

ИНСТРУКЦИЯ

КАК УСТРОЕНЫ ТЕСТЫ, ГРАФИК И ВСЕ ПЕРЕКЛЮЧАТЕЛИ

С ЧЕГО НАЧАТЬ

Эта страница собрана для одного случая: ты открываешь тест, видишь переключатель или слово и не помнишь, что именно за ним стоит. За несколько дней работы правил накопилось много, часть из них менялась, и держать всё в голове уже не получается. Здесь всё записано в одном месте и по порядку.

Каждая тема ниже свёрнута. Нажми на заголовок, чтобы раскрыть её. Темы идут от простого к сложному: сначала как устроен сайт и профиль, потом слова, на которых стоят все тесты (опора, точка открытия, тренд, тип открытия), потом сами тесты, области и график. В конце короткий список путаниц, на которых мы спотыкались чаще всего.

Читать подряд не обязательно. Если нужен ответ на один вопрос, таблица ниже подскажет, какую тему раскрыть.

ЕСЛИ НУЖНО ВСПОМНИТЬ	ТЕМА
что такое опора, точка открытия, тренд	«Опора и точка открытия», «Тренд открытия»
почему день с открытием внутри VA иногда с трендом, а иногда без	«Открытие внутри VA»
чем Open-Drive отличается от Open-Test-Drive	«Типы открытия»
что делает конкретная кнопка	«Общие переключатели тестов», «Области прошлых профилей», «График»
что именно считает тест	«Тесты по порядку»
чему из этого можно верить	«Чему доверять и чему нет» и отдельная страница «Итоги тестов»

КАРТА САЙТА

Сайт устроен в четыре уровня. С главной страницы ты попадаешь на страницу инструмента Market Profile. На ней две карточки: Tests со всеми тестами и Chart с графиком профилей. Ниже карточка «Итоги тестов» с отчётом. Ссылка на эту инструкцию стоит справа в шапке.

ALGO TESTS / MARKET PROFILE

MARKET PROFILE

ТРО-ПРОФИЛЬ ES · 2010-06-07 → 2026-09-15 · 4088 ДНЕЙ

ИНСТРУКЦИЯ →

СВЕТЛАЯ

TESTS

OPENING TYPES & DAY TYPES

ТЕСТ

Место и тип открытия → тип дня

Какой тип дня вероятнее при данной точке и типе открытия

ТЕСТ

Место открытия → тип открытия

Какой тип открытия вероятнее при данной точке открытия

STRONG POINTS

ТЕСТ

Место и тип открытия → тест границ IB

Какие границы IB цена тестирует до конца дня при данной точке и типе открытия

ТЕСТ

Место и тип открытия → время экстремумов дня

В какое время дня ставится лучшая и худшая цена по тренду открытия при данной точке и типе открытия

ТЕСТ

Точка открытия недели → день экстремумов недели

В какой день недели ставится хай и лоу недели, лучшая и худшая цена по тренду открытия

Страница Market Profile: разделы тестов, под ними плитка графика, справа сверху ссылка на инструкцию

Тесты разложены по разделам так же, как в плане тестов. Раздел это просто тема: в одном тесты про типы дня и открытия, в другом про сильные точки (границы IB, экстремумы), в третьем про области профиля. Номер теста соответствует порядку, в котором мы их делали.

РАЗДЕЛ	ТЕСТЫ
Opening Types & Day Types	1. тип дня, 2. тип открытия
Strong Points	3. тест границ IB, 4. время экстремумов дня, 8. день экстремумов недели, 9. четверть экстремумов месяца
Profile Parts	5. реакция на области дневных профилей, 6. недельных, 7. месячных
Other Scenarios	10. тест вчерашних хая и лоу

Все страницы тестов выглядят одинаково. Сверху переключатели, под ними большое кольцо по всей выборке, ниже калькулятор, в самом низу плитка «Правила». В «Правилах» записаны точные определения именно этого теста. Если число на странице вызывает вопрос «а как это посчитано», ответ там.

СТРАНИЦА	ЧТО НА НЕЙ
Главная	плитка инструмента Market Profile
Market Profile	карточки Tests, Chart и «Итоги тестов»
Страница теста	переключатели, общее кольцо, калькулятор, внизу плитка «Правила»

СТРАНИЦА	ЧТО НА НЕЙ
Правила	точные определения именно этого теста
Chart	график профилей: вкладки День, Неделя, Месяц

ПРОФИЛЬ: ИЗ ЧЕГО ОН СТРОИТСЯ

Все тесты стоят на ТРО-профиле. Профиль это день (или неделя, или месяц), разрезанный на блоки времени. Каждый блок оставляет отметку на каждой цене, где он торговался. Чем больше блоков прошло через цену, тем шире профиль на этой цене. Широкое место значит, что рынок провёл там много времени и цену принял. Узкое место значит, что цена прошла быстро.

Дневной профиль строится только по основной сессии, с 09:30 до 16:00 по Нью-Йорку. Ночная торговля в него не входит. Блок длится 30 минут, блоки называются буквами от А до М, всего тринадцать. Недельный и месячный профили строятся по всем торгам Globex, включая ночь, и блоки у них крупнее.

	ДНЕВНОЙ	НЕДЕЛЬНЫЙ	МЕСЯЧНЫЙ
Что входит	только RTH 09:30–16:00 Нью-Йорк	все торги с 18:00 воскресенья до 17:00 пятницы	все сутки Globex месяца
Один блок ТРО	30 минут, буквы А...М	4 часа от 18:00	одни сутки Globex, 18:00 → 17:00
Блоков в профиле	13	около 30	около 21
Высота строки, фиксированная	2 пт	4 пт	8 пт

У профиля есть части с именами. Value Area, или VA, это зона, где набралось 68 % всех отметок вокруг самой широкой строки. Её верхняя граница называется VAN, нижняя VAL. Самая широкая строка называется ROC. VA показывает, где рынок считал цену справедливой, и почти все наши тесты отталкиваются от неё.

Initial Balance, или IB, это диапазон первого часа: блоки А и В, с 09:30 до 10:30. IB есть только у дневного профиля. На нём построены типы дня, типы открытия и тест 3.

Excess и single prints это тонкие места профиля шириной в одну отметку. Excess стоит на краю профиля: цена туда сходилa и была отвергнута. Single prints стоят внутри профиля: цена прошла участок за один блок и не вернулась, по обе стороны от него лежат два отдельных распределения. В обоих случаях нужно не меньше двух строк в высоту. Одиночные отметки последнего блока в excess не идут: день закончился, и цена просто не успела показать, отвергнут этот край или нет.

ЧАСТЬ	ПРАВИЛО
Value Area (VA)	68 % всех отметок вокруг ROC. VAN верхняя граница, VAL нижняя
ROC	строка с наибольшим числом отметок, при равенстве ближняя к центру
IB	первые два блока дня, А и В, 09:30–10:30. Есть только у дневного профиля
Excess	на краю профиля, 1 отметка в ширину, от 2 строк в высоту. Последний блок excess не даёт
Single prints	то же, но внутри профиля, между двумя распределениями
Poor high / poor low	на крайней строке 2 отметки и больше. В тестах областей не участвует

Эти параметры заморожены. Они совпадают с тем, как профиль настроен в твоём терминале, и менять их без отдельного решения нельзя: от них зависят все десять тестов.

ДВА РЕЖИМА БЛОКА

Высота строки профиля влияет на всё: где окажется граница VA, будет ли на краю excess, сколько отметок в ROC. В терминале у тебя стоит 2 пункта на дневном профиле. Это удобно сейчас, но в 2012 году ES стоил около 1300, а дневной диапазон был в несколько раз меньше. Строка 2 пункта тогда была грубой, а сегодня она мелкая. Один и тот же профиль в разные годы получается разной «зернистости».

Поэтому каждый тест считается дважды. Фиксированный режим повторяет терминал: 2 пункта у дня, 4 у недели, 8 у месяца. Адаптивный режим подбирает высоту строки под волатильность, чтобы в дневном профиле в любой год было около 25 рядов. Первый нужен, чтобы числа совпадали с тем, что ты видишь на экране. Второй нужен, чтобы честно сравнивать разные годы.

РЕЖИМ	ЧТО ЭТО	КОГДА СМОТРЕТЬ
Фиксированный	строка 2 пт у дня, 4 у недели, 8 у месяца: как в терминале сейчас	чтобы совпадало с тем, что видишь на экране
Адаптивный	строка подбирается так, чтобы в дневном профиле было около 25 рядов в любой год	чтобы 2012 и 2026 годы были сравнимы
Своя строка	высота строки в тиках задаётся руками, всё пересчитывается на странице	для проверки, только в тестах 1–4

Режимы дают не одинаковый результат. Точка открытия совпадает у 92 % дней, тип открытия у 89 %, тип дня у 96 %. Отсюда простое правило чтения: если вывод виден только в одном режиме, это свойство настройки, а не рынка. Доверять стоит тому, что держится в обоих.

ОПОРА И ТОЧКА ОТКРЫТИЯ

Чтобы сказать «день открылся выше value area», нужно решить, чью value area мы имеем в виду. Профиль, с которым сравнивается цена открытия, мы называем опорой. От опоры берутся три вещи: VA, хай и лоу.

Опор две. Первая это просто вчерашний день. Вторая это композит: несколько дней подряд, которые торговались в одной зоне и склеены в один общий профиль. День входит в композит, если больше половины его VA лежит внутри VA композита и склеенный профиль остаётся колоколом, а не двумя горбами. Как только это нарушается, композит закрывается. Если открытого композита от двух дней нет, опорой остаётся вчерашний день.

ОПОРА	С ЧЕМ СРАВНИВАЕТСЯ ОТКРЫТИЕ
Вчерашний день	профиль вчерашнего RTH
Композит	открытый композит от 2 дней, если он есть; иначе вчерашний день

Цена в 09:30 попадает в одну из пяти зон относительно опоры. Это и есть точка открытия.

ЗОНА	ГДЕ ЦЕНА 09:30
выше диапазона	выше high опоры
выше VA, в диапазоне	между VAN и high
внутри VA	между VAL и VAN
ниже VA, в диапазоне	между low и VAL
ниже диапазона	ниже low опоры

Важно понимать, что кнопка «Опора» ничего не делает с самим днём. IB, экстремумы, тип дня остаются теми же. Меняется только ярлык: в какую зону мы записали открытие и какой тип открытия из этого получился. У 9 дней из 10 обе опоры дают одинаковый ярлык, поэтому числа в тестах при переключении сдвигаются на один-три процентных пункта, не больше.

ТРЕНД ОТКРЫТИЯ

Во многих тестах есть вид «по тренду». Слово «тренд» здесь значит не то, куда день пошёл, а предвзятость, с которой он начался. Она берётся из места открытия: открылись выше value area, значит рынок с утра оценён дороже вчерашнего, и день считается лонговым. Открылись ниже, шортовым.

Это сделано нарочно. Куда день пошёл, известно только вечером. А место открытия известно в 09:30, и на него можно опираться в лайве.

ОТКРЫТИЕ	ТРЕНД	КОГДА ИЗВЕСТЕН
выше VA опоры	лонг	в 09:30
ниже VA опоры	шорт	в 09:30
внутри VA	см. следующую тему	в 10:30

Отсюда одна тонкость. Open-Rejection-Reverse это день, который открылся вне VA и развернулся обратно в неё. Его тренд всё равно считается по месту открытия: открылись выше VA, день лонговый, хотя сам тип идёт вниз. Поэтому в видах «по тренду» у Open-Rejection-Reverse числа зеркальные по отношению к драйвам, и это не ошибка.

ОТКРЫТИЕ ВНУТРИ VA

Это место, где путаница возникала чаще всего, поэтому разберём медленно.

Есть два разных понятия с похожими названиями. «Внутри VA» как точка открытия отвечает на вопрос «где была цена в 09:30». «Open-Auction внутри VA» как тип открытия отвечает на вопрос «что цена сделала за первый час». День может открыться внутри VA и остаться там, а может открыться внутри VA и к 10:30 выйти из неё. Точка открытия у обоих одна, а типы разные.

Раньше любой день с открытием внутри VA считался Open-Auction внутри VA. Третьего октября мы это изменили: по Далтону место открытия и тип открытия независимы, и день, который вышел из VA с убеждённой уверенностью, ведёт себя как драйв, а не как аукцион.

	ЧТО ЭТО	ДНЕЙ	ТРЕНД
Точка «внутри VA»	цена 09:30 между VAL и VAN	1560	зависит от типа
Тип «Open-Auction внутри VA»	открылись внутри VA и в 10:30 остались внутри	932	нет
Open-Drive из VA	открылись внутри VA, в 10:30 цена за VA, откат малый	308	есть
Open-Test-Drive из VA	то же, но откат больше порога или был тест в B	320	есть

Решает всё одна цена: закрытие блока B, то есть цена в 10:30.

ЦЕНА В 10:30	ТРЕНД	ТИП ОТКРЫТИЯ
выше VAN	лонг	Open-Drive или Open-Test-Drive
ниже VAL	шорт	Open-Drive или Open-Test-Drive

ЦЕНА В 10:30	ТРЕНД	ТИП ОТКРЫТИЯ
внутри VA	нет	Open-Auction внутри VA

Тренд такого дня это сторона, где цена стоит в 10:30, а не сторона первого пробоя. Если цена вышла вверх в 09:40, а к 10:30 вернулась в VA, тренда нет, и это Open-Auction внутри VA. Если пробил вниз, развернулась и в 10:30 стоит выше VАН, тренд лонг.

У этого правила есть цена, и о ней нужно помнить при чтении любого вида «по тренду». Тренд дня с открытием внутри VA становится известен только в 10:30. К этому моменту цена уже ушла за VA и, как правило, стоит у границы IB с той же стороны. Поэтому «граница IB по тренду протестирована» или «вчерашний хай по тренду достигнут» у таких дней частично получается из самого определения. Чтобы посмотреть на статистику без этого эффекта, в тестах 3 и 10 есть тумблеры «Открытие внутри VA: исключить» и «Тест в первый час: исключить».

И последнее. Open-Auction внутри VA не имеет тренда, поэтому в видах «по тренду» он не участвует никогда, при любом положении тумблеров.

ТИПЫ ОТКРЫТИЯ

Тип открытия описывает характер первого часа. Все типы известны в 10:30, когда закрылся блок В. Раньше в определении участвовал пробой IB до 11:30, сейчас он не используется: в 10:30 ты уже знаешь тип и можешь принимать решение.

Типы различаются тремя вещами: трогала ли цена value area опоры, насколько глубоко она откатывала против тренда и где оказалась в 10:30.

Откат это заход цены за цену открытия против тренда в течение первого часа. В лонговый день это то, насколько цена опускалась ниже цены 09:30. Чтобы откат в 2012 и в 2026 году мерился одной линейкой, он сравнивается с обычным IB: медианой ширины IB за двадцать прошлых дней. Порог 20 % обычного IB. Откат не больше порога считается малым.

Тест в В это отдельное условие. Блок В (10:00–10:30) дошёл до экстремума блока А против тренда, с допуском один тик. В лонговый день это значит, что во втором получасе цена вернулась к минимуму первого. Такой день уже не чистый драйв, даже если откат за цену открытия был малым.

ВЕЛИЧИНА	ЧТО ЭТО
Обычный IB	медиана ширины IB за 20 прошлых дней
Откат	насколько цена за первый час зашла за цену открытия против тренда
Порог отката	20 % обычного IB
Тест в В	блок В дошёл до экстремума блока А против тренда, допуск 1 тик

ВЕЛИЧИНА	ЧТО ЭТО
Своя граница VA	VAH при открытии выше VA, VAL при открытии ниже

Open-Drive это самое убеждённое открытие: цена ушла от открытия и почти не оглядывалась. Open-Test-Drive это открытие с проверкой: цена сначала сходила против тренда (глубокий откат, тест в В или касание VA), а потом всё равно ушла по тренду. Open-Rejection-Reverse это отказ: цена вернулась в value area и к 10:30 осталась в ней или прошла её насквозь. Open-Auction это торговля без направления.

Открытие вне VA:

ТИП	УСЛОВИЕ
Open-Drive	VA не тронута, откат не больше порога, теста в В нет
Open-Test-Drive	откат больше порога, или тест в В, или VA тронута; в 10:30 цена за VA и по тренду от цены открытия
Open-Auction вне VA	то же, но в 10:30 цена не по тренду от цены открытия
Open-Rejection-Reverse	VA тронута, в 10:30 цена внутри VA или прошла её насквозь

Открытие внутри VA:

ТИП	УСЛОВИЕ
Open-Auction внутри VA	в 10:30 цена внутри VA
Open-Drive	в 10:30 цена за VA, откат не больше порога, теста в В нет
Open-Test-Drive	в 10:30 цена за VA, откат больше порога или был тест в В

При фиксированном блоке и опоре «вчера» типы делятся так: Open-Test-Drive 26.6 %, Open-Auction внутри VA 23.0 %, Open-Drive 19.3 %, Open-Auction вне VA 18.3 %, Open-Rejection-Reverse 12.9 %.

Одна честная оговорка. Порог 20 % мы выбирали, уже посмотрев на черновые числа при разных порогах. Это отступление от правила «сначала правило, потом результат», и оно записано в журнале. Граница между Open-Drive и Open-Test-Drive подобрана под историю.

типы дня

Тип дня описывает форму всего дня целиком и определяется после закрытия. Основа по Далтону: был ли выход за IB и в какую сторону. Выход засчитывается, только если цена ушла за IB больше чем на 20 % его ширины. Мелкий прокол границы выходом не считается.

Если выхода не было, день Normal или Nontrend (при узком IB). Если выход был в обе стороны, день Neutral: с закрытием у края это Neutral-Extreme, без него Neutral-Center. Если выход был в одну сторону, день Trend, Double-Distribution Trend или, во всех остальных случаях, Normal Variation.

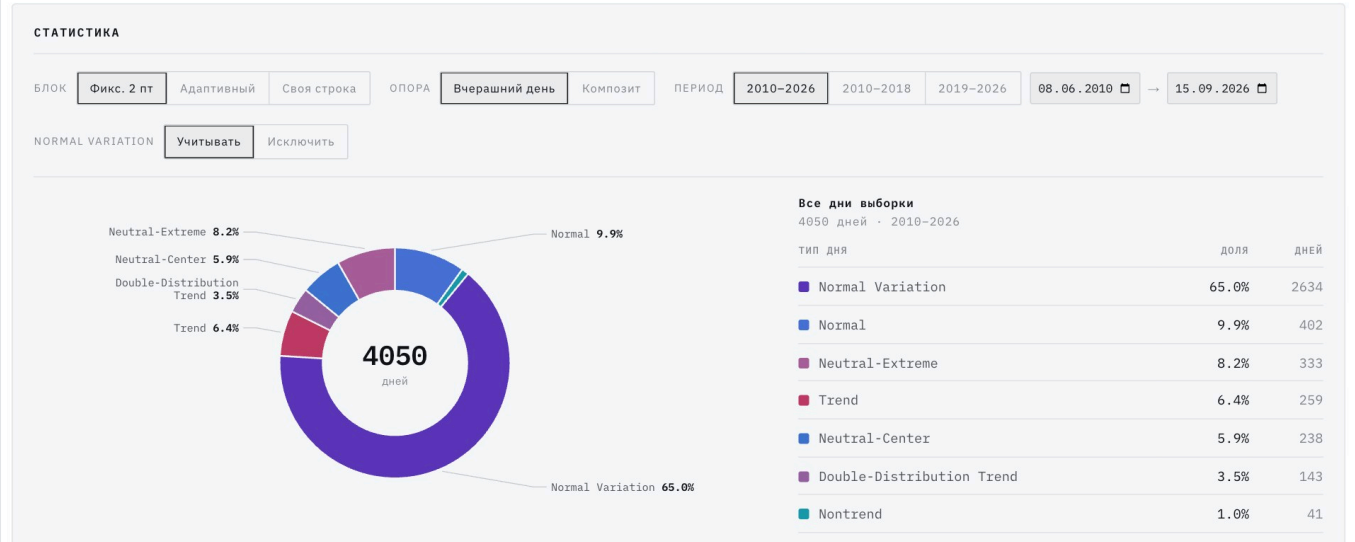
Trend у нас проверяется строго. На первых десяти блоках дня (А...J) ни один блок не должен уйти за экстремум двух предыдущих против тренда, и закрытие должно быть в крайних 25 % диапазона. Одного расширения за IB для трендового дня недостаточно.

ТИП	УСЛОВИЕ
Normal	выхода за IB нет, IB не узкий
Nontrend	выхода за IB нет, IB узкий: меньше 40 % обычного диапазона дня за 20 дней
Normal Variation	выход в одну сторону, всё остальное
Trend	выход в одну сторону; на блоках А...J ни один блок не ушёл за экстремум двух предыдущих против тренда; закрытие в крайних 25 % диапазона
Double-Distribution Trend	выход в одну сторону, внутри профиля single prints, по обе стороны не меньше 25 % отметок
Neutral-Center	выход в обе стороны, закрытие не у края
Neutral-Extreme	выход в обе стороны, закрытие в крайних 20 % диапазона

Тип дня нельзя выбрать в калькуляторе как условие, и это не недоработка. В 10:30, когда ты принимаешь решение, типа дня ещё не существует. Если разрешить фильтровать по нему, статистика будет отвечать на вопрос «что было в дни, про которые я уже знаю, чем они кончились», а в лайве такого знания нет. Поэтому тип дня бывает только исходом, в тесте 1.

ОБЩИЕ ПЕРЕКЛЮЧАТЕЛИ ТЕСТОВ

Верх каждой страницы теста устроен одинаково. Сначала идут переключатели, которые задают, какие дни и как считать. Под ними кольцо: это вся выборка при выбранных переключателях, без отбора по открытию. Кольцо нужно как точка отсчёта. Прежде чем смотреть, что бывает после Open-Drive, полезно знать, что бывает просто в любой день.



Верх страницы теста: переключатели и общее кольцо по всей выборке

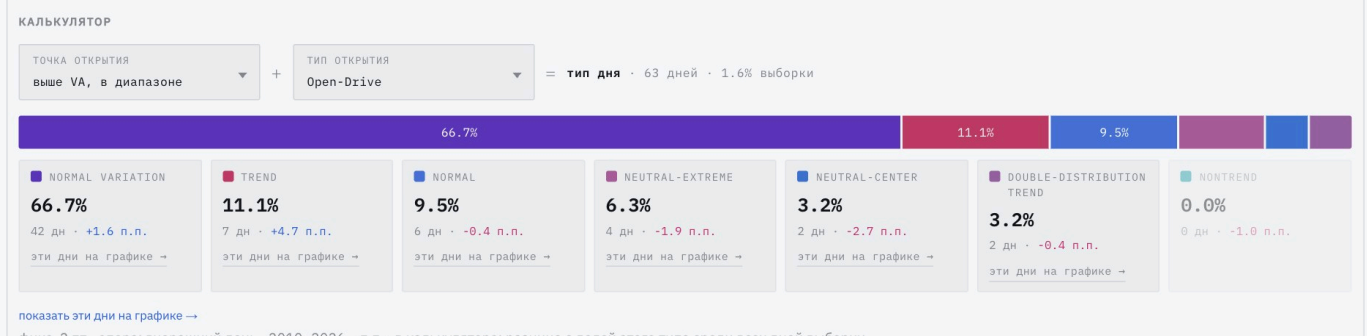
«Блок» и «Опора» разобраны выше. «Период» режет историю: вся, первая половина (2010–2018), вторая (2019–2026) или свои даты. Половины нужны для проверки: если число держится в обеих, ему можно верить больше.

У большинства тестов есть ещё один-два своих переключателя. Тумблер «учитывать / исключить» убирает из выборки самый частый исход, чтобы остальные было лучше видно: в тесте 1 это Normal Variation, в тесте 2 Open-Auction внутри VA. Переключатель вида («Исход», «Отклонения») меняет, в каких категориях показан результат.

ПЕРЕКЛЮЧАТЕЛЬ	ЧТО ДЕЛАЕТ
Блок	фиксированный, адаптивный или своя строка
Опора	вчерашний день или композит: от чего берутся точка и тип открытия
Период	вся история, 2010–2018, 2019–2026 или свои даты
Учитывать / исключить	убирает из выборки один исход: Normal Variation в тесте 1, Open-Auction внутри VA в тесте 2
Исход / Отклонения	вид результата, свой в каждом тесте

КАЛЬКУЛЯТОР

Калькулятор отвечает на вопрос «а что бывает именно в такой ситуации». Ты задаёшь точку открытия и тип открытия, он показывает, как распределились исходы в таких днях и насколько это отличается от всей выборки.



Калькулятор: точка открытия плюс тип открытия, результат полосой и плитками

В каждом списке можно отметить несколько вариантов. Пустой список значит «любая» точка или «любой» тип. Если отметить все варианты подряд, список сам сбросится в «любые»: это одно и то же.

Под каждой плиткой исхода стоит разница в «п.п.». Это процентные пункты: доля исхода в твоём выборе минус доля того же исхода во всей выборке. Если Trend во всей выборке 6.4 %, а в твоём выборе 10 %, разница +3.6 п.п. Именно разница, а не сама доля, показывает, даёт ли условие что-нибудь.

Из калькулятора можно уйти на график двумя путями. Ссылка «эти дни на графике →» внутри плитки откроет дни именно этого исхода. Ссылка «показать эти дни на графике →» под плитками откроет все дни выбора. Это удобный способ проверить глазами, что статистика считает то, что ты думаешь.

Главное предостережение: следи за числом дней. Когда в плитке несколько десятков дней, разница в десять процентных пунктов легко оказывается шумом. Узкий выбор (одна точка плюс один тип плюс половина истории) почти всегда даёт маленькую выборку.

ТЕСТЫ ПО ПОРЯДКУ

Все десять тестов задают один и тот же тип вопроса: «при таком открытии как часто случается такое событие». Различаются они событием и единицей счёта. В большинстве тестов считаются дни. В тестах областей считаются касания области: в одном дне их может быть несколько. В тестах 8 и 9 считаются недели и месяцы.

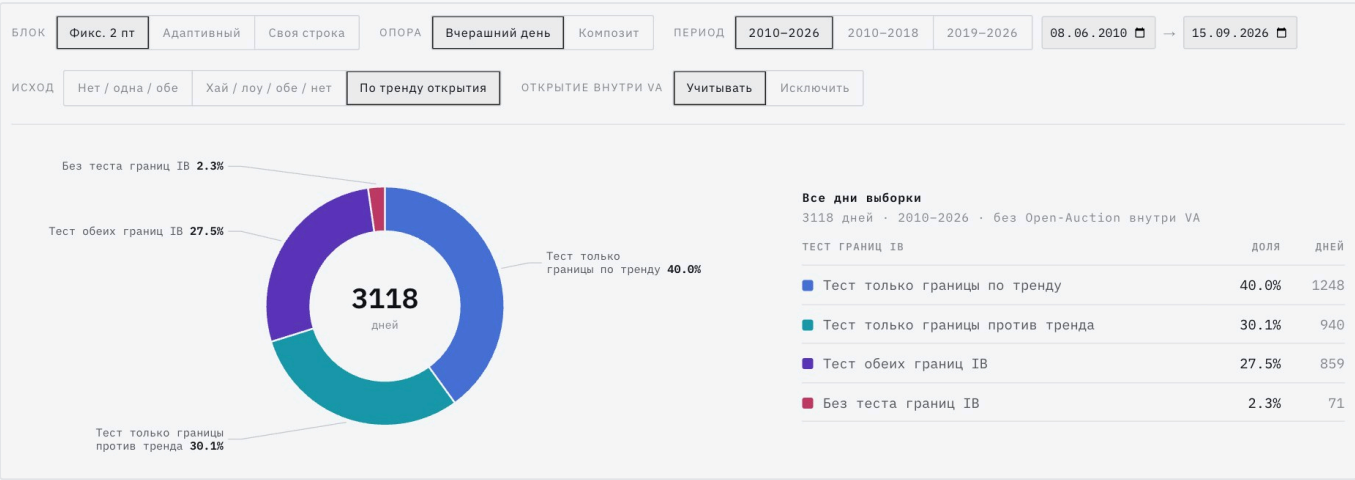
№	ВОПРОС	ЕДИНИЦА СЧЁТА
1	какой тип дня получается при данной точке и типе открытия	день
2	какой тип открытия получается при данной точке	день
3	какие границы IB цена тестирует после 10:30	день
4	в какое время дня ставится худшая и лучшая цена	день
5	отскакивает ли цена от областей прошлых дневных профилей	тест области

№	ВОПРОС	ЕДИНИЦА СЧЁТА
6	то же для недельных профилей	тест области
7	то же для месячных профилей	тест области
8	в какой день недели ставится хай и лоу недели	неделя
9	в какую четверть месяца ставится хай и лоу месяца	месяц
10	доходит ли цена до вчерашнего хая и лоу	день

Тесты 1 и 2 простые и отдельного разбора не требуют: первый показывает, какой тип дня получается после данного открытия, второй, какой тип открытия получается при данной точке. Остальные разобраны ниже.

ТЕСТ 3. ГРАНИЦЫ IB

Идея теста практическая: где ставить стоп и цель. К 10:30 первый час закончен, у него есть хай и лоу. Вопрос в том, до какой из этих границ цена дойдёт за остаток дня: только до верхней, только до нижней, до обеих или ни до одной.



Тест 3: три вида исхода и кольцо

Тест границы это касание ровно уровня или дальше, без допуска. Ищется он только после 10:30 и до конца RTH. Результат можно смотреть тремя способами: сколько границ протестировано («Нет / одна / обе»), какие именно («Хай / лоу / обе / нет») и относительно тренда («По тренду открытия»). В последнем виде при лонге граница по тренду это хай IB. Исход «только по тренду» значит, что лоу IB остался нетронутым до конца дня.

КАКАЯ ГРАНИЦА ПРОТЕСТИРОВАНА ПЕРВОЙ?

Только дни, когда протестированы обе границы IB.

ВТОРАЯ ГРАНИЦА

Все

В этот же блок

Через N блоков

через1

блок.

Тумблер «Открытие внутри VA» работает по точке открытия. Тип Open-Auction внутри VA тренда не имеет и в виде «По тренду открытия» не участвует никогда. Из открытий внутри VA там остаются только дни с выходом из VA: Open-Drive и Open-Test-Drive, их тренд = где цена в 10:30 (выше VAN лонг, ниже VAL шорт).

выше VA, в диапазоне - Open-Drive · 18 дней

72.2%

27.8%

■ ПЕРВЫМ ТЕСТ ГРАНИЦЫ ПО ТРЕНДУ

72.2%

13 дн · +14.9 п.п.

эти дни на графике →

■ ПЕРВЫМ ТЕСТ ГРАНИЦЫ ПРОТИВ ТРЕНДА

27.8%

5 дн · -14.9 п.п.

эти дни на графике →

Плитка «Какая граница протестирована первой?» с тумблером и памяткой

Ниже на странице есть отдельная плитка «Какая граница протестирована первой?». Она считает только дни, где протестированы обе границы, и показывает порядок. Когда оба теста попали в один получасовой блок, порядок взят по минутным данным. Фильтр «Вторая граница» позволяет оставить дни, где вторая граница взята в том же блоке или ровно через N блоков. Тумблер «Открытие внутри VA: исключить» убирает дни с точкой открытия внутри VA: у них тренд определён по цене в 10:30, и граница по тренду у них почти всегда первая по определению.

ТЕСТ 4. ВРЕМЯ ЭКСТРЕМУМОВ ДНЯ

Тест отвечает на вопрос о времени: когда день ставит свою лучшую и худшую цену. Лучшее отклонение это экстремум по тренду: хай в лонговый день, лоу в шортový. Худшее отклонение это экстремум против тренда. Для позиции по тренду худшее отклонение это то место, где стоял бы идеальный стоп, а лучшее это идеальный выход.

БЛОК

Фикс. 2 пт

Адаптивный

Своя строка

ОПОРА

Вчерашний день

Композит

ПЕРИОД

2010–2026

2010–2018

2019–2026

08.06.2010 → 15.09.2026

ОТКЛОНЕНИЯ

По тренду

Лонговых дней

Шортových дней

ОТКРЫТИЕ ВНУТРИ VA

Учитывать

Исключить

ВРЕМЯ

Окна

Блоки 30 мин

Вся выборка · 3118 дней · 2010–2026 · лонговые и шортových дни

ХУДШЕЕ ОТКЛОНЕНИЕ

Close 29.7%

Open 43.2%

Mid day 9.1%

Drive 18.0%

КОГДА ХУДШАЯ ЦЕНА ДНЯ	ДОЛЯ	ДНЕЙ
Open 09:30–10:30	43.2%	1347
Close 14:00–16:00	29.7%	927
Drive 10:30–12:30	18.0%	560
Mid day 12:30–14:00	9.1%	284

ЛУЧШЕЕ ОТКЛОНЕНИЕ

Close 36.9%

Open 33.4%

Mid day 9.6%

Drive 20.1%

КОГДА ЛУЧШАЯ ЦЕНА ДНЯ	ДОЛЯ	ДНЕЙ
Close 14:00–16:00	36.9%	1150
Open 09:30–10:30	33.4%	1041
Drive 10:30–12:30	20.1%	628
Mid day 12:30–14:00	9.6%	299

Тест 4: два кольца рядом, худшее и лучшее отклонение

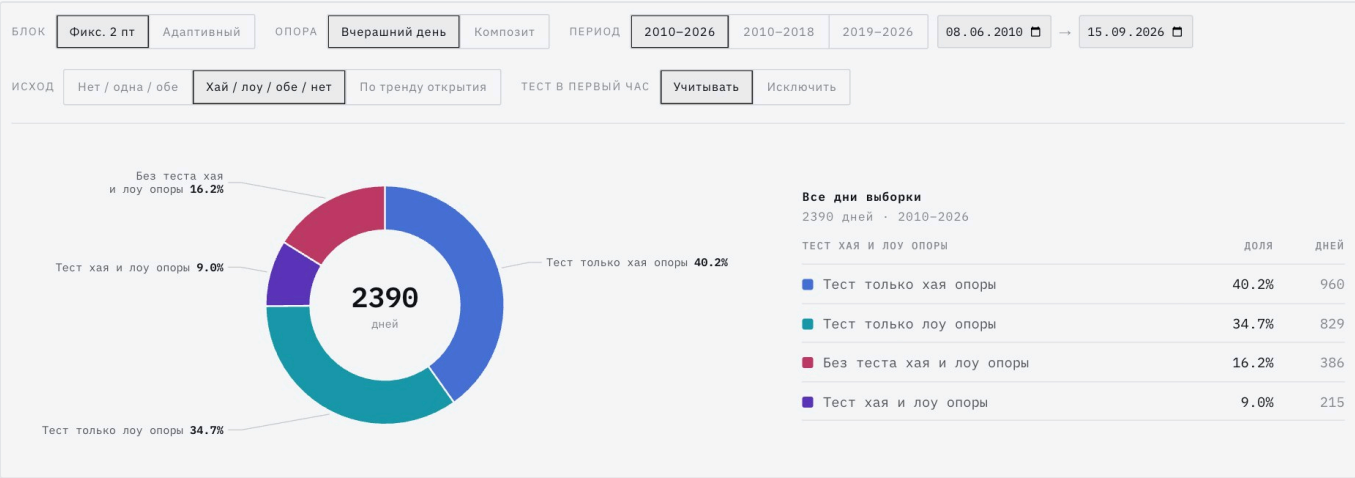
День разбит на четыре окна разной длины. Можно переключиться на тринадцать получасовых блоков, если нужна точность.

СЛОВО	ЗНАЧЕНИЕ
Лучшее отклонение	экстремум дня по тренду: хай в лонговый день, лоу в шортовый
Худшее отклонение	экстремум дня против тренда
Окна	Open 09:30–10:30, Drive 10:30–12:30, Mid day 12:30–14:00, Close 14:00–16:00
Блоки 30 мин	те же данные по 13 блокам A...M

Кнопки «По тренду / Лонговых дней / Шортовых дней» выбирают, какие дни считать. В калькуляторе две полосы: одна про худшее отклонение, другая про лучшее. Дни Open-Auction внутри VA в тест не входят: у них нет тренда, и слова «лучшее» и «худшее» для них не имеют смысла.

ТЕСТ 10. ВЧЕРАШНИЕ ХАЙ И ЛОУ

Вопрос простой: если день открылся внутри вчерашнего диапазона, дойдёт ли цена до вчерашнего хая, лоу, до обоих или ни до одного. В тест входят только три точки открытия: выше VA в диапазоне, внутри VA и ниже VA в диапазоне. Дни с открытием за диапазоном не входят, потому что одна из границ у них уже позади.

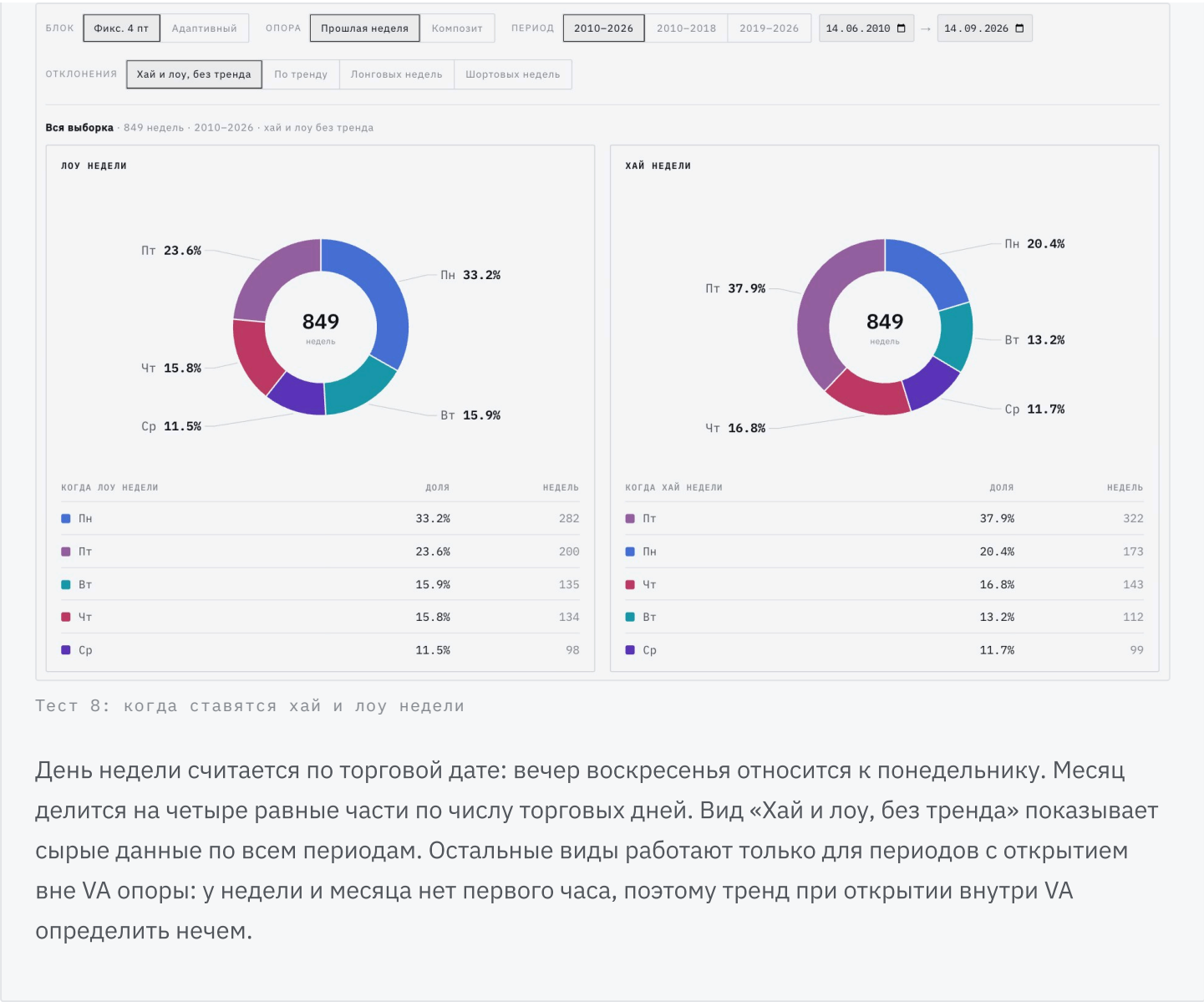


Тест 10: виды исхода и тумблер «Тест в первый час»

Тест ищется за весь RTH с 09:30, касание ровно уровня. Из-за этого половина дней получает тест уже в первый час, до того как известен тип открытия. Тумблер «Тест в первый час: исключить» оставляет только дни, где в 10:30 обе границы ещё впереди. Это ситуация, в которой ты реально находишься в лайве: тип открытия уже понятен, и нужно решить, реальна ли цель у вчерашнего экстремума. Этим же тумблером уходят дни, которые открылись внутри VA и к 10:30 уже вышли за диапазон.

ТЕСТЫ 8 И 9. ЭКСТРЕМУМЫ НЕДЕЛИ И МЕСЯЦА

Это тест 4, перенесённый на старшие периоды. Вместо окон дня здесь дни недели и четверти месяца. Вопрос тот же: когда период ставит свой хай и лоу.



ОБЛАСТИ ПРОШЛЫХ ПРОФИЛЕЙ

Раздел Profile Parts проверяет одну из главных идей Market Profile: значимые места прошлых профилей работают как уровни. Область это участок прошлого профиля, от которого мы ждём реакцию цены. Мы взяли пять видов: границы value area, POC, single prints и excess. Poor high и poor low не берём.

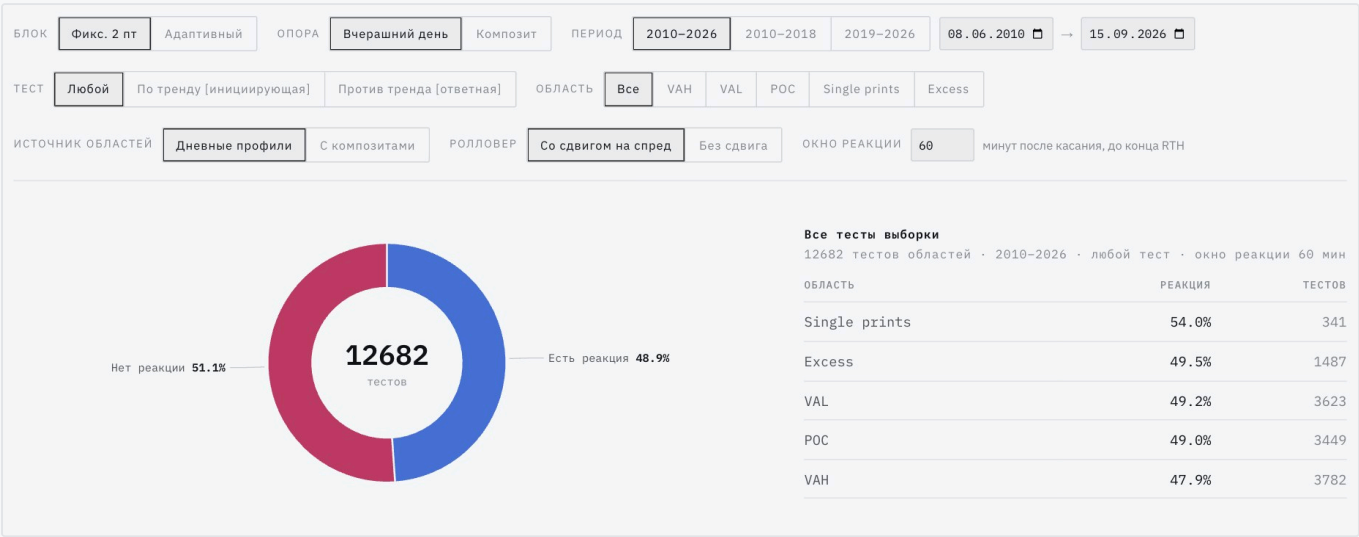
ОБЛАСТЬ	ВИД
VAN, VAL	одна цена
POC	строка
Single prints	зона
Excess	зона

У области есть жизнь. Она появляется на следующий период после своего профиля и ждёт, пока цена до неё дойдёт. Первое касание тик в тик считается тестом. После теста область снимается:

нас интересует только первая реакция, потому что уровень, который уже проверили, считается отработанным. Если цена не дошла до области за срок жизни, область тоже снимается.

Реакцию нужно было определить так, чтобы её мог посчитать компьютер. Мы договорились так: в момент касания запоминаем, с какой стороны пришла цена. Через окно реакции (у дневных областей 60 минут) смотрим, где цена. Если она вне области и с той же стороны, откуда пришла, реакция есть: область удержала. Если цена внутри области или уже по другую сторону, реакции нет: область пробита или цена в ней застряла.

ШАГ	ПРАВИЛО
Появление	на следующий период после своего профиля
Тест	цена коснулась области тик в тик. Считается только первый тест, после него область снимается
Откуда пришла цена	где она была минутой раньше касания
Реакция есть	в конце окна реакции цена вне области с той стороны, откуда пришла
Реакции нет	в конце окна цена внутри области или по другую сторону
Не входит в статистику	тест, где цена перед касанием уже была внутри области



Тест 5: переключатели областей и кольцо «есть реакция / нет»

Переключателей в тестах областей больше, чем в остальных, и два из них легко перепутать. «Опора» здесь та же, что везде: она отвечает за точку и тип открытия дня, в который случился тест. «Источник областей» отвечает за другое: чьи области мы тестируем. При источнике «с композитами» дни, вошедшие в композит, отдают свои области композиту: вместо пяти VAN пяти дней остаётся один VAN общего профиля.

«Ролловер» нужен из-за смены контракта. Раз в квартал фьючерс меняется, и новый контракт стоит на несколько пунктов дальше старого. Терминалы с бэк-аджастом сдвигают всю старую

историю на этот спред, и область переезжает вместе с ценами. Вариант «со сдвигом» делает так же. Вариант «без сдвига» оставляет область на той цене, где она была в старом контракте.

«Окно реакции» это чувствительность: через сколько минут после касания проверять, удержала ли область. Его можно менять и смотреть, зависит ли результат от выбора окна.

ПЕРЕКЛЮЧАТЕЛЬ	ЧТО ДЕЛАЕТ
Тест	любой, только по тренду, только против тренда
Область	все или выбранные: VAN, VAL, POC, single prints, excess
Источник областей	дневные (отдельные) профили или с композитами: области композита вместо областей его дней
Ролловер	со сдвигом на спред (как терминал с бэк-аджастом) или без сдвига (область остаётся на цене старого контракта)
Окно реакции	чувствительность: через сколько после касания проверяется реакция

ПО ТРЕНДУ И ПРОТИВ ТРЕНДА ДЛЯ ОБЛАСТЕЙ

Область может лежать по ходу тренда или против него. Различие взято из Далтона: покупка ниже value в восходящем рынке это иницилирующая активность, продажа выше value в том же рынке это ответная.

Положение области считается относительно цены открытия того периода, когда случился тест. В лонговый день область под ценой открытия это поддержка по тренду: цена откатила к ней, и мы ждём, что тренд продолжится. Область над ценой открытия в тот же день стоит на пути тренда: реакция от неё означала бы остановку движения.

ОТКРЫТИЕ	ОБЛАСТЬ НИЖЕ ЦЕНЫ ОТКРЫТИЯ	ОБЛАСТЬ ВЫШЕ ЦЕНЫ ОТКРЫТИЯ
выше VA (лонг)	по тренду [иницилирующая]	против тренда [ответная]
ниже VA (шорт)	против тренда [ответная]	по тренду [иницилирующая]
внутри VA	против тренда [ответная]	против тренда [ответная]

При открытии внутри VA рынок в балансе, и любая область считается ответной: реакция от неё это возврат в баланс.

При чтении этого разреза есть ловушка, о которой подробно написано в «Итогах тестов». Половина тестов областей случается в первый час, а тип открытия сам определяется поведением цены в первый час. Поэтому в калькуляторе теста 5 сочетания вроде «Open-Test-Drive + область по

тренду» дают очень высокие числа, которые наполовину получаются из определения. После 10:30 эти различия почти исчезают.

НЕДЕЛЯ И МЕСЯЦ: ЧЕМ ОТЛИЧАЮТСЯ ОТ ДНЯ

Недельные и месячные тесты построены по тем же правилам, что дневные, но с несколькими отличиями. Все они следуют из одного: у недели и месяца нет основной сессии и первого часа, они строятся по всем торгам.

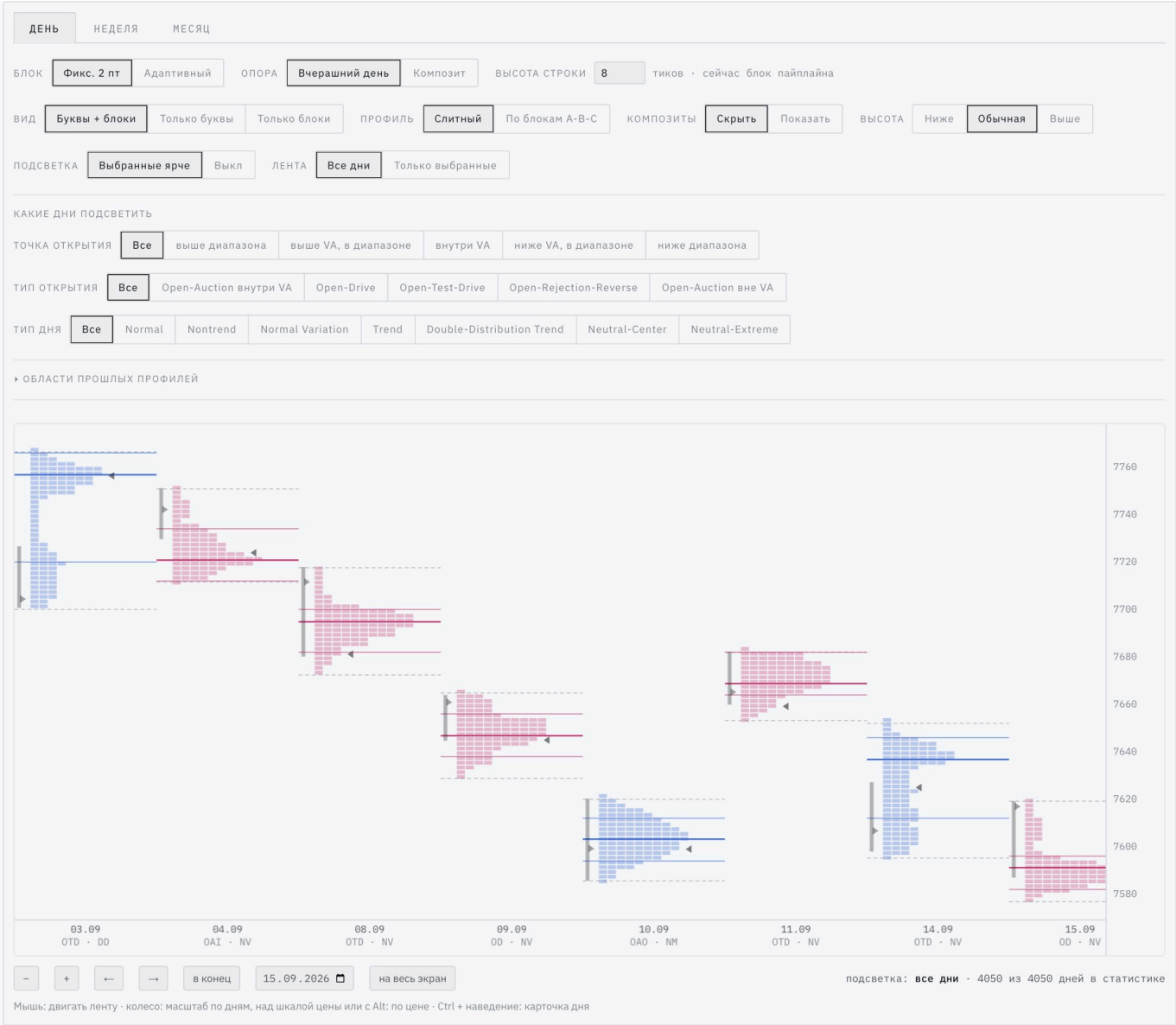
Поэтому у них нет IB, а значит нет типов открытия: калькулятор работает только по точке открытия. Тренд определяется только при открытии вне VA опоры. Тест области ищется по всем торгам Globex, включая ночь. Области живут дольше, а окно реакции шире: у старшего уровня и реакция медленнее.

	ДЕНЬ	НЕДЕЛЯ	МЕСЯЦ
Где ищется тест	только RTH	все торги Globex	все торги Globex
Срок жизни области	63 торговых дня	год, 52 недели	без срока
Окно реакции по умолчанию	60 минут	4 часа торгов	сутки Globex, 23 часа торгов
Типы открытия	есть	нет	нет
Калькулятор	точка + тип открытия	только точка открытия	только точка открытия
Тренд	по месту открытия, внутри VA по цене в 10:30	только при открытии вне VA опоры	только при открытии вне VA опоры

Если окно реакции не помещается до конца недели или месяца, оно продолжается в следующем периоде. Касание в пятницу вечером проверяется в понедельник.

ГРАФИК

График нужен, чтобы видеть глазами то, что считают тесты. На нём те же профили, по тем же правилам, с теми же ярлыками. Если день в статистике записан как Open-Drive выше диапазона, на графике он выглядит именно так, и это можно проверить.



Страница Chart, вкладка «День»: настройки, фильтры дней и сам график

У графика три вкладки: День, Неделя, Месяц. У каждой свои настройки, и они запоминаются отдельно. «Блок» и «Опора» работают как в тестах. «Высота строки» позволяет задать свою строку и сразу увидеть, как изменится профиль. «Вид» и «Профиль» меняют только отображение. «Композиты» дорисовывают склеенные профили. На дневной вкладке есть фильтры по точке открытия, типу открытия и типу дня: «Подсветка» выделяет подходящие дни, «Лента» оставляет только их.

НАСТРОЙКА	ЧТО ДЕЛАЕТ
Блок, Опора	как в тестах
Высота строки	своя строка в тиках, профиль пересчитывается на месте
Вид	буквы и блоки, только буквы или только блоки
Профиль	слитный или по блокам A-B-C
Композиты	показать склеенные профили после последнего участника

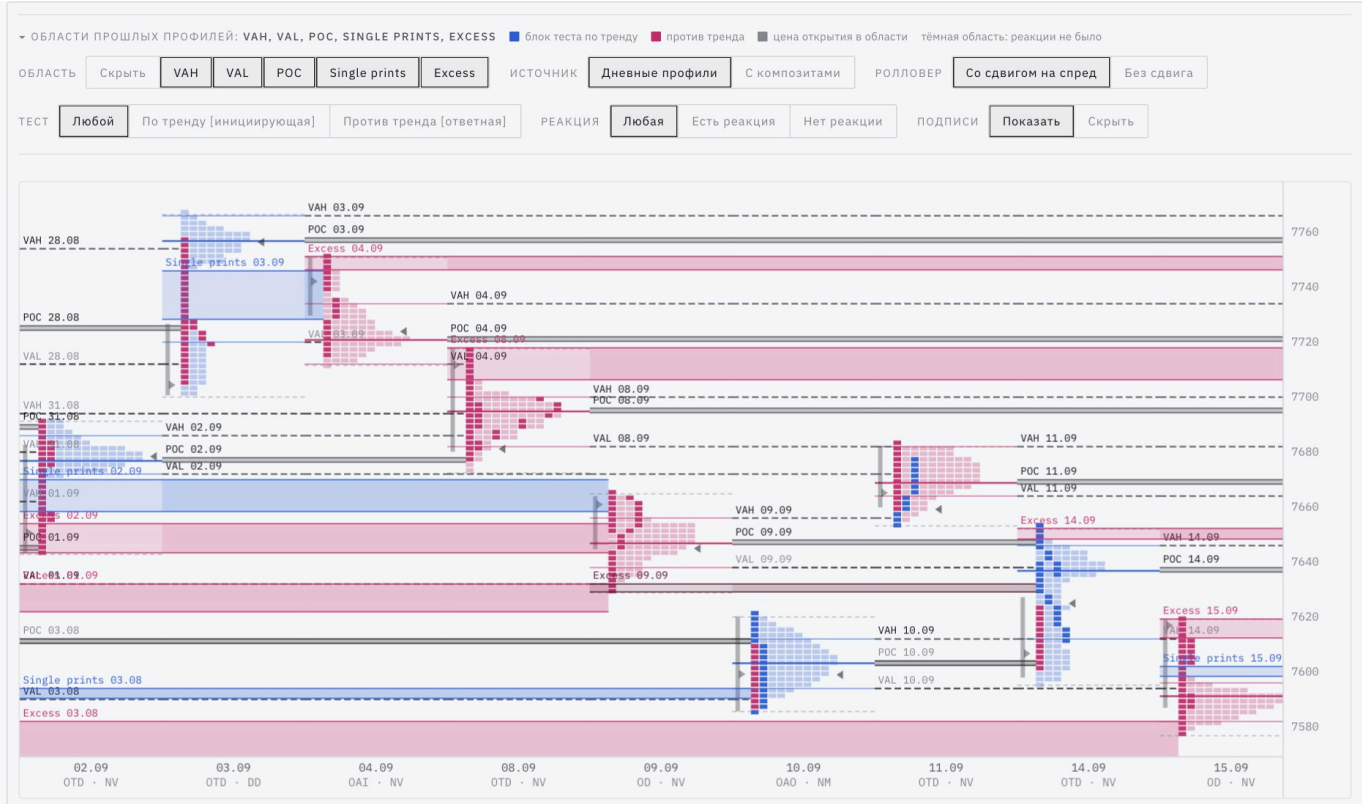
НАСТРОЙКА	ЧТО ДЕЛАЕТ
Подсветка, Лента	только у дня: выделить или оставить только выбранные дни
Какие дни подсветить	фильтры по точке, типу открытия и типу дня

На самом профиле нарисован минимум: то, что нужно для чтения, и ничего больше.

ЭЛЕМЕНТ	ЗНАЧЕНИЕ
Толстая линия	POC
Две тонкие линии	VAH и VAL
Пунктир	хай и лоу периода
Плашка слева	IB, только у дня
Стрелка слева	цена открытия
Стрелка справа у блока	цена закрытия, стоит рядом с блоком закрытия
Голубой профиль	период закрылся выше открытия
Розовый профиль	период закрылся ниже открытия

Мышью ленту можно тянуть, колесо меняет масштаб по дням, колесо над шкалой цены или с Alt меняет масштаб цены. Карточка дня со всеми его ярлыками открывается при наведении с зажатым Ctrl.

Раздел «Области прошлых профилей» свёрнут по умолчанию, и пока он свёрнут, области не рисуются. Когда раскроешь, каждая область рисуется полосой от своего профиля вправо, до того периода, где случился первый тест. Если теста ещё не было, полоса идёт до края графика.



Раскрытый раздел «Области прошлых профилей» на вкладке «День»

Цвет полосы говорит о виде области, а цвет блока теста о том, каким был тест. Область, от которой при первом тесте реакции не было, рисуется темнее: так видно сразу, где уровень не удержал.

ЧТО ВИДНО	ЗНАЧЕНИЕ
Розовая полоса	excess
Синяя полоса	single prints
Серая полоса	POC
Светлый пунктир	VAN или VAL
Полоса обрывается у профиля	область протестирована в этом периоде
Полоса идёт до края графика	область ещё не протестирована
Тёмная область	при первом тесте реакции не было
Плотно залитый голубой блок	тест по тренду
Плотно залитый розовый блок	тест против тренда
Серый блок	цена открытия оказалась внутри области

Кнопки раздела те же, что в тестах 5–7: Область, Источник, Ролловер, Тест, плюс фильтр «Реакция» (любая, есть, нет) и кнопка скрытия подписей. Реакция на графике всегда считается при окне по умолчанию, поле «Окно реакции» есть только в тестах.



ЧАСТЫЕ ПУТАНИЦЫ

Здесь собраны вопросы, которые возникали у нас по ходу работы. Почти все они про одно и то же: два похожих слова значат разное, или число выглядит странно, потому что часть результата заложена в определение.

ВОПРОС	ОТВЕТ
Почему у дня с открытием внутри VA есть тренд?	Потому что в 10:30 цена стояла за VA. Тренд = сторона выхода
Почему у дня с открытием внутри VA нет тренда, хотя он пробивал VA?	К 10:30 цена вернулась в VA. Это Open-Auction внутри VA
Тумблер «Открытие внутри VA» убирает тип Open-Auction внутри VA?	Нет, он убирает все дни с точкой открытия внутри VA
Почему в списке типов есть «Open-Auction внутри VA» при точке «выше VA»?	Список всегда полный. Несочетаемый выбор даёт «нет таких дней»
Чем «Опора» отличается от «Источника областей»?	Опора про открытие дня, источник про то, чьи области тестируются
Почему числа в «по тренду» такие высокие при открытии внутри VA?	Тренд там берётся по цене в 10:30, цена уже у нужной границы. Сравнить честнее с тумблером «исключить»

ВОПРОС	ОТВЕТ
Почему область на графике прыгает в день ролла?	Включён сдвиг на спред. Переключатель «Ролловер: без сдвига» оставит её на старой цене
Почему тип дня нельзя выбрать в калькуляторе?	Он известен только после закрытия
Что значит «п.п.»?	Разница между долей в выборе и долей во всей выборке
Почему неделя или месяц без типов открытия?	Типы открытия построены на IB, а у недели и месяца его нет
Какому режиму блока верить?	Тому, что видно в обоих. Фиксированный совпадает с терминалом, адаптивный сравним по годам

ЧЕМУ ДОВЕРЯТЬ И ЧЕМУ НЕТ

Все тесты на сайте описательные. Они показывают, как часто что-то случалось, и не говорят, что с этим делать. Порогов «прошло / не прошло» нет нарочно: выводы остаются за тобой.

При чтении любого числа полезно задать себе три вопроса. Сколько дней за ним стоит: несколько десятков или несколько сотен. Держится ли оно в обоих режимах блока и в обеих половинах истории. И не заложено ли оно в определение: если условие и исход построены на одном и том же первом часе, высокая доля ничего не предсказывает.

Третий вопрос самый важный, и он касается нескольких мест сразу. Open-Drive по определению имеет малый откат, поэтому «худшая цена дня в первый час» у него частая. Тренд дня с открытием внутри VA берётся по цене в 10:30, поэтому граница IB «по тренду» у него уже рядом. Тип открытия определяется первым часом, поэтому реакция на область, протестированную в первый час, связана с типом по построению.

Подробный разбор с числами, проверками и оговорками вынесен на отдельную страницу «Итоги тестов». Данные: ES, минутки Databento, с 08.06.2010 по 15.09.2026, 4050 полных дней RTH.