

**Михаил Шардин**

личный блог



09 апреля 2025, 09:38

[+ Подписаться](#)

## CAN SLIM, Баффетт и Weiss на практике: можно ли повторить стратегии гуру с помощью своего скринера?

Хочу поделиться своим опытом разработки скринера и бектестера для анализа акций на основе фундаментальных данных. Это не только автоматизация, но и способ глубже разобраться в инвестиционных стратегиях, которые можно заложить в алгоритм.

Фундаментальный анализ — это метод оценки акций, основанный на финансовых показателях компаний, таких как прибыль, выручка, коэффициенты ликвидности и другие экономические параметры. В отличие от технического анализа, который фокусируется на движении цен, фундаментальный анализ помогает определить реальную стоимость компании и ее перспективы в долгосрочной перспективе.

При этом фундаментальный анализ не так популярен среди частных инвесторов, как технический анализ, поскольку требует глубокого изучения отчетности, макроэкономических факторов и финансовых коэффициентов.

Хочу создать собственный скринер и бектестер для анализа акций по фундаментальным показателям. Чтобы сделать это правильно, нужно понимать не только программирование, но и сам предмет — фундаментальный анализ. В этой статье я разбираюсь какие вообще существуют подходы, а также ищу источники данных.

Буду использовать для анализа сразу два рынка: США и РФ.

- **США:** здесь торгуется более 10 тысяч компаний, а объем открытых данных позволяет глубже изучать инвестиционные стратегии.
- **РФ:** рынок значительно меньше (всего несколько сотен компаний), но, поскольку мы живем здесь, он остается актуальным для анализа и инвестиций.

В идеале хочу использовать лучшие практики фундаментального анализа на глобальном рынке и адаптировать их к российским реалиям.

**БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ****УСПЕТЬ КУПИТЬ**

Введите текст комментария



Обложился книгами

## Обзор книжных стратегий от Американской ассоциации частных инвесторов

Американская ассоциация частных инвесторов (AAII) — это независимая некоммерческая организация, которая помогает частным инвесторам принимать обоснованные решения. Она предлагает исследования, аналитические материалы и инструменты, включая формализованные наборы готовых стратегий по книгам известных инвесторов. У них это называется Guru Screens и это подборка из 42 инвестиционных стратегий.

**БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ**



**УСПЕТЬ КУПИТЬ**

Кликните стратегию, которую хотите протестировать, адаптированную к современным реалиям.

Я выбрал пять стратегий, основанных на трудах известных инвесторов:

- Weiss Blue Chip Div Yield – ориентирована на дивидендные акции крупных компаний.
- Lakonishok – стратегия, основанная на стоимостном инвестировании.
- Wanger (Revised) – фокусируется на малых компаниях с потенциалом роста.
- O'Neil's CAN SLIM Revised 3rd Edition – сочетает фундаментальный и технический анализ.
- Buffett: Hagstrom – следует принципам Уоррена Баффетта, отбирая недооцененные компании с высоким потенциалом.

## Weiss Blue Chip Div Yield

Guru  
Geraldine Weiss

Factors  
Yield, Value, Quality

Strategy Performance

Passing Companies

Learn How To Do It

### Strategy Performance



Export Performance Data

|             | Since Inception | YTD Return | 5-Year Return | 10-Year Return | 15-Year Return | 20-Year Return |                           |      |
|-------------|-----------------|------------|---------------|----------------|----------------|----------------|---------------------------|------|
| Performance | 8.9%            | -4.7%      | 6.5%          | 5.4%           | 9.0%           | 7.6%           | Avg # of Monthly Holdings | 1    |
| +/- S&P 500 | +2.2            | -2.6       | -7.4          | -5.0           | -2.5           | -0.4           | Turnover %                | 6.5% |

Performance data as of 2/28/2025.

**БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ**



**УСПЕТЬ КУПИТЬ**

высокими дивидендами, а также дивидендных батсов, известной как «первый год дивидендного инвестирования». Стратегия основана на выборе недооцененных компаний с высокой дивидендной доходностью, стабильным ростом дивидендов и сильной финансовой надежностью.

Критерии стратегии:

1. Только крупные американские компании (blue chips).
2. Дивиденды:
  - Выплаты не менее 25 лет.
  - Рост дивидендов в 5 из последних 12 лет.
  - Коэффициент выплат  $\leq 20\%$ .
3. Финансовая устойчивость:
  - Отношение долга к капиталу  $\leq 20\%$  (коммунальные компании — 50%).
  - Текущая ликвидность  $> 2$ .
  - Рост EPS в 7 из последних 12 лет.
4. Оценка стоимости: Продажа при снижении дивидендной доходности до минимума или ухудшении финансов.

Я настроил критерии [на скринере finviz.com](#).

Допущения: без истории и рейтингов, только текущий момент.

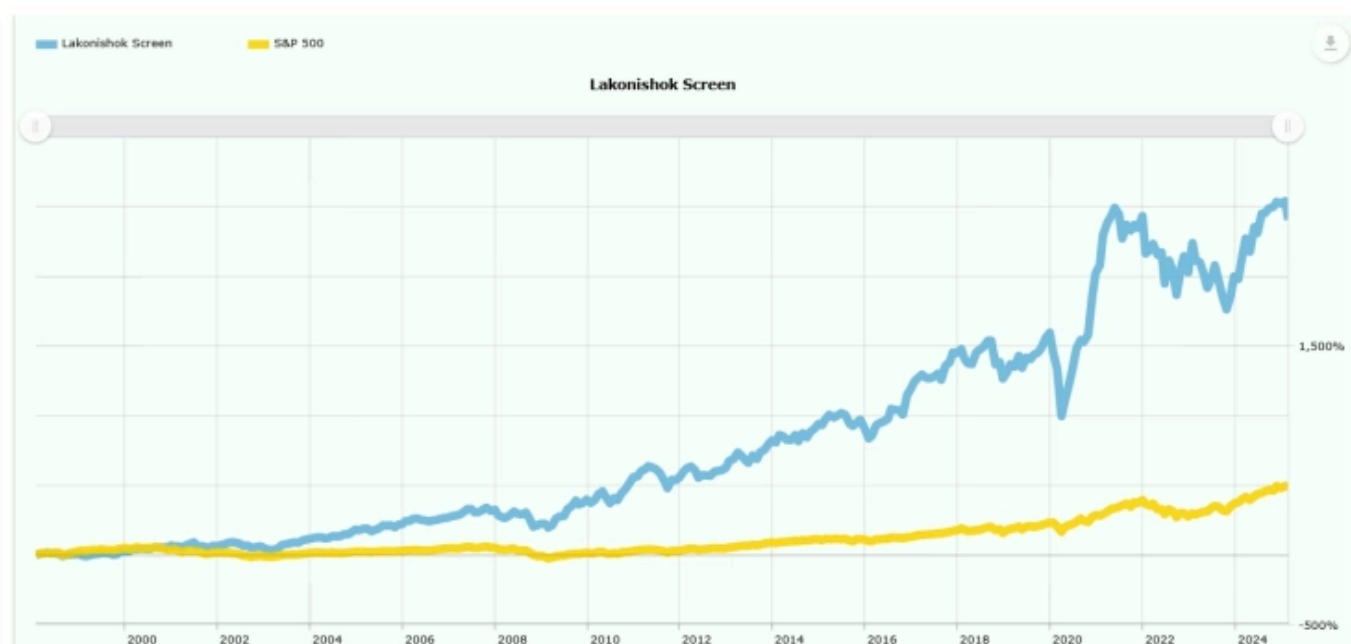
**Lakonishok**

**БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ**



**УСПЕТЬ КУПИТЬ**

## Strategy Performance


[Export Performance Data](#)

|             | Since Inception | YTD Return | 5-Year Return | 10-Year Return | 15-Year Return | 20-Year Return |                           |         |
|-------------|-----------------|------------|---------------|----------------|----------------|----------------|---------------------------|---------|
| Performance | 12.6%           | -4.5%      | 11.9%         | 8.8%           | 11.4%          | 11.4%          | Avg # of Monthly Holdings | 20      |
| +/- S&P 500 | +5.9            | -2.4       | -2.0          | -1.6           | -0.1           | +3.4           | Turnover %                | -167.9% |

Performance data as of 2/28/2025.

Стратегия Lakonishok ориентирована на поиск недооцененных компаний, которые временно не пользуются популярностью у инвесторов, но демонстрируют признаки роста. Основная идея заключается в том, что рынок часто переоценивает «звездные» акции и недооценивает компании, которые испытывали трудности, но начинают восстанавливаться. Метод основан на анализе четырех ключевых мультипликаторов, а также динамики цены и прогнозов аналитиков.

Для отбора акций используются следующие параметры:

- Цена акции ниже средних значений по отрасли по одному из показателей: P/B, P/CF, P/E или P/S.
- Относительная сила за 6 месяцев > 0 (признак роста)

**БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ**



**УСПЕТЬ КУПИТЬ**



- Рост консенсус-прогноза аналитиков за последние 6 месяцев.

Подход Lakonishok позволяет находить недооцененные компании, способные демонстрировать высокую доходность в долгосрочной перспективе.

Я настроил [критерии на скринере](#) finviz.com.

Допущения: выбраны не верхние проценты по рынку, а заданы фиксированные значения.

## Wanger (Revised)

Guru  
Ralph Wanger

Factors  
Value, Size, Growth

Strategy Performance   Passing Companies   Learn How To Do It

### Strategy Performance



Export Performance Data

|             | Since Inception | YTD Return | 5-Year Return | 10-Year Return | 15-Year Return | 20-Year Return |                           |       |
|-------------|-----------------|------------|---------------|----------------|----------------|----------------|---------------------------|-------|
| Performance | 9.8%            | 6.2%       | 19.2%         | 9.9%           | 11.9%          | 9.8%           | Avg # of Monthly Holdings | 2     |
| +/- S&P 500 | +3.1            | +8.3       | +5.3          | -0.5           | +0.4           | +1.8           | Turnover %                | 16.6% |

Performance data as of 2/28/2025.

Стратегия Wanger (Revised) впервые представленная в 1997 году, направлена на снижение

БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ

УСПЕТЬ КУПИТЬ

---

долгосрочное инвестирование и позволяет находить перспективные активы среди компаний с малой капитализацией, избегая завышенно оцененных и нестабильных бизнесов.

#### Критерии стратегии

- Рыночная капитализация: от \$100 млн до \$2 млрд.
- Рост прибыли: ожидаемый рост не менее 15% в год на ближайшие 5 лет.
- Оценка: P/E < 30, P/S < 3.
- Финансовая устойчивость: долг/собственный капитал < 1, текущая ликвидность > 1.

Я настроил [критерии на скринере finviz.com](#).

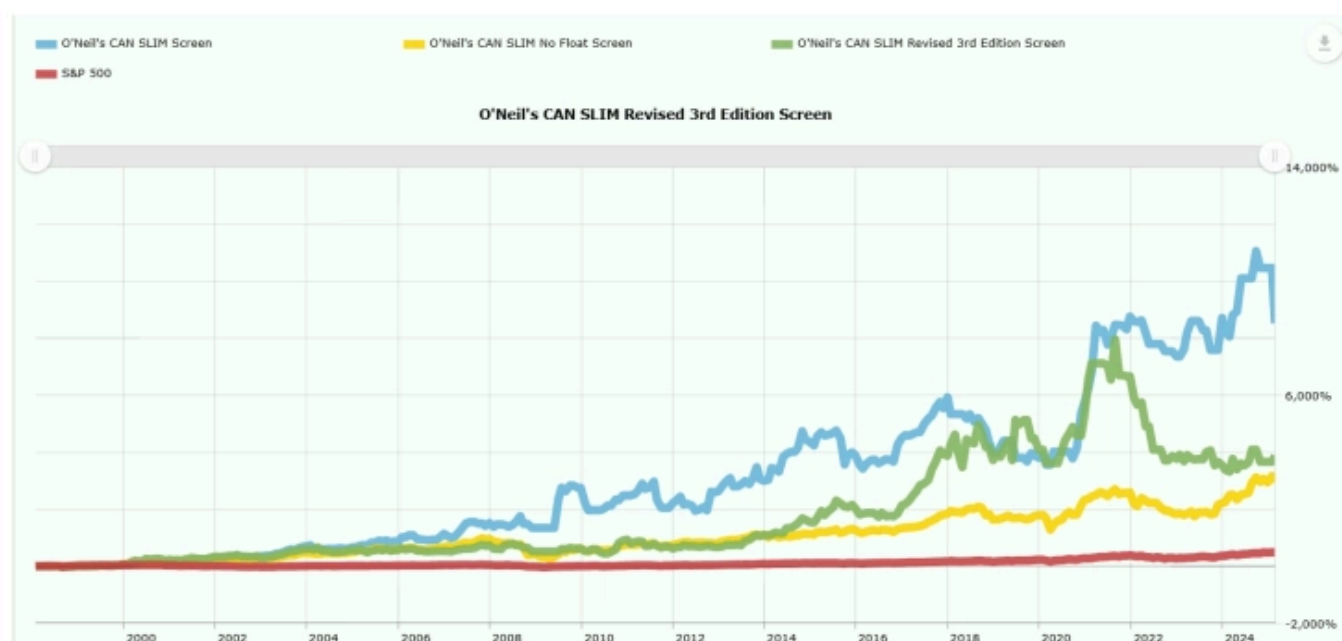
### O'Neil's CAN SLIM Revised 3rd Edition

**БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ**



**УСПЕТЬ КУПИТЬ**

## Strategy Performance


[Export Performance Data](#)

|             | Since Inception | YTD Return | 5-Year Return | 10-Year Return | 15-Year Return | 20-Year Return |                           |       |
|-------------|-----------------|------------|---------------|----------------|----------------|----------------|---------------------------|-------|
| Performance | 14.5%           | 5.5%       | 1.3%          | 8.3%           | 13.0%          | 9.0%           | Avg # of Monthly Holdings | 1     |
| +/- S&P 500 | +7.8            | +7.6       | -12.6         | -2.1           | +1.5           | +1.0           | Turnover %                | 53.9% |

Performance data as of 2/28/2025.

Методология CAN SLIM, разработанная Уильямом О'Нилом, сочетает фундаментальный и технический анализ для выявления акций с наибольшим потенциалом роста. Эта стратегия ориентирована на быстрорастущие компании, которые уже демонстрируют высокие показатели доходности. Она учитывает не только финансовые показатели, но и рыночные тенденции, что делает ее одной из самых популярных среди частных инвесторов.

Критерии стратегии:

- Текущие доходы: рост прибыли за три года — не менее 25%.
- Годовая прибыль: квартальный рост прибыли — минимум 25%.
- Инновации: наличие новых продуктов или услуг, способных стимулировать рост.

**БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ**



**УСПЕТЬ КУПИТЬ**



- Тренд рынка: покупки только в условиях общего бычьего тренда.

Я настроил [критерии на скринере](#) finviz.com.

## Buffett: Hagstrom

Guru  
Warren Buffett

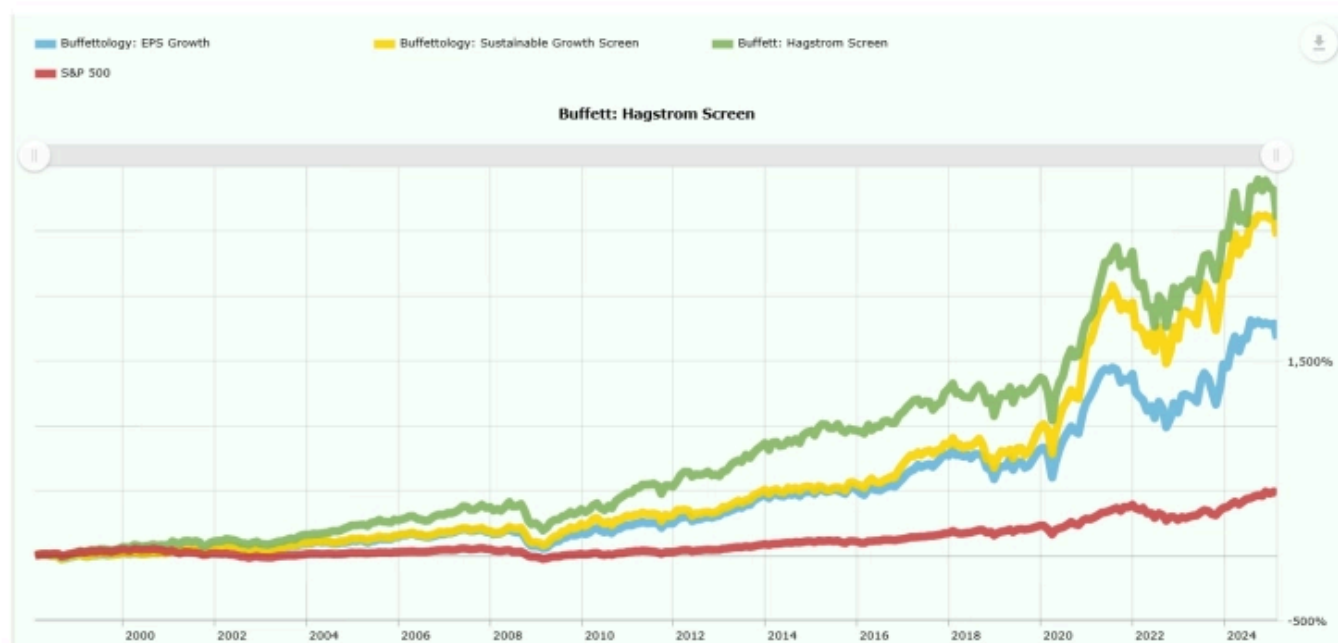
Factors  
Value, Quality, Growth

Strategy Performance

Passing Companies

Learn How To Do It

### Strategy Performance



Export Performance Data

|             | Since Inception | YTD Return | 5-Year Return | 10-Year Return | 15-Year Return | 20-Year Return |                           |       |
|-------------|-----------------|------------|---------------|----------------|----------------|----------------|---------------------------|-------|
| Performance | 12.9%           | -8.4%      | 14.6%         | 9.5%           | 12.5%          | 10.9%          | Avg # of Monthly Holdings | 30    |
| +/- S&P 500 | +6.2            | -6.3       | +0.7          | -0.9           | +1.0           | +2.9           | Turnover %                | 15.4% |

Performance data as of 2/28/2025.

Эта стратегия основана на принципах инвестирования Уоррена Баффетта, описанных в книге Роберта Хагстрема. Она ориентирована на поиск недооцененных компаний с устойчивым ростом, высокой рентабельностью и разумной долговой нагрузкой. В отличие от краткосрочного трейдинга, подход Баффетта предполагает долгосрочное владение качественными активами.

**БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ**



**УСПЕТЬ КУПИТЬ**

- **Рост прибыли на акцию:** минимум 10% – показатель устойчивого развития.
- **Соотношение долга к капиталу:** не более 50% – ограничение финансовых рисков.
- **P/E:** не выше 20 – избежание переоцененных активов.

Я настроил [критерии на скринере finviz.com](#).

### Краткие выводы по стратегиям от гуру

Конечно всё это не рекомендации, а просто повод задуматься о том, что существуют разные стратегии и множество из них публичны.

Не все стратегии можно достоверно повторить на бесплатных скринерах, потому что часть нужных параметров отсутствует, но это не повод опускать руки и можно подробнее познакомиться с методами и логикой, которые авторы используют.

И конечно надо проверить заинтересовавшую вас стратегию на истории – как выборки составленные в прошлом показывали результаты в настоящем.

Для этого я и хочу написать свой скринер и бэктестер.

## Выбор самых важных параметров для оценки акций

Это моя субъективная оценка, разбито по категориям [как в скринере Яху Финанс](#):

### 1. Market Data (рыночные данные)

- **Price (End of Day)** – цена на конец дня
- **Market Cap (Market Capitalization)** – рыночная капитализация  
Общая стоимость компании на фондовом рынке, определяется как цена акции × количество акций.

### 2. Ratios (финансовые коэффициенты)

Эти коэффициенты помогают инвесторам оценить стоимость компании и её финансовую устойчивость.

- **ROA (Return on Assets) – Рентабельность активов**  
Показывает, насколько эффективно компания использует свои активы для получения прибыли.  
**= > 5%:** эффективно использующая свои активы компания должна генерировать не менее 5% прибыли. Низкий ROA может означать плохое использование активов или неэффективную деятельность.

- **ROE (Return on Equity) – Рентабельность собственного капитала**

**БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ**



**УСПЕТЬ КУПИТЬ**

- **Debt/Equity (Debt-to-Equity Ratio) – Коэффициент долг/капитал**

Соотношение общего долга к собственному капиталу.

**=**  $< 1$ , в идеале  $< 0,5$ : более низкий коэффициент указывает на то, что компания не слишком полагается на заемные средства для финансирования операций, что снижает финансовый риск. Компании с **D/E**  $> 1$  имеют высокую долговую нагрузку, что может быть рискованно в условиях роста процентных ставок.

- **Current Ratio – Коэффициент текущей ликвидности**

Показывает способность компании погашать краткосрочные обязательства.

**=**  $1,5 - 3$ : гарантирует, что компания может выполнить свои краткосрочные обязательства. Коэффициент ниже  $1,5$  может указывать на проблемы с ликвидностью, тогда как коэффициент выше  $3$  может указывать на неэффективное распределение капитала.

- **Gross Profit Margin – Валовая рентабельность**

Доля валовой прибыли в выручке компании. Чем выше, тем эффективнее производство.

**=**  $> 30\%$ : более высокая валовая маржа означает, что у компании сильная ценовая политика и эффективность затрат. Это указывает на конкурентное преимущество в производстве или услугах.

- **Dividend Yield – Дивидендная доходность**

Процент дивидендов к цене акции. Чем выше, тем больше компания платит акционерам.

**=**  $> 2\%$ , но  $< 8\%$ : умеренная дивидендная доходность обеспечивает доход. Чрезвычайно высокая дивидендная доходность в долларах ( $> 8\%$ ) может указывать на падение цены акций из-за бизнес-рисков.

### 3. Financials – Income Statement (финансовые показатели – Отчёт о прибылях и убытках)

Этот раздел отражает финансовые результаты компании за определённый период.

- **EPS Growth (Earnings Per Share Growth) – Рост прибыли на акцию**

Показывает рост прибыли на акцию по сравнению с предыдущим периодом.

**=**  $> 10\%$  год за годом: растущие прибыли указывают на здоровый и расширяющийся бизнес. Компании с постоянным ростом EPS привлекают инвесторов и оправдывают более высокую оценку с течением времени.

- **Sales Growth (Revenue Growth) – Рост выручки**

Изменение выручки компании по сравнению с прошлым периодом. Высокий рост указывает на развитие компании.

**БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ**



**УСПЕШЬ КУПИТЬ**

- **Operating Margin (Operating Profit Margin) – Операционная рентабельность**

Процент выручки, остающийся после вычета операционных расходов (зарплаты, аренда, амортизация и т.д.).

➡ > 10%, в идеале > 15%: более высокая операционная маржа указывает на эффективную работу и лучший контроль над расходами. Она также обеспечивает подушку безопасности во время экономических спадов.

- **Net Profit Margin – Чистая рентабельность**

Процент выручки, остающийся после вычета всех расходов, включая налоги и проценты.

➡ > 10%, в идеале > 15%: высокая чистая маржа показывает сильную прибыльность после учета всех расходов, включая проценты и налоги.

## 4. Valuation (оценка компании)

Раздел оценивает эффективность использования активов и капитала.

- **P/E (Price-to-Earnings Ratio) – Коэффициент цена/прибыль**

Показывает, во сколько раз цена акции превышает прибыль на акцию (EPS).

➡ < 15 (в идеале от 8 до 12): более низкий P/E предполагает, что акции недооценены относительно их прибыли. P/E < 5 может сигнализировать о финансовых трудностях, тогда как P/E > 20 может указывать на переоценку компании.

- **P/B (Price-to-Book Value Ratio) – Коэффициент цена/балансовая стоимость**

Отношение рыночной цены акции к балансовой стоимости компании.

➡ < 1,5, в идеале < 1: P/B ниже 1 предполагает, что акция торгуется ниже своей балансовой стоимости, что указывает на потенциальную недооценку. Однако акции с низким P/B могут быть и в отраслях, находящихся в упадке.

- **P/S (Price-to-Sales Ratio) – Коэффициент цена/выручка**

Соотношение рыночной капитализации к выручке компании.

➡ < 2, в идеале < 1: более низкий P/S означает, что выручка компании не переоценена рынком.

- **Price/Cash (Price-to-Cash Flow Ratio, P/CF) – Цена к денежному потоку**

Показывает, сколько инвесторы платят за каждый доллар денежных потоков компании.

➡ < 10: более низкий P/CF означает, что инвесторы платят меньше за каждый доллар денежного потока, что делает акции более привлекательными.

## API для поиска фундаментальных данных по России

Получение фундаментальных данных по российскому фондовому рынку — непростая

**БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ**



**УСПЕТЬ КУПИТЬ**

## T-Invest API <https://russianinvestments.github.io/investAPI/swagger-ui/#/>

T-Invest API предоставляет данные о российских акциях, включая фундаментальные показатели. Но **выдаёт только текущие — истории нет**, для скринера это АПИ не подходит.

Запрос: [/tinkoff.public.invest.api.contract.v1.InstrumentsService/GetAssetFundamentals](https://tinkoff.public.invest.api.contract.v1.InstrumentsService/GetAssetFundamentals)

Пример ответа:

```
<code class="json">GetAssetFundamentalsResponse(fundamentals=[
StatisticResponse(asset_uid='40d89385-a03a-4659-bf4e-d3ecba011782',
currency='RUB',
market_capitalization=6878249241240.0,
high_price_last_52_weeks=330.45,
low_price_last_52_weeks=219.2,
average_daily_volume_last_10_days=65639361.43,
average_daily_volume_last_4_weeks=60348494.76,
beta=0.8,
free_float=0.48,
forward_annual_dividend_yield=0.0,
shares_outstanding=21586948000.0,
revenue_ttm=8676400000000.0,
ebitda_ttm=0.0,
net_income_ttm=1580300000000.0,
eps_ttm=73.21,
diluted_eps_ttm=0.0,
free_cash_flow_ttm=0.0,
five_year_annual_revenue_growth_rate=0.0,
three_year_annual_revenue_growth_rate=33.48,
pe_ratio_ttm=4.35,
price_to_sales_ttm=0.79,
price_to_book_ttm=0.96,
price_to_free_cash_flow_ttm=0.0,
total_enterprise_value_mrq=0.0,
ev_to_ebitda_mrq=0.0,
net_margin_mrq=0.0,
net_interest_margin_mrq=0.0,
roe=23.36,
```

**БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ**



**УСПЕТЬ КУПИТЬ**

```
total_debt_to_ebitda_mrq=0.0,
free_cash_flow_to_price=0.0,
net_debt_to_ebitda=0.0,
current_ratio_mrq=0.0,
fixed_charge_coverage_ratio_fy=0.0,
dividend_yield_daily_ttm=10.45,
dividend_rate_ttm=33.3,
dividends_per_share=33.3,
five_years_average_dividend_yield=8.36,
five_year_annual_dividend_growth_rate=0.0,
dividend_payout_ratio_fy=45.49,
buy_back_ttm=0.0,
one_year_annual_revenue_growth_rate=55.49,
domicile_indicator_code='',
adr_to_common_share_ratio=0.0,
number_of_employees=0.0,
ex_dividend_date=datetime.datetime(2024,7,11,0,0,tzinfo=datetime.timezone.utc),
fiscal_period_start_date=datetime.datetime(1970,1,1,0,0,tzinfo=datetime.timezone),
fiscal_period_end_date=datetime.datetime(1970,1,1,0,0,tzinfo=datetime.timezone.utc),
revenue_change_five_years=181.25,
eps_change_five_years=87.02,
ebitda_change_five_years=0.0,
total_debt_change_five_years=0.0,
ev_to_sales=0.0)]]</code>
```

**FinanceMarker.ru API** <https://financemarker.ru/api/swagger-ui/>

Для частных лиц только 400 запросов в день.

Исторический период, по основной отчетности с 2012 года.

Гранулярность данных зависит от частоты выпущенных компанией отчетов, если компания выпускает отчетность по квартально – то квартал, по полугодиям, то полугодие. По РСБУ отчетности – чаще всего квартал. Это относится к категории – reports.

Мультипликаторы (ratios) рассчитываются только в годовом значении и ТТМ (последние 12 месяцев и текущая капитализация).

Запрос: /fm/v2/stocks/{exchange}:{code} Получить данные по компании

Пример ответа:

**БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ**



**УСПЕТЬ КУПИТЬ**



```
"current_ratio": 0.93,  
"debt_equity": 0.63,  
"debt_ratio": 0.39,  
"debtebitda": 0.1,  
"dpr": null,  
"ebitda_margin": 22.43,  
"ev_ebit": 4.18,  
"evebitda": 3.59,  
"evs": 0.81,  
"exchange": "MOEX",  
"gross_margin": null,  
"interest_coverage": 14.79,  
"month": 6,  
"net_margin": 15.29,  
"net_working_capital": 0.93,  
"netdebt_ebitda": -0.19,  
"operation_margin": 20.89,  
"pbv": 1.25,  
"pcf": 3.75,  
"pe": 5.52,  
"period": "YTM",  
"pfcf": 7.14,  
"pffo": null,  
"ps": 0.85,  
"roa": 13.75,  
"roce": 25.03,  
"roe": 22.48,  
"roic": 20.85,  
"ros": 19.28,  
"type": "МСФО",  
"year": 2024</code>
```

RU Data от Интерфакс [dh2.efir-net.ru/swagger/index.html](https://dh2.efir-net.ru/swagger/index.html)

Не уверен что частное лицо может подключиться.

Вот ссылка-описание: <https://rudata.info/rd-api>

Sonoma DATA [sonoma.ru/partnership/api](https://sonoma.ru/partnership/api)

**БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ**



**УСПЕТЬ КУПИТЬ**

ноты, презентации, документы, сообщения инвесторов и данные Центрального банка.

Рассчитываются фундаментальные коэффициенты деятельности компаний. Сервис ещё разрабатывается, но часть данных уже доступна. Информация делится на блоки: общая информация, оцифрованная отчётность, аналитика, прогнозы по акциям и статьи. Цена договорная.

Вот ссылка-описание: <https://conomy.ru/partnership>

Я писал на указанную ими почту и мне ничего не ответили за две недели.

## TradingView



## ROE и SMA200 через Pine

Как ни странно, но сюда похоже ещё можно отнести сервис TradingView, который включает базовые показатели и основные строки из отчетности. У них есть свой язык программирования Pine. Этот язык используется для создания собственных индикаторов и стратегий. График может отображать почти любые строки из отчетности или макроэкономические показатели. [Вот ссылка на справку и синтаксис как правильно писать.](#)

А с помощью Pine скрипта можно составить индикаторы, которые отобразят ROE компании и SMA200.

Изменение ROE в отдельной панели:

`<code class="javascript"> // Михаил Шардин, https://shardin.name/`

**БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ**



**УСПЕТЬ КУПИТЬ**

```

roe = request.financial(syminfo.tickerid, 'RETURN_ON_EQUITY', 'FQ')

// Plot ROE на отдельной панели
plot(roe, title="ROE", color=roe > 15 ? color.green : color.red, linewidth=2)

// Добавление горизонтальных линий для визуальной индикации
hline(0, title="Нулевая линия", color=color.gray, linestyle=hline.style_dashed)
hline(15, title="Порог ROE 15%", color=color.green, linestyle=hline.style_dashed)

// Цветовая индикация
bgcolor(roe > 15 ? color.new(color.green, 90) : color.new(color.red, 90))</code>
SMA200 и бирки с отметками о ROE:
<code class="javascript">// Михаил Шардин, https://shardin.name/
//@version=6
indicator("ROE с SMA200", overlay=true)

// Получение ROE
roe = request.financial(syminfo.tickerid, 'RETURN_ON_EQUITY', 'FQ')

// Расчет SMA200 на основе цены закрытия
sma200 = ta.sma(close, 200)

// Визуализация SMA200 на графике
plot(sma200, color=color.red, linewidth=2, title="SMA200")

// Переменная для отслеживания предыдущего значения ROE
var float previousRoe = na

// Функция создания метки ROE
create_roe_label(float currentRoe) =>
    label.new(x = bar_index, y = high + high * 0.05, text = "ROE (FY): " + str.t

// Создание метки при изменении ROE
if (not na(roe) and (na(previousRoe) or math.abs(roe - previousRoe) > 0.01))
    create_roe_label(roe)
previousRoe := roe

```

**БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ**



**УСПЕТЬ КУПИТЬ**

## Знаете ещё какие-нибудь API по России?

Если не использовать API, то теоретически можно спарсить данные с какого-нибудь сайта и поместить их в базу данных — но это сложнее.

## Заключение

Фундаментальный анализ выявляет недооцененные компании с сильными финансовыми показателями, что критично для долгосрочных инвестиций.

Технический анализ помогает определить оптимальные точки входа и выхода, учитывая рыночные тренды и психологию толпы.

Комбинация обоих подходов повышает точность решений: фундаментальные данные дают «что покупать», технические — «когда покупать».

**Автор:** Михаил Шардин

 [Моя онлайн-визитка](#)

 [Telegram «Умный Дом Инвестора»](#)

9 апреля 2025 г.

фундаментал

PineScript

API

трейдинг

574 

 4  9  7



**Михаил Шардин**

 Пермь

 161  1 414

 с 23 января 2019

 +HreHDn1F5CZjN...

+ Подписаться

9 КОММЕНТАРИЕВ

Сначала старые 



**SergeyJu**

09 апреля 2025, 10:18

Работа проделана большая. Но могла быть и лучше.

Хотелось бы увидеть графики в лог. масштабе.

**БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ**



**УСПЕТЬ КУПИТЬ**

**ves2010**

09 апреля 2025, 10:52



Там на картинке видно ну прям все жульничество...  
Сравнивается обычный сипи с стратегией рекапитализацией %...

— Показать 7 ответов



Напишите комментарий...



ОТПРАВИТЬ

Установите приложение Смартлаба:



RuStore



AppGallery



App Store

[О смартлабе](#)[Реклама](#)[Полная версия](#)[Московская Биржа](#) является спонсором ресурса smart-lab.ru**БИЛЕТОВ  
ВСЕ МЕНЬШЕ****УСПЕТЬ КУПИТЬ**