

ИТОГИ ТЕСТОВ

ОТЧЁТ ОТ 04.10.2026 · ДАННЫЕ ES С 08.06.2010 ПО 15.09.2026

КОРОТКО

Отчёт написан Claude по просьбе трейдера 04.10.2026. Это мой разбор чисел, а не правила системы. Торговые решения остаются за тобой.

- 1. **Готового преимущества в десяти тестах нет.** Нет ни одной связки «условие → исход», которая после проверки на честность давала бы заметно больше 55 %.
- 2. **Самые красивые числа объясняются ценой в 10:30, а не типом открытия.** Open-Drive и Open-Test-Drive по определению к 10:30 стоят у границы IB по тренду. Любой день, где цена в 10:30 у границы IB, потом тестирует именно её. Тип открытия добавляет к этому 0–4 п.п.
- 3. **После 10:30 направление почти монета.** Закрытие дальше цены 10:30 по тренду открытия: Open-Drive 55 %, Open-Test-Drive 50 %, Open-Auction вне VA 51 %, Open-Rejection-Reverse 46 %. При этом любой день закрывается выше цены 10:30 в 54 % случаев: это общий рост рынка.
- 4. **Области прошлых профилей не работают как уровни сами по себе.** Реакция при первом тесте 48–53 % на дневных, недельных и месячных профилях, при любом окне, источнике и ролловере.
- 5. **Тип дня от открытия почти не зависит.** Normal Variation 63–65 % при любом открытии.
- 6. **Экстремумы стоят по краям** дня, недели и месяца. Это устойчиво, но так же ведёт себя случайное блуждание. Перекос (лоу в начале, хай в конце) это рост рынка за 16 лет.
- 7. **Что реально полезно:** базовые частоты для стопа и цели (таблицы ниже) и понимание, какие числа на сайте заложены в определения. Лонговые дни держатся лучше шортовых почти во всех разрезах.

КАК Я ПРОВЕРЯЛ

| ПРОВЕРКА                                     | ЗАЧЕМ                                                                                |
|----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------|
| Оба режима блока: фиксированный и адаптивный | вывод должен держаться в обоих                                                       |
| Две половины истории: 2010–2018 и 2019–2026  | вывод должен держаться в обеих                                                       |
| Размер выборки и интервал 95 %               | при 50–100 днях разница в 10 п.п. может быть шумом                                   |
| Что известно в момент решения                | тип открытия известен в 10:30, значит честно считать только то, что было после 10:30 |
|                                              |                                                                                      |

| ПРОВЕРКА                  | ЗАЧЕМ                                                                                                         |
|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Сравнение с простой базой | что даёт то же условие без Market Profile: положение цены в IB в 10:30, общий рост рынка, случайное блуждание |

Интервал в квадратных скобках: диапазон, в котором с вероятностью 95 % лежит настоящая доля. Если интервалы двух групп пересекаются, разницу считать недоказанной.

Режимы совпадают не полностью: точка открытия одинакова у 92 % дней, тип открытия у 89 %. Опора «вчера» и «композит» дают одну точку открытия у 93 % дней. Все основные числа ниже при фиксированном блоке и опоре «вчера»; в адаптивном они отличаются на 1–2 п.п., где больше, сказано отдельно.

ТЕСТ 1. ТИП ДНЯ

Тип дня почти не зависит от точки и типа открытия.

| ТИП ОТКРЫТИЯ           | ДНЕЙ | NORMAL VARIATION | NORMAL | TREND | DOUBLE - DISTRIBUTION TREND | NEUTRAL (ОБА) |
|------------------------|------|------------------|--------|-------|-----------------------------|---------------|
| Все дни                | 4050 | 65.0 %           | 9.9 %  | 6.4 % | 3.5 %                       | 14.1 %        |
| Open-Drive             | 780  | 65.3 %           | 12.4 % | 8.2 % | 2.3 %                       | 10.9 %        |
| Open-Test-Drive        | 1077 | 65.0 %           | 10.5 % | 6.8 % | 3.5 %                       | 13.3 %        |
| Open-Rejection-Reverse | 521  | 66.2 %           | 13.1 % | 7.5 % | 4.2 %                       | 8.5 %         |
| Open-Auction вне VA    | 740  | 65.4 %           | 7.2 %  | 4.6 % | 4.7 %                       | 17.4 %        |
| Open-Auction внутри VA | 932  | 63.9 %           | 7.6 %  | 5.3 % | 3.2 %                       | 18.1 %        |

- Самая большая разница по Trend: «выше диапазона + Open-Drive» 10.0 % против 6.4 % (250 дней, это 25 трендовых дней). В адаптивном блоке 8.4 % против 5.1 %. Сдвиг есть, но 9 из 10 таких дней трендовыми не становятся.
- Open-Auction (оба) чаще даёт Neutral: 17–18 % против 9–13 % у остальных. Логично, но тоже слабо.
- Доля Double-Distribution Trend зависит от режима блока: 3.5 % в фиксированном, 7.0 % в адаптивном. В фиксированном она ещё и выросла с 1.1 % (2010–2018) до 6.2 % (2019–2026):

строка 2 пт стала мелкой для нынешней цены. Этому типу в фиксированном режиме я бы не доверял.

- Если день всё же стал Trend или Double-Distribution Trend, то после Open-Drive он идёт по тренду открытия в 90 % случаев (82 дня), после Open-Test-Drive в 87 % (111 дней). Но это взгляд назад: в 10:30 ты не знаешь, что день станет трендовым.

Вывод: предсказывать тип дня по открытию нельзя. Самая честная ставка в 10:30 в любой ситуации: «будет Normal Variation».

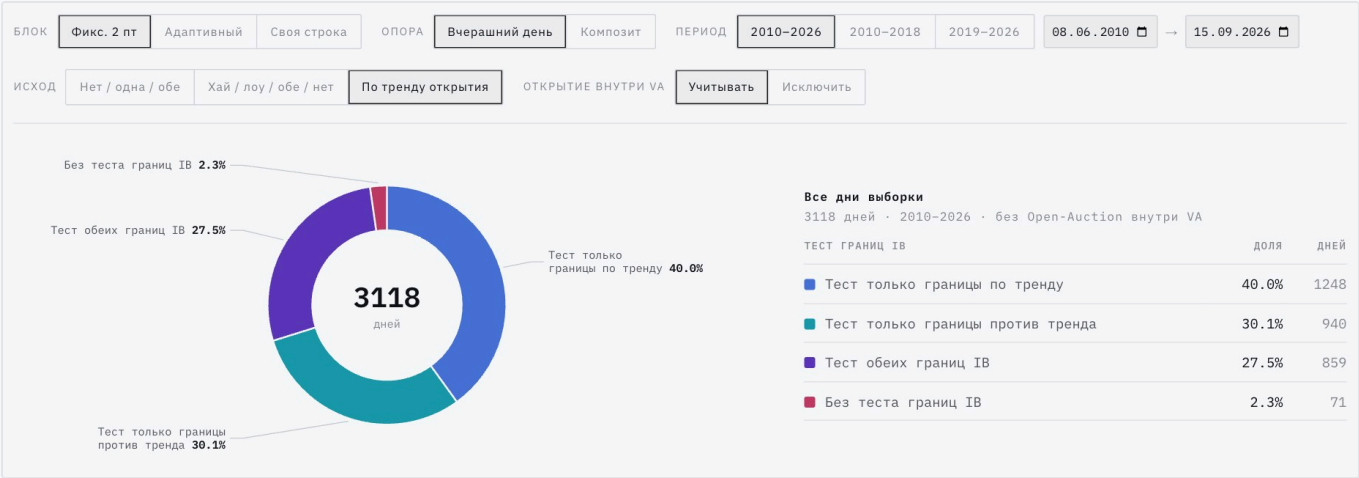
ТЕСТ 2. ТИП ОТКРЫТИЯ ПО МЕСТУ ОТКРЫТИЯ

| ТОЧКА ОТКРЫТИЯ       | ДНЕЙ | OPEN - DRIVE | OPEN - TEST - DRIVE | OPEN - REJECTION - REVERSE | OPEN - AUCTION BHE VA | OPEN - AUCTION ВНУТРИ VA |
|----------------------|------|--------------|---------------------|----------------------------|-----------------------|--------------------------|
| выше диапазона       | 1035 | 24.2 %       | 27.1 %              | 15.2 %                     | 33.6 %                |                          |
| выше VA, в диапазоне | 432  | 14.6 %       | 35.2 %              | 33.8 %                     | 16.4 %                |                          |
| внутри VA            | 1560 | 19.7 %       | 20.5 %              |                            |                       | 59.7 %                   |
| ниже VA, в диапазоне | 398  | 12.1 %       | 37.7 %              | 32.2 %                     | 18.1 %                |                          |
| ниже диапазона       | 625  | 17.8 %       | 28.0 %              | 14.4 %                     | 39.8 %                |                          |

- Открытие за диапазоном: возврат в VA редкий (Open-Rejection-Reverse 14–15 %), чаще всего аукцион вне VA (34–40 %).
- Открытие в диапазоне, но вне VA: каждый третий день возвращается в VA к 10:30 (Open-Rejection-Reverse 32–34 %).
- Открытие внутри VA: в 60 % случаев цена в 10:30 всё ещё внутри.
- В фиксированном блоке доля Open-Auction внутри VA упала с 26 % до 19 % между половинами истории, в адаптивном стоит на 18.5 %. Причина та же: строка 2 пт. Для сравнения разных лет надёжнее адаптивный режим.

Это полезная описательная таблица. Преимущества в ней нет: в 09:30 по месту открытия нельзя назвать тип с вероятностью выше 40 %.

ТЕСТ 3. ГРАНИЦЫ IB: ГЛАВНЫЙ РЕЗУЛЬТАТ И ГЛАВНАЯ ОГОВОРКА



Тест 3 на сайте: вид «По тренду открытия»

Без условий (все 4050 дней, после 10:30): только хай IB 37.8 %, только лоу 30.6 %, обе 29.7 %, ни одной 2.0 %. Одинаково в обеих половинах истории.

По тренду открытия, только открытия вне VA (2490 дней): только граница по тренду 35.2 %, только против 34.6 %. **Сам по себе тренд по месту открытия не даёт ничего.** Разницу создаёт тип открытия:

| ТИП ОТКРЫТИЯ (ВНЕ VA)  | ДНЕЙ | ТОЛЬКО ПО ТРЕНДУ | ТОЛЬКО ПРОТИВ | ОБЕ    | НИ ОДНОЙ |
|------------------------|------|------------------|---------------|--------|----------|
| Open-Drive             | 472  | 55.9 %           | 17.2 %        | 24.8 % | 2.1 %    |
| Open-Test-Drive        | 757  | 48.9 %           | 18.1 %        | 31.3 % | 1.7 %    |
| Open-Auction вне VA    | 740  | 22.7 %           | 44.9 %        | 30.7 % | 1.8 %    |
| Open-Rejection-Reverse | 521  | 14.4 %           | 59.9 %        | 22.8 % | 2.9 %    |

Выглядит сильно. Теперь та же таблица без Market Profile вообще: все дни, разбитые только по тому, где цена стоит внутри IB в 10:30.

| ЦЕНА В 10:30 ВНУТРИ IB | ДНЕЙ | ТОЛЬКО ХАЙ IB | ТОЛЬКО ЛОУ IB | ОБЕ    |
|------------------------|------|---------------|---------------|--------|
| верхняя четверть       | 1248 | 63.3 %        | 7.7 %         | 27.9 % |
| вторая сверху          | 958  | 44.2 %        | 23.3 %        | 30.1 % |
| вторая снизу           | 906  | 26.9 %        | 39.8 %        | 30.4 % |
|                        |      |               |               |        |

| ЦЕНА В 10:30 ВНУТРИ IB | ДНЕЙ | ТОЛЬКО ХАЙ IB | ТОЛЬКО ЛОУ IB | ОБЕ    |
|------------------------|------|---------------|---------------|--------|
| нижняя четверть        | 938  | 7.8 %         | 59.5 %        | 30.9 % |

59 % дней Open-Drive и Open-Test-Drive в 10:30 стоят в четверти IB у границы по тренду, 64 % дней Open-Rejection-Reverse в четверти у противоположной. Если сравнить типы при одинаковом положении цены (четверть у границы по тренду):

| ГРУППА               | ДНЕЙ | ТОЛЬКО ПО ТРЕНДУ | ТОЛЬКО ПРОТИВ | ОБЕ    |
|----------------------|------|------------------|---------------|--------|
| Любой день с трендом | 1134 | 63.1 %           | 8.2 %         | 27.1 % |
| Open-Drive           | 463  | 67.4 %           | 8.2 %         | 23.1 % |
| Open-Test-Drive      | 640  | 61.4 %           | 7.5 %         | 29.2 % |

**Вывод: тест 3 измеряет близость цены к границе, а не силу типа открытия.** Open-Drive добавляет около 4 п.п. к простому правилу «цена в 10:30 у хая IB, значит дальше тестируется хай», Open-Test-Drive не добавляет ничего. То же самое с плиткой «Какая граница первой»: 74–77 % «первой по тренду» у Open-Drive и Open-Test-Drive это та же близость.

Что из теста 3 всё же можно взять:

| НАБЛЮДЕНИЕ                                                                                | ЧИСЛО                      | УСТОЙЧИВОСТЬ                                         |
|-------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|------------------------------------------------------|
| Обе границы IB за день тестируются редко                                                  | 28–30 %                    | одинаково во всех разрезах и половинах истории       |
| День целиком внутри IB                                                                    | 2 %                        | одинаково везде                                      |
| Open-Drive выше диапазона: противоположная граница IB не тронута до конца дня             | 65 % [59..71],<br>250 дней | 70 % в 2010–2018, 60 % в 2019–2026; оба режима блока |
| Open-Drive ниже диапазона: то же                                                          | 52 % [43..61],<br>111 дней | шорт заметно слабее лонга                            |
| Открытие внутри VA с выходом (оба типа): противоположная граница не тронута               | 62 % [57..67],<br>628 дней | 59–66 % в обеих половинах                            |
| Open-Rejection-Reverse выше или ниже диапазона: граница против места открытия тестируется | 83–87 %                    | оба режима                                           |

Число 62–65 % для «нетронутой» границы честное, но помни: в эти дни цена в 10:30 уже далеко от этой границы. И 35–40 % таких дней границу всё-таки берут.

## ЧТО ПРОИСХОДИТ ПОСЛЕ 10:30

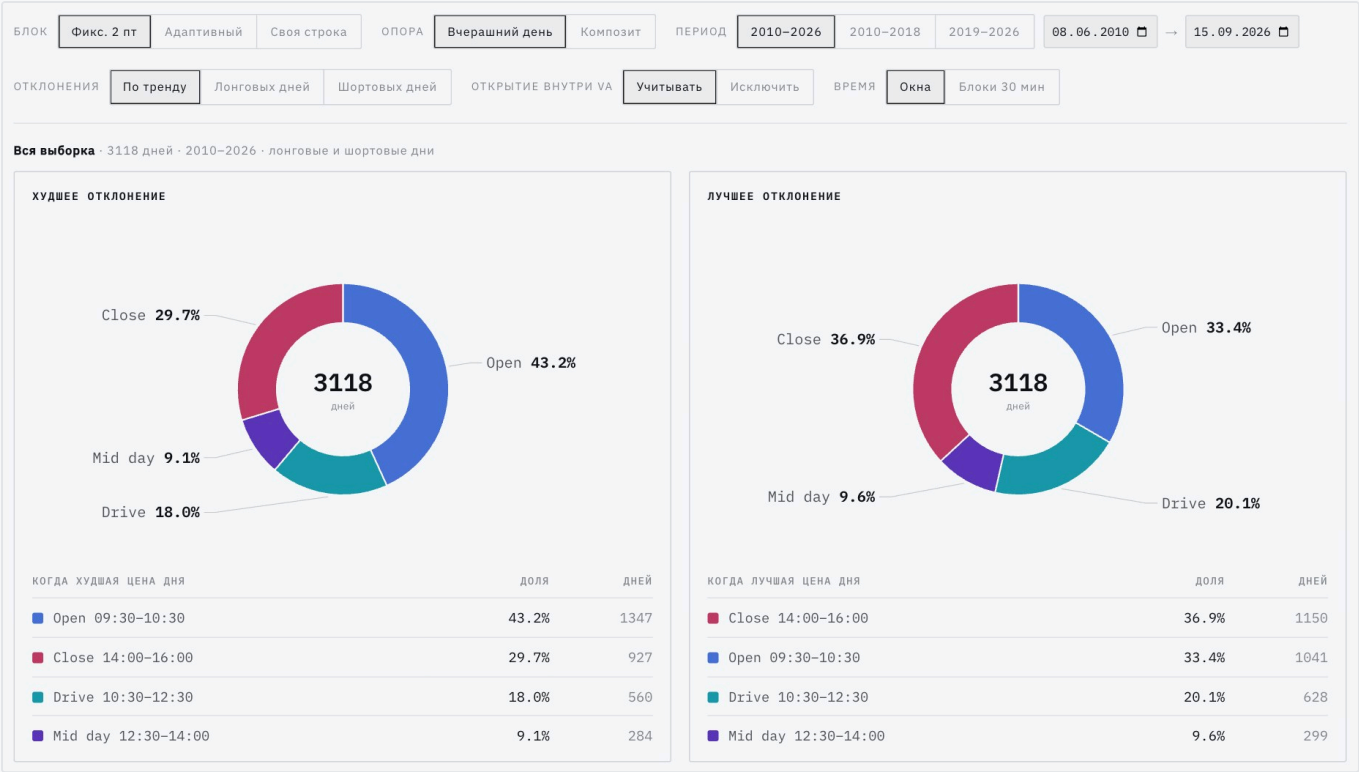
Этого теста на сайте нет, я посчитал его для отчёта по 30-минутным блокам. Вопрос: тип открытия известен в 10:30, цена такая-то. Где будет закрытие дня относительно этой цены?

| ТИП ОТКРЫТИЯ                               | ДНЕЙ | ЗАКРЫТИЕ<br>ДАЛЬШЕ ЦЕНЫ<br>10:30 ПО<br>ТРЕНДУ | ЛОНГ      | ШОРТ      | МЕДИАНА<br>ХОДА ПО<br>ТРЕНДУ<br>ПОСЛЕ 10:30 | МЕДИАНА<br>ХОДА<br>ПРОТИВ |
|--------------------------------------------|------|-----------------------------------------------|-----------|-----------|---------------------------------------------|---------------------------|
| Open-Drive                                 | 780  | 55.4 % [52..59]                               | 58.1<br>% | 51.0<br>% | 0.63 IB                                     | 0.53 IB                   |
| Open-Test-Drive                            | 1077 | 50.0 % [47..53]                               | 55.8<br>% | 42.7<br>% | 0.64 IB                                     | 0.69 IB                   |
| Open-Auction вне<br>VA                     | 740  | 50.9 % [47..55]                               | 53.7<br>% | 47.4<br>% | 0.71 IB                                     | 0.75 IB                   |
| Open-Rejection-<br>Reverse                 | 521  | 45.7 % [42..50]                               | 47.5<br>% | 43.1<br>% | 0.55 IB                                     | 0.66 IB                   |
| Любой день:<br>закрытие выше<br>цены 10:30 | 4050 | 54.3 %                                        |           |           |                                             |                           |

- У Open-Rejection-Reverse тренд считается по месту открытия, поэтому 45.7 % значит: разворот продолжается после 10:30 в 54 % дней.
- Ход считается в ширинах IB этого дня: 0.63 IB значит, что в половине дней цена после 10:30 прошла по тренду не меньше 63 % ширины IB.
- Единственный тип с перевесом: Open-Drive, и почти весь перевес в лонге (58 %). Но любой день закрывается выше цены 10:30 в 54 % случаев. Чистая добавка Open-Drive к общему росту рынка около 4 п.п.
- Шортовые Open-Test-Drive после 10:30 чаще откатывают, чем продолжают (43 %).
- Ход по тренду и против после 10:30 примерно равны у всех типов, кроме Open-Drive (0.63 против 0.53).

**Вывод:** к 10:30 основное движение, которое сделало день «драйвом», уже позади. Тип открытия описывает первый час, а не предсказывает остаток дня.

ТЕСТ 4. ВРЕМЯ ЭКСТРЕМУМОВ ДНЯ



Тест 4 на сайте: худшее и лучшее отклонение по окнам

Сырые данные, без тренда:

| ОКНО                | ХАЙ ДНЯ | ЛОУ ДНЯ | СЛУЧАЙНОЕ БЛУЖДЕНИЕ |
|---------------------|---------|---------|---------------------|
| Open 09:30–10:30    | 33.8 %  | 40.7 %  | 25.7 %              |
| Drive 10:30–12:30   | 18.1 %  | 21.1 %  | 21.9 %              |
| Mid day 12:30–14:00 | 9.6 %   | 9.6 %   | 15.0 %              |
| Close 14:00–16:00   | 38.6 %  | 28.6 %  | 37.4 %              |

Столбец «случайное блуждание»: сколько экстремумов попало бы в окно, если бы цена шла случайно с одинаковой скоростью весь день. Экстремумы по краям дня бывают у любого случайного ряда, это не свойство рынка. От случайного ряда рынок отличается двумя вещами: первый час даёт больше экстремумов (там выше волатильность), середина дня меньше. Блок А один ставит хай в 24 % дней и лоу в 30 %, блок М хай в 22 % и лоу в 15 %.

По типам открытия:

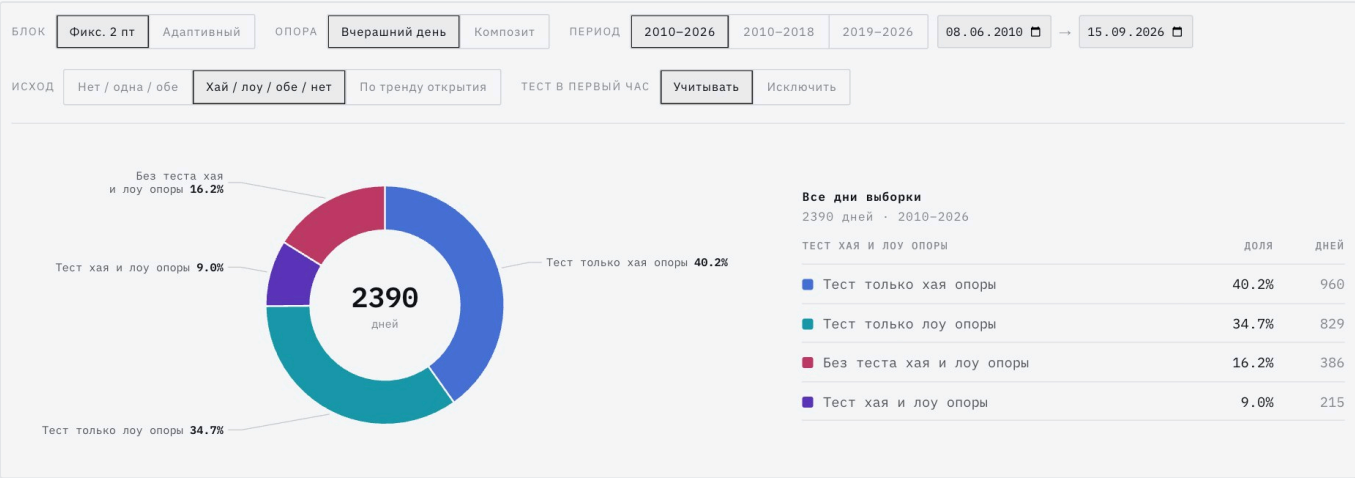
| ТИП ОТКРЫТИЯ    | ДНЕЙ | ХУДШАЯ ЦЕНА В ПЕРВЫЙ ЧАС | ЛУЧШАЯ ЦЕНА В ПЕРВЫЙ ЧАС | ЛУЧШАЯ ЦЕНА В CLOSE |
|-----------------|------|--------------------------|--------------------------|---------------------|
| Open-Drive      | 780  | 59.9 %                   | 18.8 %                   | 44.7 %              |
| Open-Test-Drive | 1077 | 55.1 %                   | 19.8 %                   | 41.3 %              |

| ТИП ОТКРЫТИЯ           | ДНЕЙ | ХУДШАЯ ЦЕНА В ПЕРВЫЙ ЧАС | ЛУЧШАЯ ЦЕНА В ПЕРВЫЙ ЧАС | ЛУЧШАЯ ЦЕНА В CLOSE |
|------------------------|------|--------------------------|--------------------------|---------------------|
| Open-Auction вне VA    | 740  | 25.5 %                   | 47.2 %                   | 31.8 %              |
| Open-Rejection-Reverse | 521  | 18.8 %                   | 63.7 %                   | 23.2 %              |

- «Худшая цена в первый час» у Open-Drive 60 %: это то же число, что «противоположная граница IB не тронута» из теста 3, с той же оговоркой про близость.
- Обратная сторона: в 40 % дней Open-Drive и в 45 % дней Open-Test-Drive цена после 10:30 уходит за экстремум первого часа против тренда.
- Лучшая цена у драйвов приходится на Close в 41–45 % дней. Сравни со случайным блужданием: 37 %. Разница есть, но небольшая.
- У Open-Rejection-Reverse и Open-Auction вне VA картина зеркальная: экстремум «по тренду места открытия» уже поставлен в первый час и не обновляется в 64 % и 47 % дней.

Вывод: тест даёт рабочие частоты «экстремум первого часа устоит или нет», но не преимущество. Числа устойчивы в обоих режимах и обеих половинах истории.

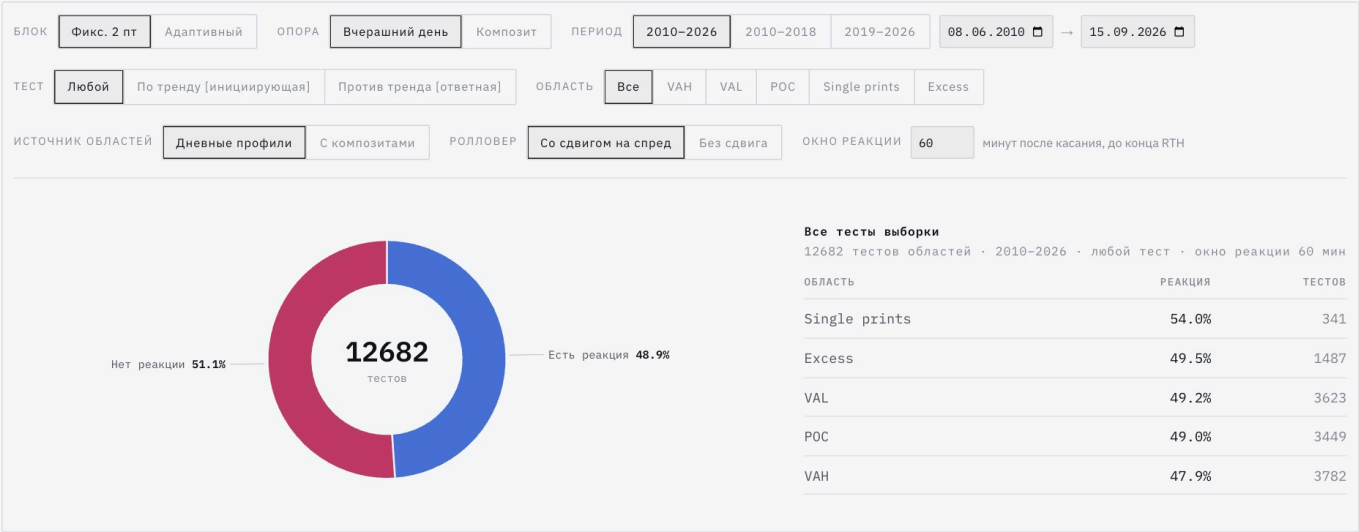
### ТЕСТ 10. ВЧЕРАШНИЕ ХАЙ И ЛОУ



| ГРУППА, БЕЗ ТЕСТОВ<br>ПЕРВОГО ЧАСА                | ДНЕЙ | ТОЛЬКО ПО<br>ТРЕНДУ | ТОЛЬКО<br>ПРОТИВ | ОБЕ   | НИ<br>ОДНОЙ |
|---------------------------------------------------|------|---------------------|------------------|-------|-------------|
| Все дни с трендом                                 | 445  | 47.4 %              | 19.8 %           | 2.9 % | 29.9 %      |
| Open-Test-Drive                                   | 174  | 60.9 %              | 8.6 %            | 4.0 % | 26.4 %      |
| Open-Drive                                        | 71   | 56.3 %              | 12.7 %           | 1.4 % | 29.6 %      |
| Open-Rejection-Reverse                            | 148  | 27.0 %              | 39.2 %           | 3.4 % | 30.4 %      |
| Open-Auction внутри VA (тренда<br>нет: хай / лоу) | 690  | 33.9 %              | 25.8 %           | 3.6 % | 36.7 %      |

- Число 74 % «только по тренду» с включённым первым часом завышено: половина этих тестов случилась до того, как тип открытия стал известен.
- После 10:30 у драйвов вчерашний экстремум по тренду достигается в 57–65 % дней (с учётом «обе»), противоположный в 12–14 %. Это самая пригодная пара чисел во всём наборе: цель по тренду достигается примерно в 3 случаях из 5, а в 26–30 % дней цена не доходит ни до одной границы.
- Оговорка та же: в 10:30 цена уже за VA в сторону этого экстремума, то есть ближе к нему. И выборки малы: 71 и 174 дня, интервал для 56 % это примерно 45–67 %.
- Open-Auction внутри VA: до 10:30 ничего не задето, дальше 37 % дней так и остаются внутри вчерашнего диапазона. Обе границы почти никогда (3.6 %).
- С опорой «композит» доля «ни одной» выше (21 % против 16 %): диапазон композита шире.

ТЕСТЫ 5–7. ОБЛАСТИ ПРОШЛЫХ ПРОФИЛЕЙ



Тест 5 на сайте: реакция на области дневных профилей

| ПРОФИЛЬ                        | ТЕСТОВ | ЕСТЬ РЕАКЦИЯ | ИНТЕРВАЛ 95 % |
|--------------------------------|--------|--------------|---------------|
| Дневной, окно 60 минут         | 12 682 | 48.9 %       | 48.0–49.8     |
| Дневной, адаптивный блок       | 14 328 | 49.4 %       | 48.6–50.2     |
| Дневной, области с композитами | 9 002  | 47.9 %       | 46.9–49.0     |
| Недельный, окно 4 часа         | 2 731  | 51.6 %       | 49.7–53.5     |
| Месячный, окно сутки           | 630    | 53.3 %       | 49.4–57.2     |

По типам областей (дневные): VAH 47.9 %, VAL 49.2 %, POC 49.0 %, excess 49.5 %, single prints 54.0 % (341 тест, интервал 49–59). Ни одна область не отличается от монеты достоверно.

Что не меняет картину:

| ПЕРЕКЛЮЧАТЕЛЬ                                         | РЕЗУЛЬТАТ                             |
|-------------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Окно реакции 15 / 30 / 60 / 120 / 240 минут           | 51.7 / 50.3 / 48.9 / 48.8 / 49.1 %    |
| Ролловер без сдвига                                   | 48.6 % против 48.9 %                  |
| Свежая область (1 день) против старой (больше 4 дней) | 50.1 % против 47.7 %                  |
| Источник: с композитами                               | 47.9 %                                |
| Половины истории                                      | в пределах 1–3 п.п. по каждой области |

Ловушка, которую видно в калькуляторе теста 5. По типам открытия числа выглядят огромными:

| ГРУППА                                        | ВСЕ<br>ТЕСТЫ | ТЕСТ В ПЕРВЫЙ<br>ЧАС | ТЕСТ ПОСЛЕ<br>10:30 |
|-----------------------------------------------|--------------|----------------------|---------------------|
| Open-Test-Drive, область по тренду            | 74.9 %       | 97.1 %               | 51.8 %              |
| Open-Drive, область против тренда             | 29.5 %       | 21.1 %               | 46.8 %              |
| Open-Rejection-Reverse, область против тренда | 69.8 %       | 99.1 %               | 52.5 %              |
| Open-Auction внутри VA                        | 59.6 %       | 69.4 %               | 50.1 %              |

Половина всех тестов областей случается в первый час. А тип открытия сам определяется тем, что цена сделала в первый час. Open-Test-Drive это и есть «сходили вниз, вернулись вверх»: область под ценой открытия в такой день «сработала» по определению. **После 10:30 все эти различия исчезают: 47–53 % в любой группе.** Именно это убирает кнопка «без тестов первого часа» из TODO: пока её нет, калькулятор теста 5 по типам открытия читать нельзя.

Что остаётся после 10:30:

| ОБЛАСТЬ, ТЕСТ ПОСЛЕ<br>10:30 | ПО<br>ТРЕНДУ     | ПРОТИВ<br>ТРЕНДА | АДАПТИВНЫЙ: ПО ТРЕНДУ /<br>ПРОТИВ |
|------------------------------|------------------|------------------|-----------------------------------|
| VAH                          | 52.7 %<br>(640)  | 46.8 % (556)     | 52.1 / 46.1 %                     |
| POC                          | 51.1 %<br>(803)  | 47.0 % (460)     | 51.0 / 47.2 %                     |
| Excess                       | 52.0 %<br>(256)  | 45.6 % (349)     | 53.1 / 45.0 %                     |
| VAL                          | 48.2 %<br>(757)  | 51.7 % (561)     | 49.1 / 53.8 %                     |
| Все области                  | 50.8 %<br>(2530) | 48.3 % (1992)    | 51.3 / 47.7 %                     |

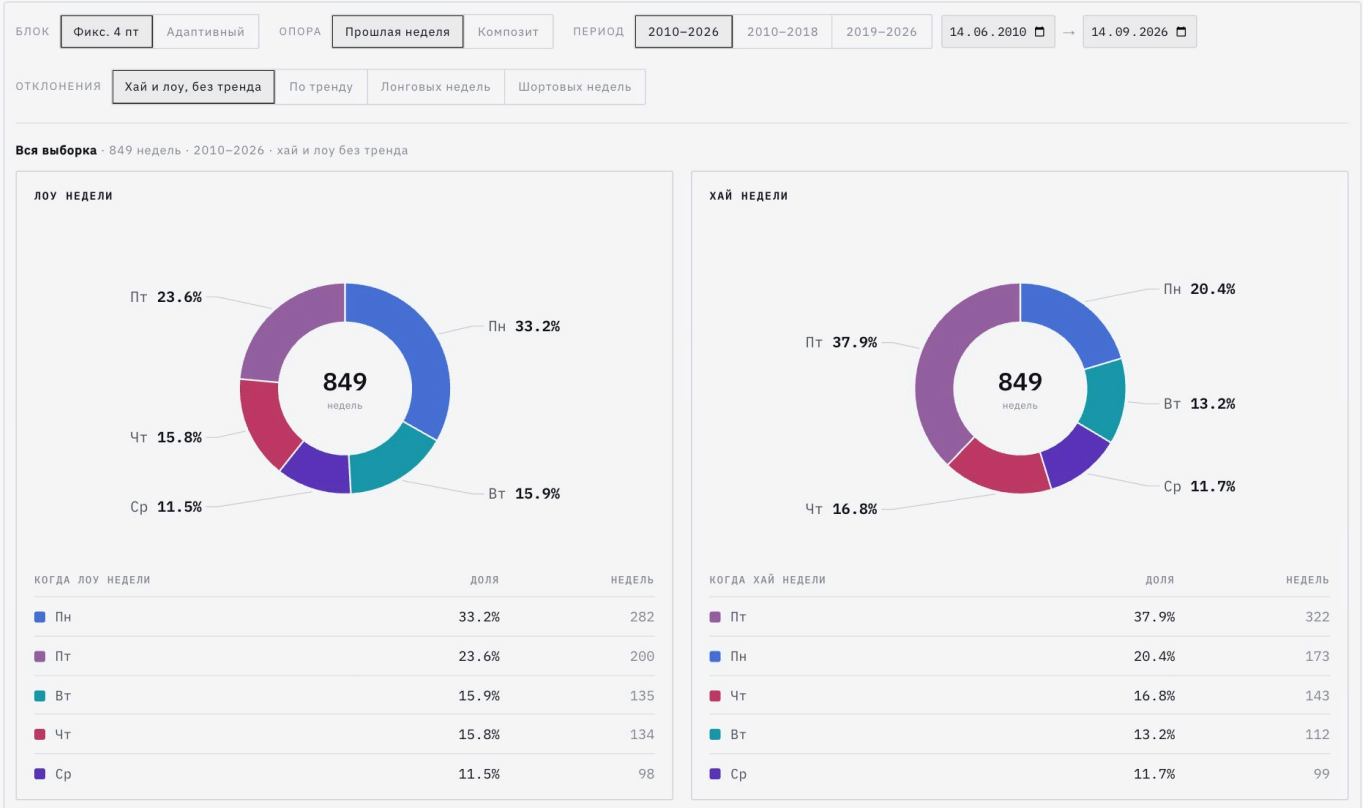
Есть слабый намёк: VAH, POC и excess по тренду держат на 4–7 п.п. чаще, чем против тренда, и это повторяется в обоих режимах блока. Но разница на грани шума, VAL ведёт себя наоборот, а в 2019–2026 общая разница сжалась до 49.2 против 47.6 %. Преимуществом я бы это не назвал.

Недельные single prints: 55–57 % в обоих режимах и обеих половинах (158 и 274 теста).

Единственная область, которая стабильно чуть выше 50 %, но интервал 47–63 и 51–62.

**Вывод:** «цена коснулась области прошлого профиля» как событие ничего не говорит о том, отскочит она или пройдёт. Области нужны как ориентиры на графике, решение об отскоке приходится брать из другого источника.

ТЕСТЫ 8 И 9. НЕДЕЛЯ И МЕСЯЦ



- Форма «края чаще середины» совпадает со случайным блужданием. Перекос «лоу в начале, хай в конце» это рост рынка: ES за эти годы вырос в несколько раз.
- Середина недели (вторник–четверг) ставит экстремум реже, но ненамного реже случайного.
- По точке открытия: неделя с открытием ниже VA ставит лоу в понедельник в 40 % (127 недель), неделя выше VA ставит хай в пятницу в 36 % (232 недели). Отличие от общих 33 % и 38 % в пределах шума. У месяца трендовых периодов всего 84, делить их по зонам бессмысленно.

Вывод: устойчивый факт про форму недели и месяца, но не про Market Profile. Точка открытия недели и месяца ничего не добавляет.

#### ЧТО ДЕЛАЮТ ТУМБЛЕРЫ С ВЫВОДАМИ

| ТУМБЛЕР                                   | ВЛИЯНИЕ                                                                                                                         |
|-------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Блок: фиксированный / адаптивный          | выводы не меняются. Доли Double-Distribution Trend и Open-Auction внутри VA в фиксированном плывут по годам, в адаптивном стоят |
| Опора: вчера / композит                   | выводы не меняются, числа сдвигаются на 1–3 п.п.                                                                                |
| Период: 2010–2018 / 2019–2026             | основные доли одинаковые. Лонговый Open-Drive выше диапазона ослаб: нетронутая граница 70 % → 60 %                              |
| Открытие внутри VA: исключить             | важный. Без этих дней тренд по месту открытия в тесте 3 даёт 35.2 % против 34.6 %, то есть ничего                               |
| Тест в первый час: исключить              | важный. Убирает из теста 10 половину дней и снижает «по тренду» с 74 % до 47 %                                                  |
| Источник областей, Ролlover, Окно реакции | ничего не меняют: реакция остаётся около 50 %                                                                                   |

#### ИТОГОВАЯ ОЦЕНКА

| УТВЕРЖДЕНИЕ                                                 | ОЦЕНКА                                                                    |
|-------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------|
| Тип открытия предсказывает тип дня                          | нет                                                                       |
| Тип открытия предсказывает направление после 10:30          | почти нет. Open-Drive в лонг 58 % при общих 54 %                          |
| Open-Drive и Open-Test-Drive тестируют границу IB по тренду | да, но это следствие положения цены в 10:30. Добавка самого типа 0–4 п.п. |
|                                                             |                                                                           |

| УТВЕРЖДЕНИЕ                                         | ОЦЕНКА                                                                   |
|-----------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------|
| После драйва противоположная граница IB устоит      | 60–65 % в лонге, около 52 % в шорте. Честное число, но перевес небольшой |
| После драйва вчерашний экстремум по тренду достигим | 57–65 % после 10:30, выборка мала                                        |
| Области прошлых профилей дают отскок                | нет, 48–53 %                                                             |
| Область по тренду лучше области против              | в первый час это заложено в определение, после 10:30 разница 2–3 п.п.    |
| Композиты улучшают что-либо                         | нет                                                                      |
| Недельные и месячные профили улучшают что-либо      | нет                                                                      |
| Экстремумы по краям периода                         | да, устойчиво, но это свойство любого ряда плюс рост рынка               |
| Лонг держится лучше шорта                           | да, везде. Это рост рынка, а не Market Profile                           |

#### ЧЕГО В ЭТИХ ТЕСТАХ НЕТ

- **Нет цены входа, стопа и результата в пунктах.** Все тесты считают события «коснулась / не коснулась». Доля 60 % ничего не говорит о прибыли, пока неизвестно, сколько теряется в остальных 40 %.
- **Нет издержек:** комиссии и проскальзывание не учтены.
- **Нет контекста,** которым ты пользуешься руками: объём, скорость подхода, новости, что было на более старшем профиле. Статистика считает все касания одинаковыми. Возможно, преимущество как раз в отборе, но эти тесты его не измеряют.
- **Много сравнений.** Десять тестов, пять точек, пять типов, два блока, две опоры, несколько тумблеров: это сотни ячеек. Среди сотен ячеек несколько «+15 п.п.» появятся случайно. Поэтому я верил только тому, что повторяется в обоих режимах и обеих половинах истории.
- **Порог 20 % отката подбирался после просмотра чисел** (записано в журнале). Граница между Open-Drive и Open-Test-Drive подогнана под историю.
- **Точность 30 минут** для большинства тестов. Порядок событий внутри блока посчитан по минуткам только в тестах 3, 5–7 и 10.
- **Один инструмент, один режим рынка.** 16 лет почти непрерывного роста ES. Все перекосы в сторону лонга могут не повториться на падающем рынке.

## ЧТО БЫ Я ПРОВЕРИЛ ДАЛЬШЕ

---

Это предложения для обсуждения, а не план.

1. **Тест с ценой:** вход в 10:30 по тренду открытия, стоп за экстремум первого часа, выход на закрытии или у вчерашнего экстремума. Результат в пунктах и в ширинах IB, по типам открытия. Только он покажет, стоят ли 55–65 % чего-нибудь.
2. **Кнопка «без тестов первого часа»** в тесте 5: без неё калькулятор по типам открытия вводит в заблуждение.
3. **Принятие зоны открытия** (тест 1.3 из плана): он про то, что происходит после 10:30, а именно там сейчас пусто.
4. **Проверка на падающих отрезках** (2018 Q4, 2020 Q1, 2022): держатся ли лонговые числа.