RAPORT RYNKOWY

US500

S&P 500 · indeks akcji USA

Sesja: czwartek, 29.10.2026

Raport przed sesją · dane do zamknięcia sesji 28.10.2026

MIGRACJA WARTOŚCI
Spadek

Profil sesji: b

Najważniejsze liczby

ZAMKNIĘCIE	VALUE AREA	POC
7 727	**7 723 – 7 737**	**7 728**

ATR 5 DNI (H–L)	ZASIĘG ± ATR	NAJBLIŻSZY NPOC
81 pkt	**7 646 – 7 808**	**7 688 (27.10)**

Zawartość

01	Podsumowanie, tabela decyzyjna, poziomy referencyjne, migracja wartości	2
02	Sesja w liczbach – IB, czas względem VA, efektywność, migracja POC, typ otwarcia	3
03	Mapa wartości z zasięgiem ATR, strefy płynności i przebieg sesji	4
04	Profile 5 sesji z deltą na cenie, zmienność i przepływ zleceń	5
05	Wolumen na poziomach cen – agresja bid/ask, 10 sesji i godziny sesji	6

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 | 29.10.2026

Dane do zamknięcia sesji 28.10.2026 | opis rynku bez sygnałów wejścia

STAN RYNKU: cena wewnątrz wartości z 28.10 | migracja wartości: Spadek

Podsumowanie

- **Cena:** zamknięcie sesji 28.10 ≈ **7 727**, wewnątrz VA (7 723–7 737), POC 7 728. Profil sesji: b.
- **Wartość w 5 sesjach:** wartość przeskakuje w obie strony; per saldo wartość niżej o 4 pkt – 2× wyżej, 2× niżej, 1× nakładająca się (z 5 sesji).
- **Zmienność dzienna:** normalna (zakres 28.10: 69 pkt = ×0,89 ATR20 78 pkt (n=20 sesji)). **ATR 5 dni (H–L): 81 pkt** – zmienność stabilna (ATR5 vs ATR20).
- **Zmienność na kolejne godziny:** VA 4 h / VA 24 h = 1,33 (VA ostatnich 4 h 7 724–7 743); percentyl historyczny 100% (n=25 sesji); mediana zakresu 8:00–12:00 PL kolejnej sesji 23 pkt (n=37 sesji), po sesjach z tym samym (wysokim) tercylem VA 4h/24h 32 pkt (n=7 sesji).
- **Przepływ zleceń:** delta sesji −2,1k (−4,1% wolumenu); godziny z wolumenem ≥ 1,5× średniej godziny sesji: 15:00 PL (delta +245), 19:00 PL (delta −247), 20:00 PL (delta +435), 21:00 PL (delta −908).
- **Płynność:** najbliżej nad ceną High 28.10 7 785 (58 pkt, 0,71 ATR), pod ceną Low 28.10 7 716 (11 pkt, 0,14 ATR).
- **Niezmitigowane POC:** 7 688 z 27.10 (pod ceną, 39 pkt), 7 819 z 14.10 (nad ceną, 92 pkt), 7 634 z 26.10 (pod ceną, 93 pkt).
- **Niedokończone aukcje:** oba ekstrema sesji domknięte.
- **Expected move (opcje SPX):** 29.10 ±49 pkt → 7 695–7 794 US500; do 30.10 ±70 pkt → 7 674–7 815.

Tabela decyzyjna profilu sesji – migracja wartości

Profil	POC w zakresie	Zamknięcie vs VA	Zamknięcie vs POC	Delta	Punkty	Migracja wartości
b	nisko	w VA	pon POC	spada	**−3**	**Spadek**

wartość przesuwa się w dół – kolejna sesja najczęściej buduje POC niżej. 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 28.10	7 737	górna granica akceptowanej wartości
POC sesji 28.10	7 728	cena największego wolumenu – środek ciężkości
VAL sesji 28.10	7 723	dolna granica akceptowanej wartości
High / low sesji 28.10	7 785 / 7 716	zakres sesji bazowej (ekstrema z danych M1)
VA 5D (22.10–28.10)	7 625 – 7 697, POC 7 629	wartość szerszego kontekstu
Strefy HVN 5D pod ceną	7 626–7 637, 7 643–7 689	skupiska wolumenu – miejsca zwolnień i rotacji
Strefa HVN 5D przy cenie	7 721–7 734	cena w skupisku wolumenu
Strefy LVN 5D	7 611–7 620, 7 703–7 715, 7 743–7 784	luki wolumenu – ceny przechodzone szybko
High / low 5 sesji	7 785 / 7 611	granice zakresu 5 sesji
Zasięg ± ATR 5D (81 pkt)	7 646 – 7 808	typowy dzienny zasięg ruchu od zamknięcia (nie prognoza kierunku)
Expected move ± 49 pkt / ± 70 pkt	29.10: 7 695 – 7 794 do 30.10: 7 674 – 7 815	ruch do wygaśnięcia wyceniony przez opcje SPX (straddle ATM) od zamknięcia; nie kierunek
Niezmitigowane POC (nPOC z 15 sesji)	7 688 (27.10), 7 634 (26.10), 7 819 (14.10)	POC sesji, do których cena jeszcze nie wróciła – poziomy często testowane później
VA tygodnia (wskaźnik w pliku M1)	7 620 – 7 695, POC 7 660	poziomy tygodniowe podane w danych źródłowych
SL / SL fast (wskaźnik w pliku M1)	7 729 / 7 730	ostatnie wartości kolumn „sl” i „sl fast” na zamknięciu

EM = straddle ATM SPX (mid bid/ask) z zamknięcia 28.10; kontrolnie z IV ATM (15,6% → ±63 pkt, 30.10: 15,5% → ±89 pkt; spot×IV×√(dni/365), straddle ≈ 0,8σ). Środek: SPX 7 744 (parytet put-call) − baza SPX−US500 0,00 (gamma×delta) = 7 744 US500.

Migracja wartości – 5 sesji

Sesja	POC	Zmiana POC	VA (VAL–VAH)	Migracja wartości	Delta sesji	Delta %
22.10	7 685	−47	7 648–7 701	niżej	−3,4k	−4,9%
23.10	7 662	−23	7 642–7 672	nakładająca się	−424	−0,6%
26.10	7 634	−28	7 622–7 655	niżej	+147	+0,2%
27.10	7 688	+54	7 668–7 701	wyżej	+499	+1,1%
28.10	7 728	+40	7 723–7 737	wyżej	−2,1k	−4,1%

Migracja = POC sesji względem VA sesji poprzedniej (powyżej VAH = wyżej, poniżej VAL = niżej, wewnątrz = nakładająca się). Pierwszy wiersz porównany z sesją 21.10.

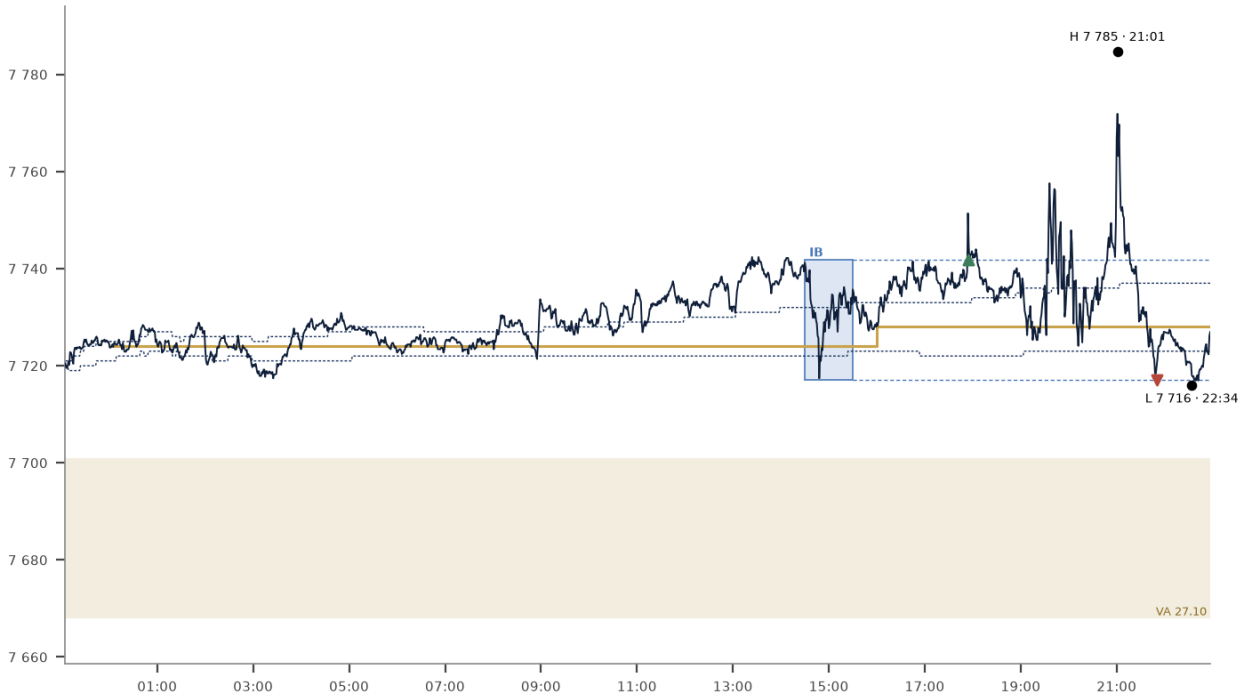
Raport rynkowy US500 | 29.10.2026

Dane do zamknięcia sesji 28.10.2026 | opis rynku bez sygnałów wejścia

Sesja w liczbach – 28.10

ZAKRES VS ATR5 **69 pkt · 85%** 7 716–7 785 · ATR5 81 pkt	**GODZINA HIGH / LOW** **H 21:01 · L 22:34** H 7 785 · L 7 716; najpierw high, potem low	**EFEKTYWNOŚĆ RUCHU** **1%** zmiana +6 pkt / droga M5 570 pkt (7,0× ATR5)	**POC W TRAKCIE SESJI** **7 724 → 7 728** po 00:00 → koniec; 1 zmiana, zakres 7 724–7 728
CZAS VS VA 27.10 **100% / 0% / 0%** nad / w / pod VA poprzedniej sesji 7 668–7 701; minuty M1 (1426)	**CZAS VS VA W BUDOWIE** **53% / 40% / 7%** nad / w / pod VA sesji narastająco (VAH/VAL „today" z pliku M1)	**IB 14:30–15:30** **7 717–7 742 · 25 pkt** wybicie obustronne: w górę 17:54 (+43 pkt); w dół 21:50 (−1 pkt); 31% ATR5	**TYP OTWARCIA (UPROSZCZONY)** **Open Test Drive w dół** otwarcie 14:30 przy 7 738, nad zakresem poprzedniej sesji (luka); 30 min: 7 717–7 742

Sesja 28.10 (czas PL): cena M1, VA poprzedniej sesji (tło), VA w budowie (kropki), POC w trakcie sesji (złoty), IB (niebieski)

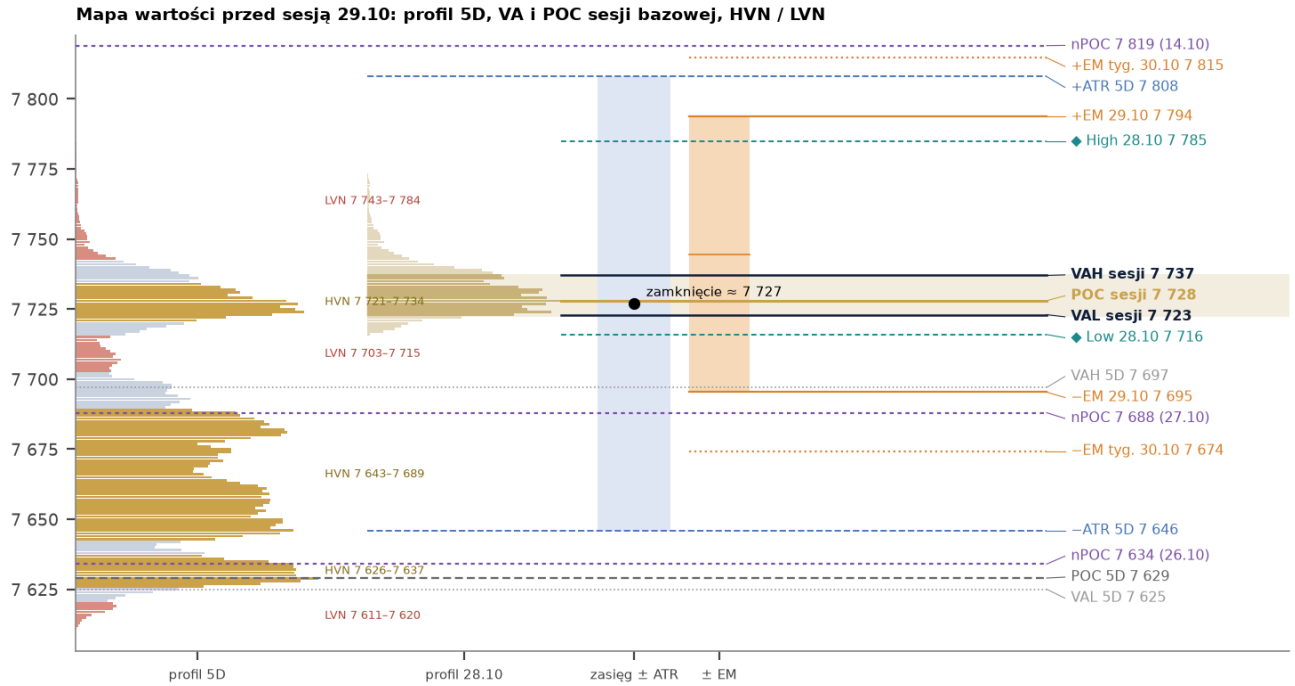


IB = pierwsza godzina sesji kasowej NY (9:30–10:30 czasu NY = 14:30–15:30 PL); wybicie = pierwsza minuta M1 z high/low poza IB. Efektywność = |zamknięcie − otwarcie sesji| / suma zmian zamknięć świec M5 (100% = ruch w jedną stronę). Czas względem VA = minuty M1 wg zamknięcia. POC w trakcie sesji = POC 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.

Raport rynkowy US500 | 29.10.2026

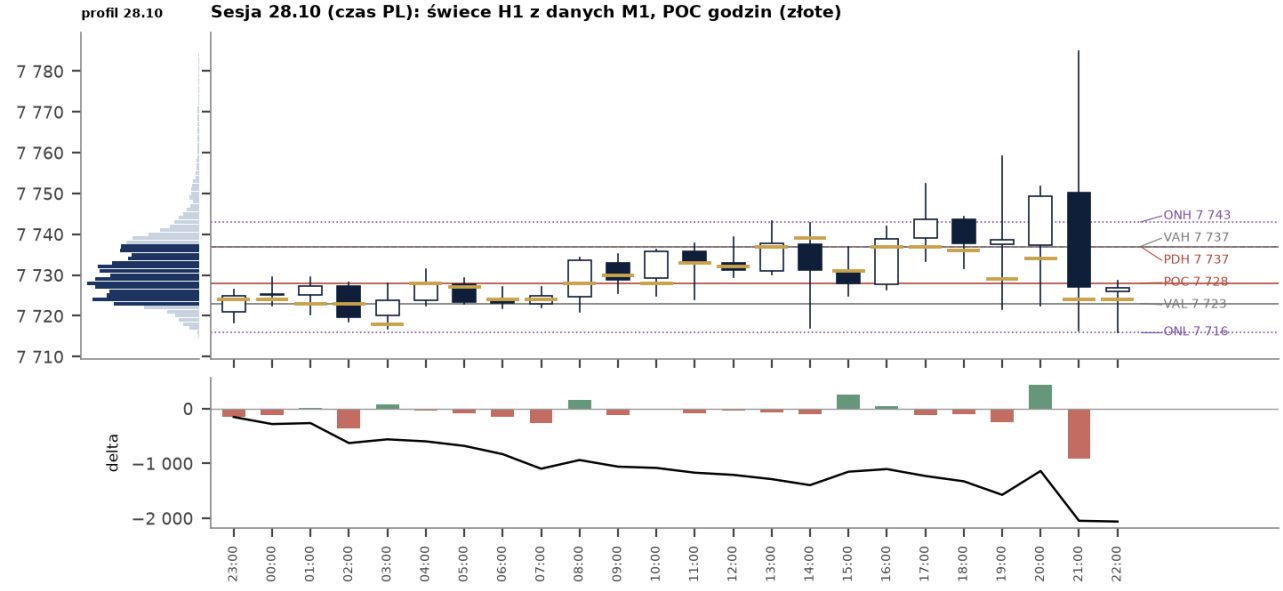
Dane do zamknięcia sesji 28.10.2026 | opis rynku bez sygnałów wejścia

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. Pomarańczowe pasmo = expected move sesji z opcji SPX (±1 EM, cienka linia = środek pasma); EM do piątkowego wygasania – kropkowane linie albo podpis pod pasmem, gdy wychodzi poza skalę.

Przebieg sesji 28.10



Zakres sesji 7 716–7 785 (M1), delta sesji −2,1k, delta skumulowana min. −2,1k, koniec −2,1k. Godziny na osi w czasie PL. PDH/PDL = high/low sesji 27.10; ONH/ONL = high/low godzin przed otwarciem kasowym NY (9:30 czasu NY = 14:30 PL).

Strefy płynności na sesję 29.10

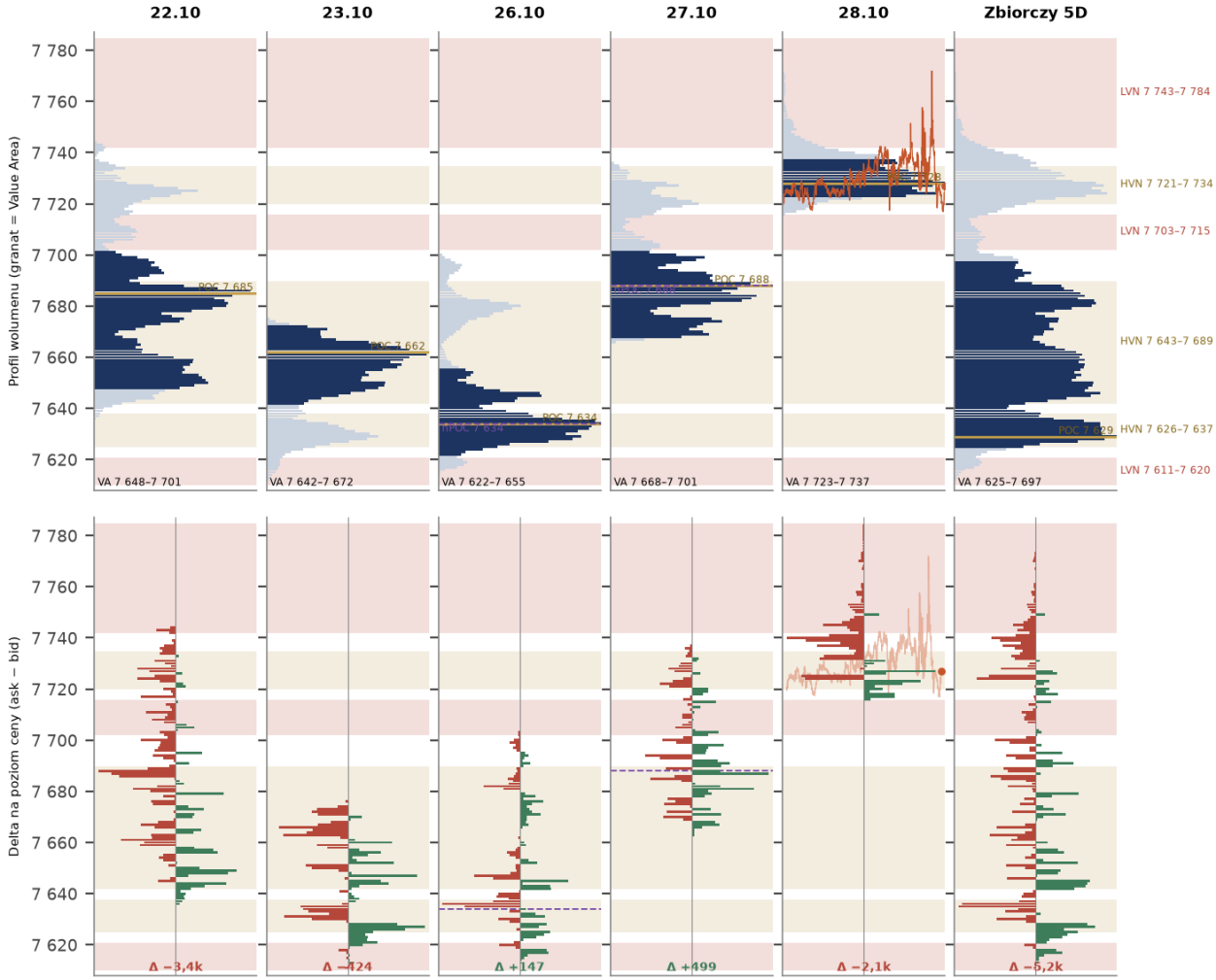
Strefa	Cena	Odległość	Źródło	W strefie: wolumen / delta	Przepływ w źródle
◆ **High 28.10**	7 785	+58 pkt (0,71 ATR)	28.10 21:00	20 / −20	obrona poziomu
◆ **Low 28.10**	7 716	−11 pkt (0,14 ATR)	28.10 22:00	102 / +32	obrona poziomu

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).

Raport rynkowy US500 | 29.10.2026

Dane do zamknięcia sesji 28.10.2026 | opis rynku bez sygnałów wejścia

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	1,33 (percentyl 100%, n=25 sesji)	szerokość wartości ostatnich 4 h na tle całej sesji – wielkość ruchu, nie kierunek
ATR 5 dni (H–L) / ATR20	81 / 78 pkt	ATR5 = średnie H–L 5 ostatnich sesji; ATR20 = średnie H–L do 20 poprzednich sesji (archiwum M1, n=20 sesji); ostatni dzień 69 pkt
Mediana zakresu 8:00–12:00 PL (ta sama faza)	32 pkt (n=7 sesji)	okno 8:00–12:00 PL kolejnej sesji po sesjach z tym samym (wysokim) tercylem VA 4h/24h; wszystkie: 23 pkt (n=37 sesji)

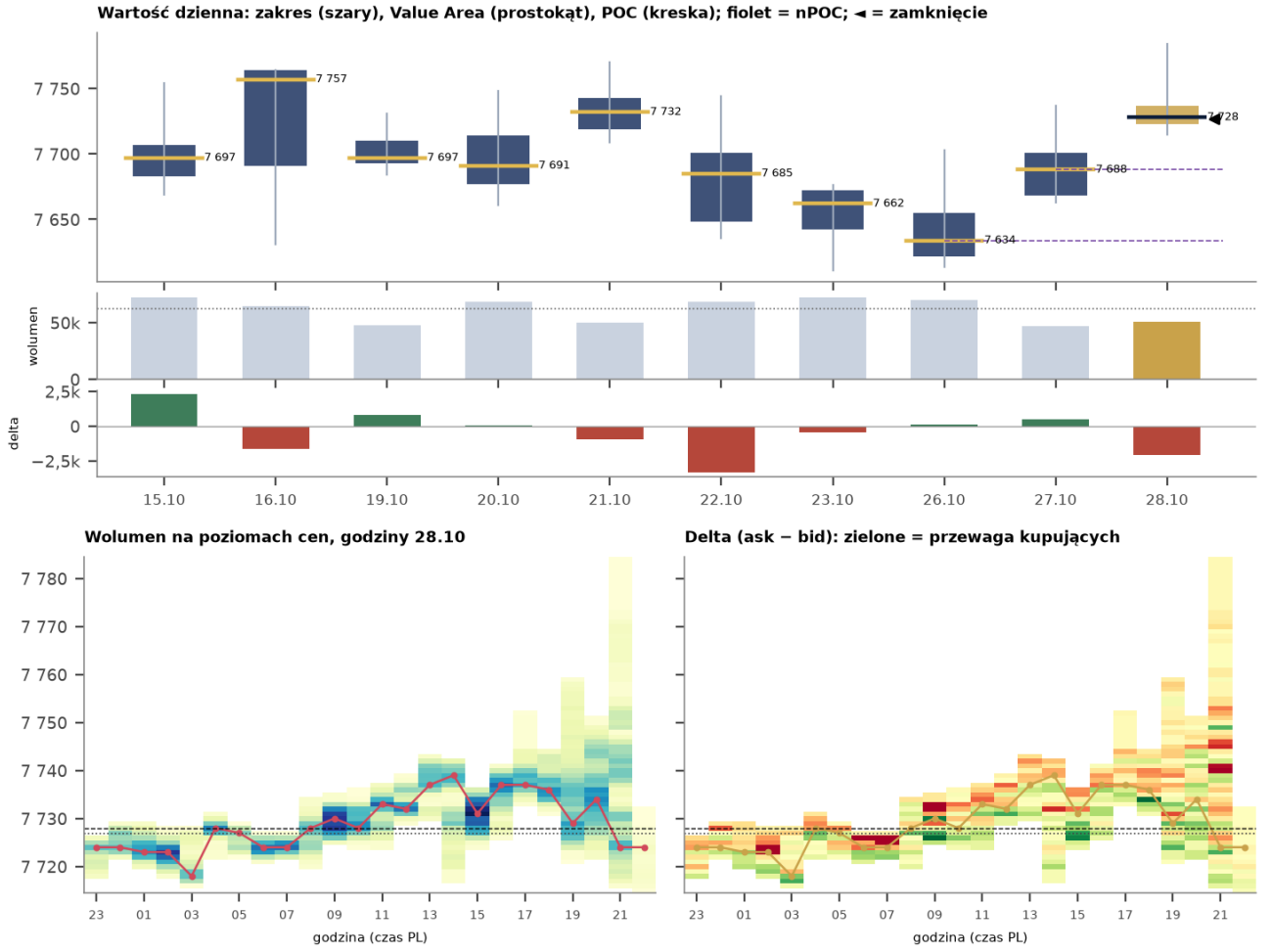
Godz.	Wol./śr.	RVOL	Delta	Godz.	Wol./śr.	RVOL	Delta	Godz.	Wol./śr.	RVOL	Delta	Godz.	Wol./śr.	RVOL	Delta
23	0,5	0,8	−156	05	0,4	0,6	−82	11	0,9	1,1	−87	17	0,8	0,6	−126
00	0,5	0,8	−128	06	0,6	0,7	−151	12	0,7	0,7	−40	18	1,0	0,8	−97
01	0,8	0,6	+17	07	0,6	0,6	−266	13	0,8	0,7	−77	19	**2,2**	**1,9**	−247
02	1,0	0,9	−364	08	0,8	0,7	+159	14	1,3	0,8	−110	20	**2,3**	**1,6**	+435
03	0,5	0,7	+68	09	1,4	1,3	−121	15	**1,7**	0,9	+245	21	**2,6**	**4,5**	−908
04	0,5	0,8	−37	10	0,9	1,0	−23	16	1,1	0,7	+48	22	0,1		−14

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=7 sesji); pogrubione ≥ 1,5.

Cena odniesienia: zamknięcie sesji 28.10 z danych M1 (28.10 22:57 PL = 21:57 UTC) = 7 727. 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: Profile sesji 20.10, 21.10, 22.10 z archiwum (kolumna „today" z dnia sesji; kolumna dzienna nowego pliku zawiera też początek kolejnej sesji). Starsze sesje z archiwum: 08.10, 09.10, 12.10, 13.10, 14.10, 15.10.

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

- **Gdzie stoi wolumen:** 72,6% wolumenu sesji 28.10 powstało nad ceną zamknięcia, 27,4% pod nią. Największe poziomy: 7 728 (5,8%), 7 724 (5,5%), 7 729 (5,3%).
- **Agresja w zakresie sesji:** górna 1/3: delta −173 (1% wol.); środkowa 1/3: delta −2,1k (21% wol.); dolna 1/3: delta +239 (79% wol.).
- **Najsilniejsi kupujący (ask):** 7 727 (+401), 7 723 (+322), 7 722 (+219); **najsilniejsi sprzedający (bid):** 7 740 (−436), 7 725 (−350), 7 724 (−332).
- **10 sesji (15.10–28.10):** POC z 7 697 do 7 728 (+31 pkt); delta dodatnia w 5 z 10 sesji, suma −4,6k; wolumen 28.10 = ×0,81 średniej 9 wcześniejszych sesji.
- **Godziny 28.10:** największy wolumen 21:00 PL (5 405, POC 7 724); najmocniejsze kupno 20:00 PL (+435), najmocniejsza sprzedaż 21:00 PL (−908); POC godzinowy od 7 724 do 7 724.



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 28.10

Cena	Wolumen	Bid	Ask	Delta	Udział
7 728	2 926	1 447	1 428	−19	5,8%
7 724	2 777	1 497	1 165	−332	5,5%
7 729	2 703	1 301	1 321	+20	5,3%
7 727	2 701	1 085	1 486	+401	5,3%
7 732	2 637	1 392	1 141	−251	5,2%

Sesje w pliku (10)

Sesja	Wolumen	×śr.	Delta	POC	VA
15.10	72 532	1,16	+2,3k	7 697	7 683–7 707
16.10	65 020	1,04	−1,6k	7 757	7 691–7 764
19.10	47 671	0,76	+810	7 697	7 693–7 710
20.10	68 527	1,10	+59	7 691	7 677–7 714
21.10	50 343	0,81	−936	7 732	7 719–7 743
22.10	68 585	1,10	−3,4k	7 685	7 648–7 701
23.10	72 008	1,15	−424	7 662	7 642–7 672
26.10	70 402	1,13	+147	7 634	7 622–7 655
27.10	46 648	0,75	+499	7 688	7 668–7 701
28.10	50 550	0,81	−2,1k	7 728	7 723–7 737

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.