RAPORT RYNKOWY

US500

S&P 500 · indeks akcji USA

Sesja: piątek, 23.10.2026

Raport przed sesją · dane do zamknięcia sesji 22.10.2026

MIGRACJA WARTOŚCI
Konsolidacja

Profil sesji: D

Najważniejsze liczby

ZAMKNIĘCIE	VALUE AREA	POC
7 666	**7 648 – 7 701**	**7 685**

ATR 5 DNI (H–L)	ZASIĘG ± ATR	NAJBLIŻSZY NPOC
87 pkt	**7 579 – 7 753**	**7 819 (14.10)**

Zawartość

01	Podsumowanie, tabela decyzyjna, poziomy referencyjne, migracja wartości	2
02	Sesja w liczbach (IB, VA, efektywność, typ otwarcia), przepływ flex last 60/240, zachowanie stref z dnia	3
03	Opcje SPX 0DTE w ciągu dnia – historia poziomów, zamknięcie NY vs ściany i max pain, acc delta ±0,50	4
04	Mapa wartości z zasięgiem ATR, strefy płynności, strefy dnia na jutro i przebieg sesji	5
05	Profile 5 sesji z deltą na cenie, zmienność i przepływ zleceń	6
06	Wolumen na poziomach cen – agresja bid/ask, 10 sesji i godziny sesji	7

Źródło danych: Delta Analyzer (footprint H1, M1) – pliki CSV. Opracowanie: ttechou.com

ttechou.com

Materiał analityczny o charakterze informacyjnym i edukacyjnym. Nie zawiera sygnałów wejścia ani rekomendacji inwestycyjnych. Handel instrumentami finansowymi wiąże się z ryzykiem utraty kapitału.

Raport rynkowy US500 | 23.10.2026

Dane do zamknięcia sesji 22.10.2026 | opis rynku bez sygnałów wejścia

STAN RYNKU: cena wewnątrz wartości z 22.10 | migracja wartości: Konsolidacja

Podsumowanie

- **Cena:** zamknięcie sesji 22.10 ≈ **7 666**, wewnątrz VA (7 648–7 701), POC 7 685. Profil sesji: D.
- **Wartość w 5 sesjach:** wartość przeskakuje w obie strony; per saldo wartość niżej o 12 pkt – 2× wyżej, 2× niżej, 1× nakładająca się (z 5 sesji).
- **Zmienność dzienna:** podwyższona (zakres 22.10: 108 pkt = ×1,41 ATR20 77 pkt (n=20 sesji)). **ATR 5 dni (H–L): 87 pkt** – zmienność rośnie (ATR5 vs ATR20).
- **Zmienność na kolejne godziny:** VA 4 h / VA 24 h = 0,37 (VA ostatnich 4 h 7 641–7 660); percentyl historyczny 46% (n=24 sesje); mediana zakresu 8:00–12:00 PL kolejnej sesji 23 pkt (n=33 sesje), po sesjach z tym samym (środkowym) tercylem VA 4h/24h 20 pkt (n=6 sesji).
- **Przepływ zleceń:** delta sesji −3,4k (−4,9% wolumenu); godziny z wolumenem ≥ 1,5× średniej godziny sesji: 16:00 PL (delta −319), 17:00 PL (delta +408).
- **Płynność:** najbliżej nad ceną High 22.10 7 745 (79 pkt, 0,90 ATR), pod ceną Low 22.10 7 636 (30 pkt, 0,34 ATR).
- **Niezmitigowane POC:** 7 819 z 14.10 (nad ceną, 153 pkt).
- **Niedokończone aukcje:** oba ekstrema sesji domknięte.

Tabela decyzyjna profilu sesji – migracja wartości

Profil	POC w zakresie	Zamknięcie vs VA	Zamknięcie vs POC	Delta	Punkty	Migracja wartości
D	środek	w VA	pon POC	spada	**−2**	**Konsolidacja**

brak wyraźnej migracji – sygnały się znoszą, wartość raczej w pobliżu obecnej. Punktacja: VA ±2, POC ±1, delta ±1, kształt profilu ±1 (P +1, b −1, D 0); ≥ +3 wzrost, ≤ −3 spadek. Kształt: POC w górnej / środkowej / dolnej 1/3 zakresu = P / D / b.

Poziomy referencyjne

Poziom	Wartość	Znaczenie
VAH sesji 22.10	7 701	górna granica akceptowanej wartości
POC sesji 22.10	7 685	cena największego wolumenu – środek ciężkości
VAL sesji 22.10	7 648	dolna granica akceptowanej wartości
High / low sesji 22.10	7 745 / 7 636	zakres sesji bazowej (ekstrema z danych M1)
VA 5D (16.10–22.10)	7 678 – 7 744, POC 7 697	wartość szerszego kontekstu
Strefy HVN 5D nad ceną	7 683–7 705, 7 719–7 724, 7 732–7 740	skupiska wolumenu – miejsca zwolnień i rotacji
Strefy LVN 5D	7 631–7 644, 7 664–7 669, 7 764–7 770	luki wolumenu – ceny przechodzone szybko
High / low 5 sesji	7 770 / 7 631	granice zakresu 5 sesji
Zasięg ± ATR 5D (87 pkt)	7 579 – 7 753	typowy dzienny zasięg ruchu od zamknięcia (nie prognoza kierunku)
Niezmitigowane POC (nPOC z 11 sesji)	7 819 (14.10)	POC sesji, do których cena jeszcze nie wróciła – poziomy często testowane później
VA tygodnia (wskaźnik w pliku M1)	7 680 – 7 735, POC 7 700	poziomy tygodniowe podane w danych źródłowych
SL / SL fast (wskaźnik w pliku M1)	7 683 / 7 658	ostatnie wartości kolumn „sl” i „sl fast” na zamknięciu

Migracja wartości – 5 sesji

Sesja	POC	Zmiana POC	VA (VAL–VAH)	Migracja wartości	Delta sesji	Delta %
16.10	7 757	+60	7 691–7 764	wyżej	−1,6k	−2,5%
19.10	7 697	−60	7 693–7 710	nakładająca się	+810	+1,7%
20.10	7 691	−6	7 677–7 714	niżej	+59	+0,1%
21.10	7 732	+41	7 719–7 743	wyżej	−936	−1,9%
22.10	7 685	−47	7 648–7 701	niżej	−3,4k	−4,9%

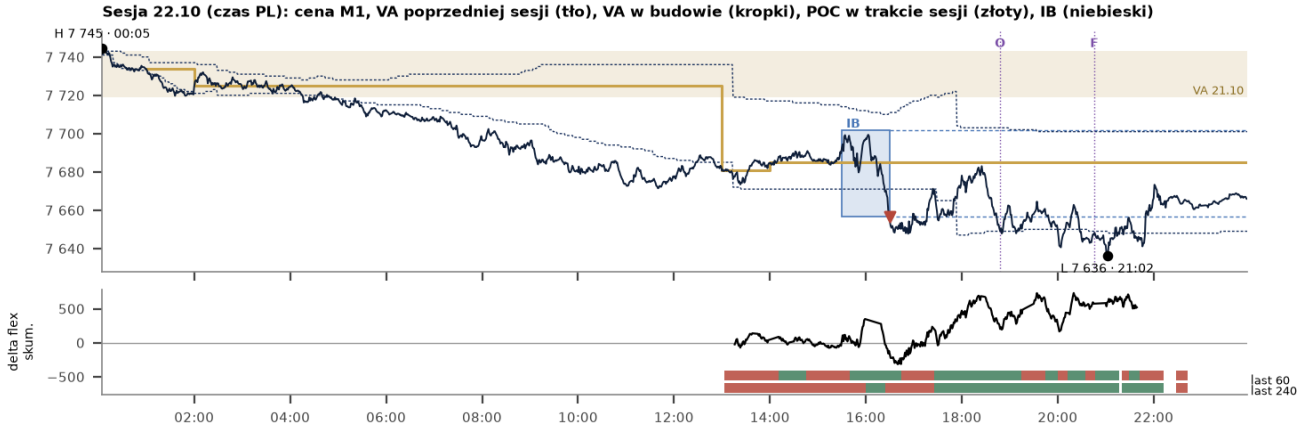
Migracja = POC sesji względem VA sesji poprzedniej (powyżej VAH = wyżej, poniżej VAL = niżej, wewnątrz = nakładająca się). Pierwszy wiersz porównany z sesją 15.10.

Raport rynkowy US500 | 23.10.2026

Dane do zamknięcia sesji 22.10.2026 | opis rynku bez sygnałów wejścia

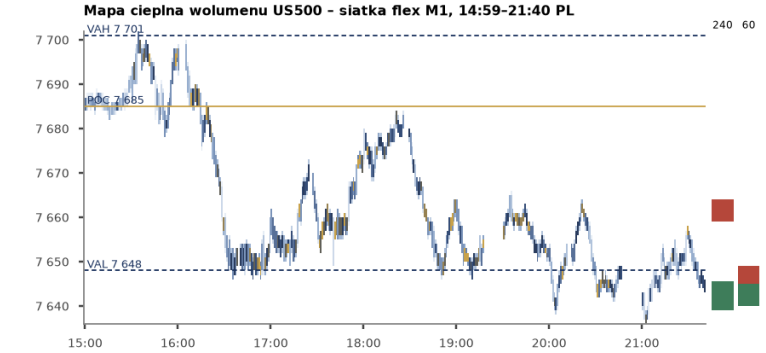
Sesja w liczbach – 22.10

ZAKRES VS ATR5	GODZINA HIGH / LOW	EFEKTYWNOŚĆ RUCHU	POC W TRAKCIE SESJI
108 pkt · 124%	**H 00:05 · L 21:02**	**11%**	**7 734 → 7 685**
7 636–7 745 · ATR5 87 pkt	H 7 745 · L 7 636; najpierw high, potem low	zmiana −78 pkt / droga M5 714 pkt (8,2× ATR5)	po 01:00 → koniec; 3 zmiany, zakres 7 681–7 734
CZAS VS VA 21.10	**CZAS VS VA W BUDOWIE**	**IB 15:30–16:30**	**TYP OTWARCIA (UPROSZCZONY)**
0% / 19% / 81%	**0% / 48% / 52%**	**7 657–7 702 · 45 pkt**	**Open Auction**
nad / w / pod VA poprzedniej sesji 7 719–7 743; minuty M1 (1414)	nad / w / pod VA sesji narastająco (VAH/VAL „today” z pliku M1)	wybicie w dół: 16:30 (−21 pkt); 51% ATR5	otwarcie 15:30 przy 7 690, pod zakresem poprzedniej sesji (luka); 30 min: 7 678–7 702



US500 – przepływ w ciągu dnia (flex last 60 / 240)

KOLOR LAST 60 / 240	NAJMOCNIEJSZE POZIOMY · OSTATNI ODCZYT 22:28	DELTA FLEX VS CFD	DELTA FLEX SKUMULOWANA
zielony 52% / 55%	**▲ 7 642 · ▼ 7 662**	**+521 / +417**	**+521**
udział czasu między odczytami; ostatni odczyt 22:28: last 60 czerwony, last 240 czerwony	240: ▲ 7 640–7 645 ▼ 7 660–7 664; 60: ▲ 7 640–7 645 ▼ 7 646–7 648	to samo okno co delta skumulowana: 13:16–21:39; CFD = delta skumulowana z pliku M1; znak zgodny w 2/3 h	minuty 13:16–21:39 (424); min −316, max +731



- **Dywergencje dnia: 2** – niezgodność ceny i przepływu; opis, nie sygnał
- **18:48** – opcje SPX 0DTE vs cena (cena 7 649): cena −8,9 pkt w 60 min, a opcje ±0,50 SPX 0DTE: +20,4 tys. w 60 min
- **20:46** – last 60 vs cena (cena 7 644): cena −13,5 pkt w 60 min, a last 60 zielony (delta +55), last 240 zielony

Zachowanie stref z dnia (odczyty 15-min)

24 strefy z odczytów · dotknięte **14** (obronione **3**, przebite **11**) · zmiana roli **0** · nieprzetestowane **10** (najbliższe 4 → tabela stref płynności, „strefa dnia”) · pokrycie **31/64** odczytów (13:03–22:28)

Strefa	Rola	Zachowanie	Od	Źródło (ostatni odczyt)
7 667–7 672	opór	obroniona · 2× (od 18:58)	15:18	VAH 60m 7668,5
7 631–7 636	wsparcie	obroniona · 1× (od 21:01)	20:35	minimum dnia 7636
7 700–7 713	opór	obroniona · 1× (od 16:03)	13:40	call wall SPX 7700→7702,7

Strefy z odczytów 15-min, scalone między odczytami (nakładanie ≥ 50% węższej). Ocena na M1 sesji: dotknięcie = świeca M1 w strefie; przebicie = zamknięcie M1 ponad 1 pkt za strefą po dotknięciu; obroniona = dotknięta, nieprzebita; zmiana roli = po przebiciu retest z drugiej strony utrzymany do końca sesji. Lista: obronione z największą liczbą dotknięć (zielone) i najbliższe zmiany roli (fioletowe). Opis zachowania rynku, nie sygnał.

IB = pierwsza godzina sesji kasowej NY (9:30–10:30 czasu NY = 15:30–16:30 PL); wybicie = pierwsza minuta M1 z high/low poza IB. Efektywność = |zamknięcie − otwarcie sesji| / suma zmian zamknięć świec M5 (100% = ruch w jedną stronę). Czas względem VA = minuty M1 wg zamknięcia. POC w trakcie sesji = POC profilu narastającego po każdej pełnej godzinie (plik VAP). Typ otwarcia – reguła uproszczona z pierwszych 30 min od otwarcia NY (Drive: ruch ≥ 0,15 ATR5 bez powrotu za otwarcie; Test Drive: krótki test przeciwnej strony ≤ 0,10 ATR5; Rejection Reverse: odwrócenie za otwarcie; Auction: rotacja). Godziny w czasie PL. Opis rynku, nie sygnał wejścia. Przepływ: odczyty 15-min (kolor last 60/240 z flex, wcześniej znak delty flex); najmocniejsze poziomy = najsilniejszy zielony (▲ kupno) / czerwony (▼ sprzedaż) pas w ostatnim odczycie; flex vs CFD = suma delty minut flex i delta CFD w tym samym oknie co delta flex skumulowana (CFD z pliku M1, a bez niego – pełne godziny z pliku VAP). Mapa cieplna = wolumen minut z siatki flex (ciemniej/złoto = więcej); pasy z prawej = najmocniejsze poziomy 240/60; dywergencje z raportu godzinowego.

US500 – opcje SPX 0DTE w ciągu dnia 22.10 (historia sesji, nie poziomy na jutro)

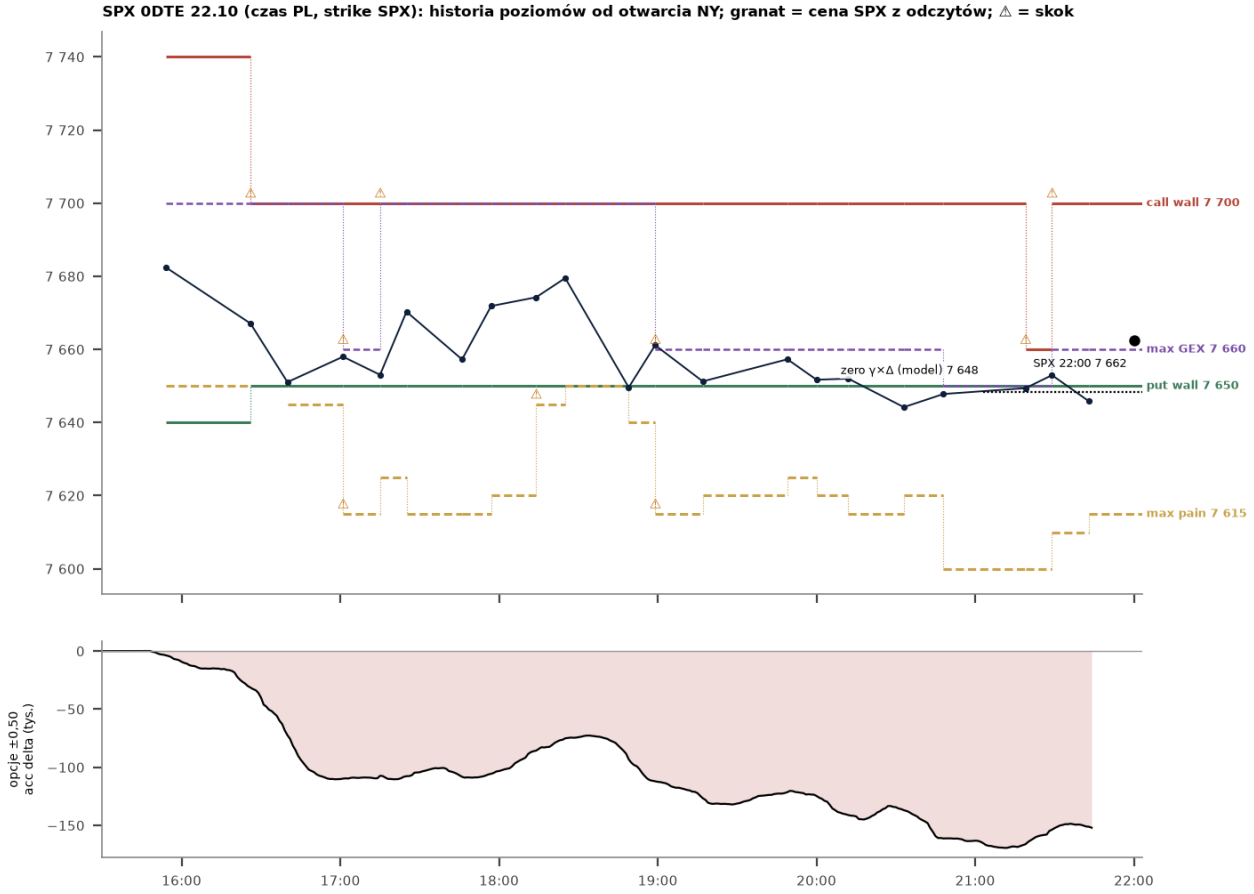
SPX 22:00 VS MAX PAIN
+47 pkt
US500 7 665 o 22:00 (zamknięcie kasowe NY 16:00) − baza 2,7 z odczytu 21:43 = SPX ≈ 7 662; max pain 7 615 (odczyt 21:43)

SPX 22:00 VS ŚCIANY
między ścianami
put wall 7 650 (+12); call wall 7 700 (−38); max GEX 7 660 (+2) (poziomy z odczytu 21:43)

PCR / GEX · OSTATNI ODCZYT 21:43
1,44 / −321,6
ostatni odczyt 21:43; PCR = put/call (wolumen)

OPCJE ±0,50: ACC DELTA
−152,0 tys.
na 21:44; min −169,4 tys. (21:12), max +0,1 tys. (15:48)

ZERO GAMMA×DELTA NA ZAMKNIĘCIE (MODEL)
7 648
model gamma×delta, stan 21:44; cena SPX −3 pkt od zera



Skoki poziomów ⚠ (9): 16:26 call wall 7 740 → 7 700 (krawędź tabeli – niepewne); 17:01 max GEX 7 700 → 7 660; 17:15 max GEX 7 660 → 7 700; 18:59 max GEX 7 700 → 7 660; 21:19 call wall 7 700 → 7 660 (krawędź tabeli – niepewne); 21:29 call wall 7 660 → 7 700; ...

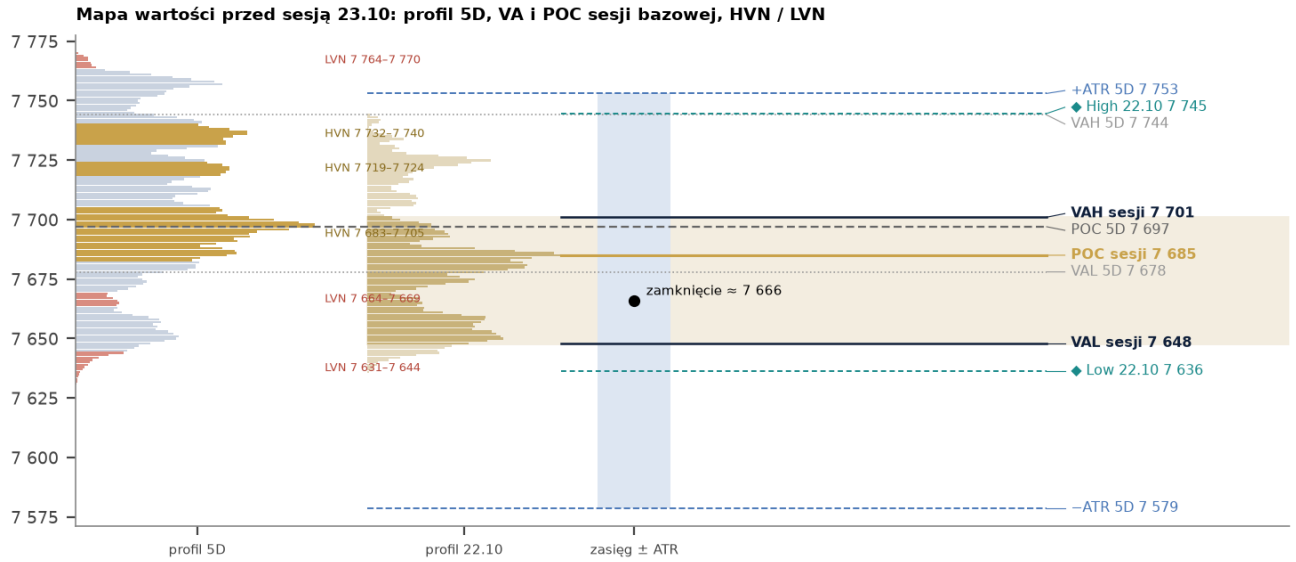
Pominięto 1 odczyt – cena SPX poza widoczną tabelą strike'ów (tabela obcięta, poziomy niewiarygodne; poza skokami ⚠ i skalą wykresu): 15:42 (SPX 7 696, tabela 7 700–7 815).

Historia sesji 22.10: poziomy SPX 0DTE wygasają z sesją – to opis dnia, nie poziomy na jutro. Odczyty co 15 min od otwarcia NY (15:30) do 21:43 (21); schodek trzyma wartość do następnego odczytu. Cena SPX = cena z danego odczytu z jego czasem (gdy brak – US500 − baza z tego odczytu); porównanie na zamknięciu kasowym NY (16:00 NY = 22:00 PL): US500 z M1 − baza z ostatniego odczytu, a gdy M1 nie sięga tej godziny – cena SPX z ostatniego odczytu. ⚠ = zmiana ≥ max(20 pkt, 0,25 ATR5) między odczytami albo poziom na krawędzi widocznej tabeli strike'ów. Opcje ±0,50 = skumulowana delta netto kubełka opcji o delcie ok. ±0,50 (od otwarcia). Zero γ×Δ = poziom zerowy modelu gamma×delta (model, nie poziom transakcyjny). Opis rynku, nie sygnał wejścia.

Raport rynkowy US500 | 23.10.2026

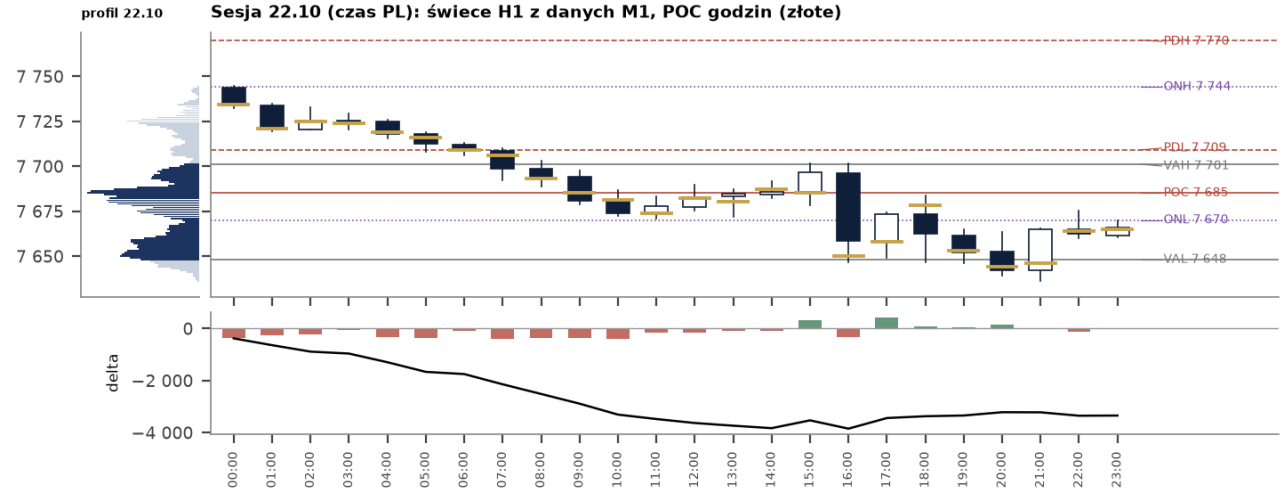
Dane do zamknięcia sesji 22.10.2026 | opis rynku bez sygnałów wejścia

Mapa wartości



Profil 5D z HVN (złote) i LVN (czerwone), VA sesji bazowej (beżowe tło), POC 5D (przerywana); kropka = cena zamknięcia; niebieskie przerywane = zasięg ± ATR 5 dni (średni zakres high–low) od zamknięcia.

Przebieg sesji 22.10



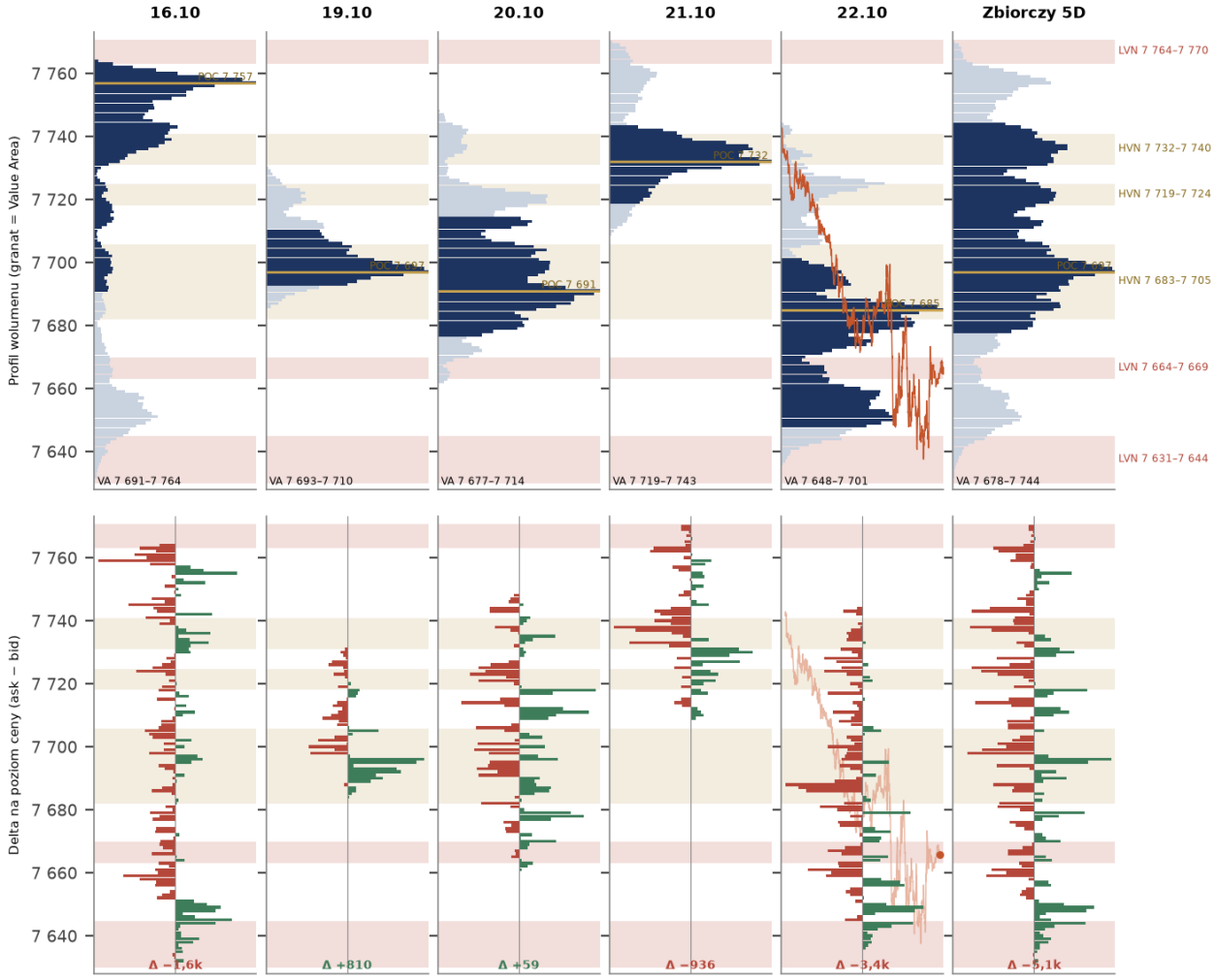
Zakres sesji 7 636–7 745 (M1), delta sesji −3,4k, delta skumulowana min. −3,9k, koniec −3,4k. Godziny na osi w czasie PL. PDH/PDL = high/low sesji 21.10; ONH/ONL = high/low godzin przed otwarciem kasowym NY (9:30 czasu NY = 15:30 PL).

Strefy płynności na sesję 23.10

Strefa	Cena	Odległość	Źródło	W strefie: wolumen / delta	Przepływ w źródle
▬ **strefa dnia**	7 756–7 761	+90 pkt (1,03 ATR)	odczyt 14:00	poza zakresem sesji	nieprzetestowana
◆ **High 22.10**	7 745	+79 pkt (0,90 ATR)	22.10 00:00	369 / −162	obrona poziomu
▬ **strefa dnia**	7 714–7 724	+48 pkt (0,55 ATR)	odczyt 15:40	4 684 / −325	nieprzetestowana
◆ **Low 22.10**	7 636	−30 pkt (0,34 ATR)	22.10 21:00	232 / +125	obrona poziomu
▬ **strefa dnia**	7 630–7 631	−35 pkt (0,40 ATR)	odczyt 16:44	poza zakresem sesji	nieprzetestowana
▬ **strefa dnia**	7 620–7 621	−45 pkt (0,51 ATR)	odczyt 18:50	poza zakresem sesji	nieprzetestowana

Strefy płynności = poziomy, za którymi zwykle leżą zlecenia stop: EQH/EQL (dwa nieprzebite szczyty/dołki H1 różniące się o mniej niż 0,04 ATR), High/Low sesji bazowej i najbliższy nieprzebity swing H1 nad i pod ceną (swing = ekstremum względem 2 świec H1 z każdej strony; świece H1 zbudowane z danych M1 sesji bazowej). Świeca źródłowa = godzina H1 (czas PL), w której powstał poziom; „obrona poziomu” = w tej świecy delta w strefie (± 4) szła przeciw przebiciu (np. kupujący przy dołku). „Strefa dnia” = strefa z odczytów 15-min sesji, nietknięta do zamknięcia (najbliższe po 2 nad i pod ceną, do 1,5 ATR); źródło = pierwszy odczyt (czas PL), wolumen/delta = profil sesji w granicach strefy.

Profile 5 sesji i delta na poziom ceny



Górny rząd: profil wolumenu sesji (granat = VA, złota linia = POC) i profil zbiorczy 5D; czerwona linia = przebieg ceny w sesji bazowej (od lewej do prawej, kropka = zamknięcie; dla wcześniejszych sesji brak danych M1); fioletowa przerywana = nPOC; złote pasy = strefy HVN, czerwone pasy = strefy LVN z profilu zbiorczego 5D. Dolny rząd: delta na poziom ceny (zielona = kupujący, czerwona = sprzedający).

Zmienność i przepływ zleceń

Miara	Odczyt	Co mówi
VA 4 h / VA 24 h	0,37 (percentyl 46%, n=24 sesje)	szerokość wartości ostatnich 4 h na tle całej sesji – wielkość ruchu, nie kierunek
ATR 5 dni (H–L) / ATR20	87 / 77 pkt	ATR5 = średnie H–L 5 ostatnich sesji; ATR20 = średnie H–L do 20 poprzednich sesji (archiwum M1, n=20 sesji); ostatni dzień 108 pkt
Mediana zakresu 8:00–12:00 PL (ta sama faza)	20 pkt (n=6 sesji)	okno 8:00–12:00 PL kolejnej sesji po sesjach z tym samym (środkowym) tercylem VA 4h/24h; wszystkie: 23 pkt (n=33 sesje)

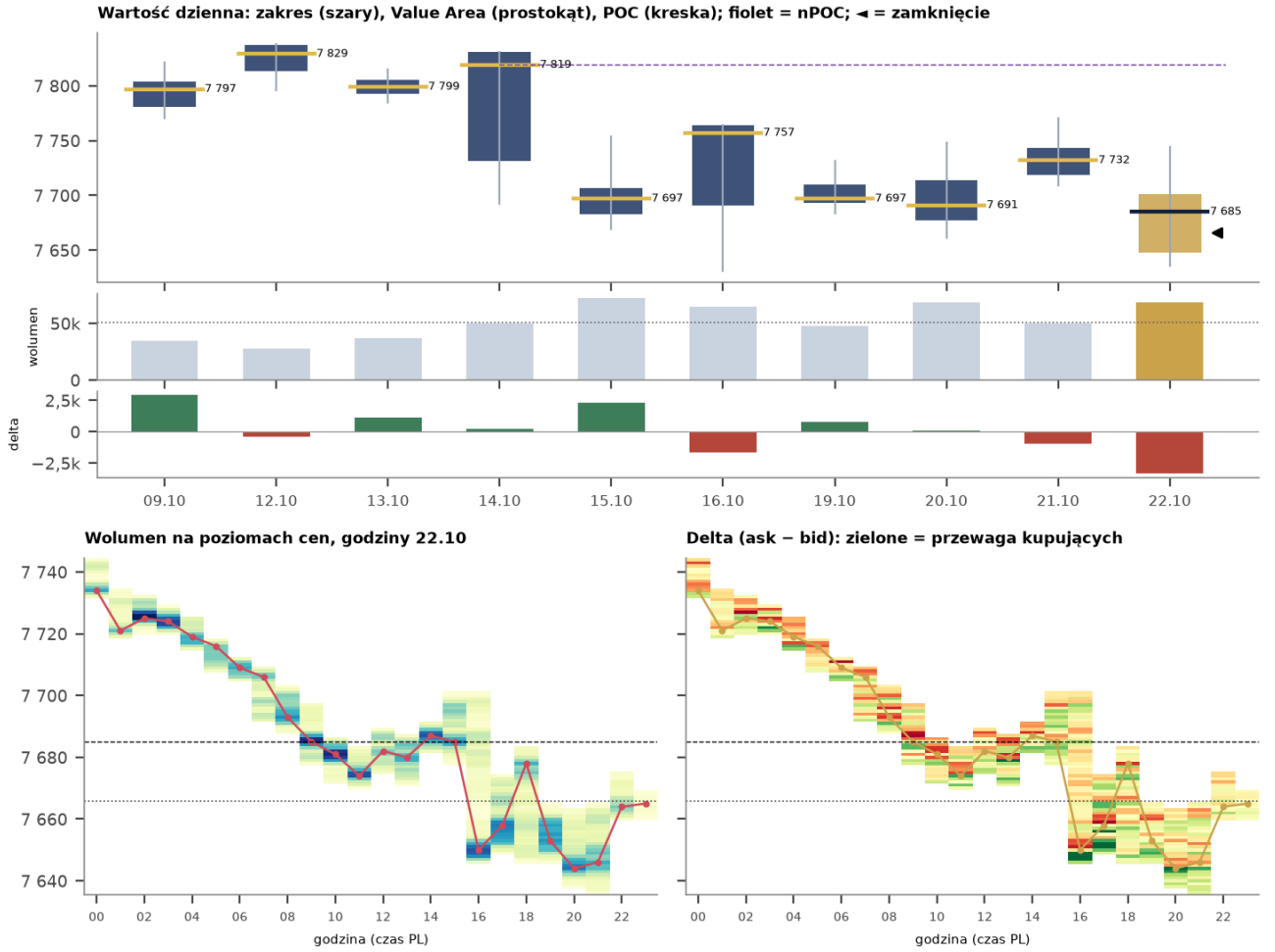
Godz.	Wol./śr.	RVOL	Delta	Godz.	Wol./śr.	RVOL	Delta	Godz.	Wol./śr.	RVOL	Delta	Godz.	Wol./śr.	RVOL	Delta
00	0,5	**1,5**	−385	06	0,6	**1,5**	−85	12	0,7	1,1	−153	18	1,5	**1,6**	+70
01	0,5	1,3	−262	07	0,8	1,5	−393	13	1,0	1,3	−103	19	1,5	**1,6**	+27
02	1,1	1,4	−247	08	1,1	**1,7**	−371	14	0,9	1,0	−95	20	1,3	**1,6**	+127
03	0,9	1,3	−75	09	1,2	1,4	−373	15	1,3	1,1	+300	21	1,4	**1,5**	−4
04	0,7	**1,6**	−333	10	1,1	**1,5**	−421	16	**1,9**	**1,5**	−319	22	0,6	**1,5**	−131
05	0,7	**1,7**	−370	11	0,9	1,4	−170	17	**1,8**	**1,8**	+408	23	0,1		+7

Godziny sesji (PL). Wol./śr. = wolumen godziny / średni wolumen godziny w tej sesji; pogrubione ≥ 1,5. RVOL = wolumen godziny / średnia tej samej godziny czasu NY z poprzednich sesji (n=8 sesji); pogrubione ≥ 1,5.

Cena odniesienia: zamknięcie sesji 22.10 z danych M1 (22.10 23:57 PL = 21:57 UTC) = 7 666. Zmienność: stosunek VA 4 h / VA 24 h mówi o oczekiwanej wielkości ruchu, nie o kierunku. Materiał informacyjny i edukacyjny, nie stanowi rekomendacji inwestycyjnej.
Uwagi do danych: Profil sesji 22.10 = kolumna „today" pomniejszona o godzinę 22:00–23:00 UTC 22.10 (= 00:00–01:00 PL 23.10), która należy już do kolejnej sesji: −112 wolumenu, delta +16. Profile sesji 20.10, 21.10 z archiwum (kolumna „today" z dnia sesji; kolumna dzienna nowego pliku zawiera też początek kolejnej sesji). Starsze sesje z archiwum: 08.10, 09.10.

Wolumen na poziomach cen – agresja bid/ask, 10 sesji i godziny sesji

- **Gdzie stoi wolumen:** 68,0% wolumenu sesji 22.10 powstało nad ceną zamknięcia, 32,0% pod nią. Największe poziomy: 7 685 (2,8%), 7 686 (2,7%), 7 684 (2,3%).
- **Agresja w zakresie sesji:** górna 1/3: delta −2,0k (20% wol.); środkowa 1/3: delta −2,1k (45% wol.); dolna 1/3: delta +789 (35% wol.).
- **Najsilniejsi kupujący (ask):** 7 649 (+320), 7 648 (+277), 7 644 (+266); **najsilniejsi sprzedający (bid):** 7 688 (−407), 7 687 (−339), 7 686 (−298).
- **10 sesji (09.10–22.10):** POC z 7 797 do 7 685 (−112 pkt); delta dodatnia w 6 z 10 sesji, suma +1,1k; wolumen 22.10 = ×1,36 średniej 9 wcześniejszych sesji.
- **Godziny 22.10:** największy wolumen 16:00 PL (5 423, POC 7 650); najmocniejsze kupno 17:00 PL (+408), najmocniejsza sprzedaż 10:00 PL (−421); POC godzinowy od 7 734 do 7 665.



Lewy panel: wolumen na poziomie ceny w każdej godzinie sesji (ciemniej = więcej), czerwona linia = POC godziny. Prawy panel: delta (ask − bid) na poziomie ceny, złota linia = POC godziny. Czarna przerywana = POC sesji, kropkowana = zamknięcie.

Top 5 poziomów wolumenu 22.10

Cena	Wolumen	Bid	Ask	Delta	Udział
7 685	1 899	919	915	−4	2,8%
7 686	1 829	1 051	753	−298	2,7%
7 684	1 610	756	778	+22	2,3%
7 681	1 565	874	648	−226	2,3%
7 680	1 539	822	688	−134	2,2%

Sesje w pliku (10)

Sesja	Wolumen	×śr.	Delta	POC	VA
09.10	34 981	0,69	+2,9k	7 797	7 781–7 804
12.10	27 704	0,55	−413	7 829	7 813–7 837
13.10	37 186	0,74	+1,1k	7 799	7 793–7 805
14.10	49 913	0,99	+257	7 819	7 731–7 831
15.10	72 532	1,44	+2,3k	7 697	7 683–7 707
16.10	65 020	1,29	−1,6k	7 757	7 691–7 764
19.10	47 671	0,95	+810	7 697	7 693–7 710
20.10	68 527	1,36	+59	7 691	7 677–7 714
21.10	50 343	1,00	−936	7 732	7 719–7 743
22.10	68 585	1,36	−3,4k	7 685	7 648–7 701

Źródło: plik CSV „Strike / vol / bid / ask” – Strike = poziom ceny (krok 1 pkt), bid/ask = wolumen po stronie bid/ask. Delta = ask − bid; ×śr. = wolumen sesji / średnia wcześniejszych sesji w pliku.