

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

Хорошо



Михаил Шардин ★

личный блог



23 мая 2026, 14:36

+ Подписаться

Как адаптировать торговые стратегии к изменениям рыночного режима?

Небольшая заметка — посмотрел [интересное видео около ML](#) о том как адаптировать торговые стратегии к изменениям рыночного режима (regime changes).

И здесь основная проблема в нестационарности финансовых временных рядов, где статистические свойства (среднее, дисперсия и др.) постоянно меняются со временем.

У видео есть автоперевод на русский язык.

The screenshot shows a YouTube video player with a dark theme. The video title is "How to handle Regime Changes (by ex HFT quant trader)". The video is from the channel "MemLabs" (16.7 тыс. подписчиков). The video player shows a progress bar at 12:59 / 37:07. The video content includes a code editor with Python code for backtesting a trading strategy. The code includes a function for backtesting and a plot for "Modelling Relative Memory". The video player interface includes a settings menu with options like "Постоянный уровень громкости", "Усиление голоса", "Профессиональное освещение", "Аннотации", "Звуковая дорожка (21)", "Субтитры (1)", "Автовыключение", and "Скорость воспроизведения".

Видео: <https://www.youtube.com/watch?v=X5QcNyYRMqQ>

Автор рассматривает три метода адаптации:

- Кодирование скрытых состояний (Encoding Hidden States): использование средних и



КОНФЕРЕНЦИЯ
СМАРТЛАБ
20 ИЮНЯ

Забрать инвести идеи на 2026

Введите текст комментария

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

возвратом к среднему.

- Обучение с подкреплением (Reinforcement Learning): моделирование торговли как задачи «двурукого бандита». Автор подчеркивает важность использования энтропийной регуляризации, которая предотвращает застревание модели в локальных оптимумах и заставляет её продолжать «исследование» рынка даже после изменения условий.

Данная публикация является личным мнением автора. Мнение владельца сайта может не совпадать с мнением автора.

ML

торговые роботы

5.2K

4

33

35



Михаил Шар...

Пермь

509 5 688

с 23 января 2019

[+ Подписаться](#)

33 КОММЕНТАРИЯ

[Сначала старые](#)



cerberus

23 мая 2026, 15:06



Михаил, а кроме этой околорыночной болтовни и фотографий булочек из самолётов, у вас есть что-то за душой? Я имею в виду опыт успешной торговли. Или вы только щёки раздувать умеете?

— [Показать 5 ответов](#)

+3



Op_Man

23 мая 2026, 15:32



Михаил, добрый день! Спасибо за заметку.



КОНФЕРЕНЦИЯ
СМАРТЛАБ
20 ИЮНЯ

[Забрать инвестидеи на 2026](#)

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

Вместе с персональными данными пользователи могут получать рекомендации интересные статьи и скриншоты по биржевой/алго тематике 🤖

пысы: платный зарубежный трафик с осени — фейк или нет?

— Показать 5 ответов



Вячеслав Иванов

23 мая 2026, 15:29



Очень интересно, спасибо за статью



Andrey Siver

23 мая 2026, 16:14



А откуда следует, что это статистические свойства меняются? Есть мнение, что цена — это величина: $x+s$, где x — это неслучайная величина, а s — это случайная величина с мат. ожиданием равным 0. Отсюда следует, что представлять, что статистические свойства меняются имеет мало смысла и значения.

— Показать 5 ответов



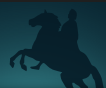
Ещё 7 комментариев

Напишите комментарий...



ОТПРАВИТЬ

Читайте на SMART-LAB:



КОНФЕРЕНЦИЯ
SMARTLAB
20 ИЮНЯ

Забрать инвести идеи на 2026

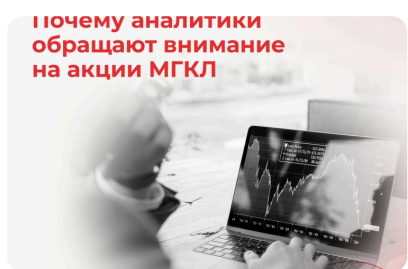
Во время посещения сайта вы соглашаетесь с использованием файлов [cookie](#)



Канадский доллар продолжает сдавать позиции и снизился до очередных локальных минимумов, оказавшись в районе выше...

Tickmill

26.05.2026



Почему аналитики обращают внимание на акции МГКЛ

За последний год акции ПАО «МГКЛ» всё чаще появляются в аналитических обзорах и исследованиях инвестиционных домов...

МГКЛ

26.05.2026

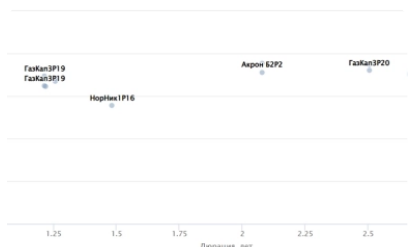


Набираем обороты и уверенно движемся вперёд!

Представляем финансовые результаты четырёх месяцев 2026 года. «ДОМ.РФ за четыре месяца 2026 года заработал 38,7 млрд...

ДОМ.РФ

26.05.2026



Через какие юаневые облигации можно отыграть рост валюты?

Mozgovik

26.05.2026

Установите приложение Смартлаба:

RuStore

AppGallery

App Store



КОНФЕРЕНЦИЯ
СМАРТЛАБ
20 ИЮНЯ

Забрать инвести идеи на 2026

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

