 октября 2024, 10:34

Среднеброд, алготрейдинг это не про программирование. ТС пишет, что вернулся в алго, но это не совсем так, точнее сказать совсем не так :)

**Среднеброд**

07 октября 2024, 10:40

Дмитрий Овчинников, ну я в курсе, но если уж за это берется программист... Я для себя не вижу проблем все вышеперечисленное переписать как мне было бы удобно. Это просто создание удобного окружения. Я смотрел инструментарий для алготрейдинга и он мне не понравился.

**Михаил Шардин**

07 октября 2024, 11:29

**_rtx**

08 октября 2024, 09:24

**Дмитрий Овчинников**

07 октября 2024, 13:25

**_rtx,**

это типичная ошибка выжившего, тем более давно минувших лет. сайт набит программистами и где же успешный успех?

**_rtx**

08 октября 2024, 09:24

**Reznor**

07 октября 2024, 15:29



Дмитрий Овчинников, это точно не ошибка выжившего. Это всё были очень оборотистые ХФТ алгоритмы, которые очень эффективно пылесосили срочный рынок, в основном фьючерс РТС.

**_rtx**

08 октября 2024, 09:24

**Reznor**

07 октября 2024, 18:22



_rtx, в целом согласен. Но по рынку бить иногда тоже бывает выгодно. Например когда появляется арбитражная возможность. Но тут надо быть первым)

**_rtx**

08 октября 2024, 09:24



**Дмитрий Овчинников**

07 октября 2024, 22:37

__rtx,
ох уж эти теоретики :)

**__rtx**

08 октября 2024, 09:24

**__rtx**

07 октября 2024, 21:18

**Путешественник**

07 октября 2024, 08:35

Понеслась п... да по кочкам. Приехали. Баффета в топку. Примука я красную таблетку!

**Crogall**

07 октября 2024, 09:45

неофициальный SDK Node.JS а потом эта чешуя сольет твои апи и сама для себя все продаст и купит.

**Михаил Шардин**

07 октября 2024, 11:30

Crogall, я обращаюсь к АПИ напрямую. Функции сам написал.

**DrManhattan**

07 октября 2024, 18:42

Михаил Шардин, а какая версия АМИ?
Легальная или кряк?

Молодец! Единственное мне кажется с брокером не угадали. Т-Банк по комиссу разорение всегда был. Сейчас вроде Алор API рекомендуют, тарифы гуманнее Т-Банка и вроде оно как стабильнее Финамовского. А сама реализация бота на чем пишется по мне не важна. Есть решения и на Qlua, C#, Python, R, Delphi и т.д. На чем лично легче и понятнее писать логику бота.

↩️ 👍 +3 💬



yurikon

07 октября 2024, 11:28



zam, поддерживаю. Если без клиентского софта брокера, то лучше посмотреть Alor API. Правда жизни, что вам придется написать свой урезанный AMI Broker. Времени на трейдинг скорее всего не останется.

↩️ 👍 0 💬



Михаил Шардин

07 октября 2024, 11:33



yurikon, и всё таки их только три по РФ — если без клиентского софта брокер. Вроде БКС ещё своё АПИ разрабатывает. Но на тестинг уже новых не берут.

↩️ 👍 0 💬



Михаил Шардин

07 октября 2024, 11:31



zam, с бектестингом пока проблема. На Node.js не могу найти библиотеки.

↩️ 👍 0 💬



zam

07 октября 2024, 12:20



Михаил Шардин, ТСлаб для бэктестинга вполне норм. Потом переносишь логику бота в свою платформу.

↩️ 👍 +1 💬



Треjder (Порутчик)

07 октября 2024, 12:03



лень читать «много букаф»))
Но плюсики, за старание)

↩️ 👍 0 💬

Ништяк. Желаю удачи!



Rostislav Kudryashov

07 октября 2024, 13:28



Не понял. Чем плох Quik + Lua как инструмент торговли?

Мои 6 брокеров не берут с меня за Quik ни копейки.

Так ли нужен ли доступ к живым торгам для тестирования? Когда-то была доступна история торгов в тиках даже для очереди заявок

www.qscalp.ru/download

erinrv.qscalp.ru/

www.qscalp.ru/store/qsh.pdf

PS Quik+Lua все «Основные функции»

”
Фильтрация акций с MOEX (Московской биржи):
Извлечение исторических данных по объему торгов:
Определение 15 лучших акций по объему
Ведение журнала и подготовка конфигурации
”

из статьи реализует элементарно.

«Без Windows» — это всё прямо на смартфоне? — Ну тогда да...

Хотя планшет-раскладушка с Windows не такая уж диковинка.



_rtx

08 октября 2024, 09:26



Михаил Шардин

07 октября 2024, 13:23



Rostislav Kudryashov, «Без Windows» — это прямо на сервере. На линуксе или более вероятно в докере.



Rostislav Kudryashov

07 октября 2024, 14:10



кармане или поставить на стол — прежде чем идти дальше — нужно пояснение.

”

С помощью T-Invest API вы можете:

Выставлять все виды торговых поручений на биржи — лимитные, рыночные, стоп-заявки.

Получать рыночные данные, в том числе исторические, в виде стриминга и через Unary-запросы.

Получать информацию по своему портфелю и его доходности.

Проверять алгоритмы торговли на исторических данных. Механизм проверки теорий разрабатывается клиентом самостоятельно.

”

Что в этом уникального и ранее небывалого?

PS Я когда-то делал замеры на Quik'e из Церих-капитал. Подтверждение заявки приходило через 0.1 сек после отправления и ещё через 0.1 сек она помещалась в таблице заявок Quik'a на моём ПК в Питере.

PPS Кстати, не так уж давно я видел предложения разместить свой виртуальный Quik со своим торговым роботом на Lua именно на сервере брокера.

**Михаил Шардин**

07 октября 2024, 15:12



Rostislav Kudryashov, а причём здесь уникальное и небывалое?

Нужен просто механизм который запустил и он стабильно работает вот и всё. Пусть у тебя дома или на удаленном сервере.

**Rostislav Kudryashov**

07 октября 2024, 15:31



Михаил Шардин, 15:12 Интересно, этот «механизм» даёт очередь заявок и таблицу обезличенных сделок с отметкой «покупка» или «продажа» как в Quik'e?

Если нет — никакое преимущество в скорости доступа на биржу не имеет смысла.

И есть ли в самом деле такое преимущество?

PS И как же это тебе не везло, что только теперь, после многих лет, ты добрался до брокера со стабильно работо-способным сервисом.

**BobbyKotick**

07 октября 2024, 13:29



Самое время — на мертвом рынке приходить в алго. Впрочем, мы же понимаем, что это просто рекламка Тинька.

BobbyKotick, 13:29 Эт-точно. Возвращаться в алго-торговлю есть смысл, когда осенит новая торговая идея, а не из-за новых торговых посредников.



Михаил Шардин

07 октября 2024, 15:10



BobbyKotick, конечно же это реклама (сарказм).
Я 5 лет не мог собраться, чтобы что-то такое подобное сделать.



myaucha

07 октября 2024, 18:31



Зачем так много тратить сил, чтобы найти самые ликвидные акции? Раз они ликвидные, значит в любой день по ним высокие обороты. Открыл Quik, отсортировал по оборотам, получил искомое.

Выставлять заявки это прекрасно, но надо еще контролировать их исполнение, снимать неисполненный остаток или всю часть. Следить, чтобы алгоритм повторно не выставлял заявки, а для этого нужно делать логические блокировки. Все алгоритмы должны работать независимо друг от друга, не нагружая систему. Там еще писать и писать. Энтузиазм легко может снова сойти на нет.

Когда смотрел тарифы брокеров, Тинькова сразу отбросил, посмотрев на комиссии на срочном рынке



Михаил Шардин

07 октября 2024, 18:14



myaucha, посмотрим



_rtx

08 октября 2024, 16:26



Михаил Шардин

08 октября 2024, 10:03



_rtx, я и не хотел в высокочастотный трейдинг, HFT, да и мне кажется API тинькова и не вывозит

**_rtx**

08 октября 2024, 16:26

**kvazar**

07 октября 2024, 22:10



удачи! молодец! главное чтобы не «задолбали дружескими похлопываниями») мне всегда было интересно почему для десктопа – «Отображение информации, скорее всего через веб-сервер.»? и какой информации?

**Михаил Шардин**

08 октября 2024, 04:23



Скрипт будет выполняться на сервере. Чтобы визуальнo проконтролировать процесс надо будет зайти на локальную веб страничку, где буду выводить интересные параметры.

Вроде вот такого: daily.dev/blog/setup-nodejs-express-project-a-beginners-guide
Извините на русском не смог сразу найти

**BlackDriller**

21 октября 2024, 08:56



„Насколько я понимаю AmiBroker (создан в Польше) уже несколько лет не обновляется: [последний выпуск в 2015 году, а обновления в 2017 году.](#) ”

Неправильно понимаете, программа обновляется, последний релиз был в августе 2024
<https://www.amibroker.com/news.html>



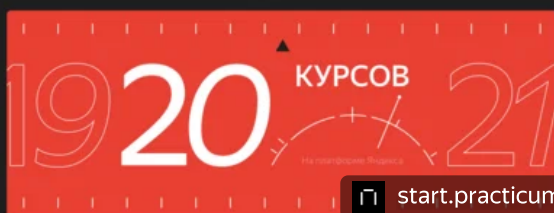


ОТПРАВИТЬ

РЕКЛАМА · 16+ 11

Я Практикум

Пробуйте и бросайте,
чтобы сделать выбор
по душе



start.practicum.yandex

Курсы
по программированию
от Яндекса бесплатно



РЕКЛАМА

Яндекс Плюс | S7 Airlines

ЛОВИТЕ 300 МИЛЬ S7 AIRLINES

С опцией «Путешественникам» от Яндекс Плюса



Акция по 26.12.24 г. Подробности: s7.ru/300miles.
7 дней доп. опции «Путешественникам» бесплатно, далее актопрореление — 200 руб./
мес. Условия: уа сс/б, есть ограничения: уа сс/б. Только для пользователей с активной
подпиской Яндекс Плюс (или её эквивалент), ранее не оформлявших указанную
опцию. Предложение только на сайте plus.yandex.ru/travel/target-travel-gate.

18+

Установите приложение Смартлаба:



Google Play



App Store



AppGallery



RuStore



О смартлабе

Реклама

Полная версия



Московская Биржа является спонсором ресурса smart-lab.ru