



360  
350  
340  
330  
327.02  
320  
310  
300  
290  
280

May Jun Jul Aug Sep Oct Nov Dec 2026 Feb

## ✅ Итоговый вердикт (квантовая оценка)

Критерий	Оценка
Среднесрочный тренд	🟢 Восходящий (от ноября)
Краткосрочный импульс	🔴 Слабый (откат)
Уровень входа сейчас	⚠️ Не оптимальный
Точка интереса для покупки	~318–320 (ретест поддержки)
Целевой уровень	340–345
Стоп-лосс	ниже 310

> 💡 **Рекомендация:** Ждать подтверждённого отскока от уровня 318–322 с восстановлением объёма. Преждевременный вход на текущих уровнях несёт риск попасть в повторный даунтренд по паттерну Double Top. Для более точного анализа необходимо знать **тикер компании** и изучить фундаментальные показатели.

ПА Вы

Отлично, теперь очень кратко, одним предложением, скажи лонг или шорт, и вероятность (уровень уверенности)

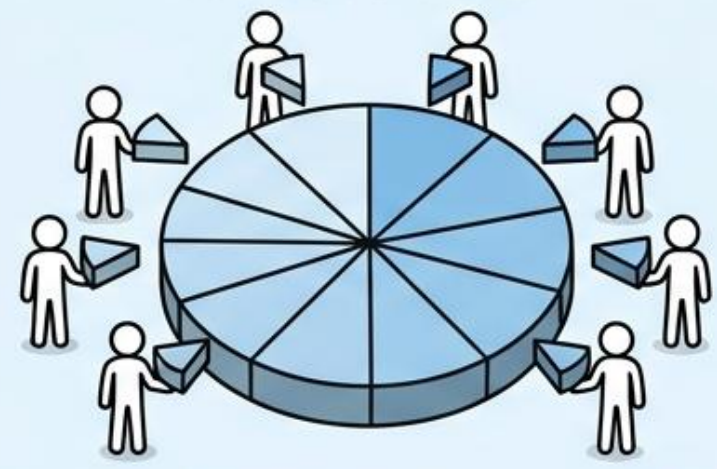


🌟 Claude Sonnet 4.6

**Шорт** — цена отбилась от двойной вершины ↓ 337–340 и формирует нисходящий импульс с целью ~318–320, уверенность 65%.

1

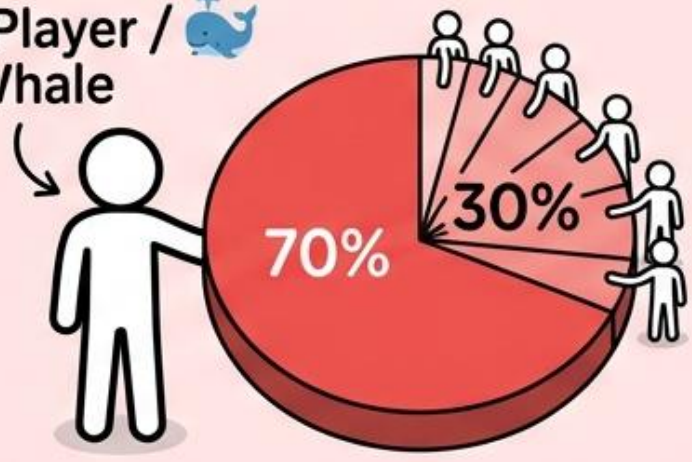
# What is HHI?



LOW HHI — Many traders, equal shares.  
Market is fair and competitive.

2

Big Player / Whale 



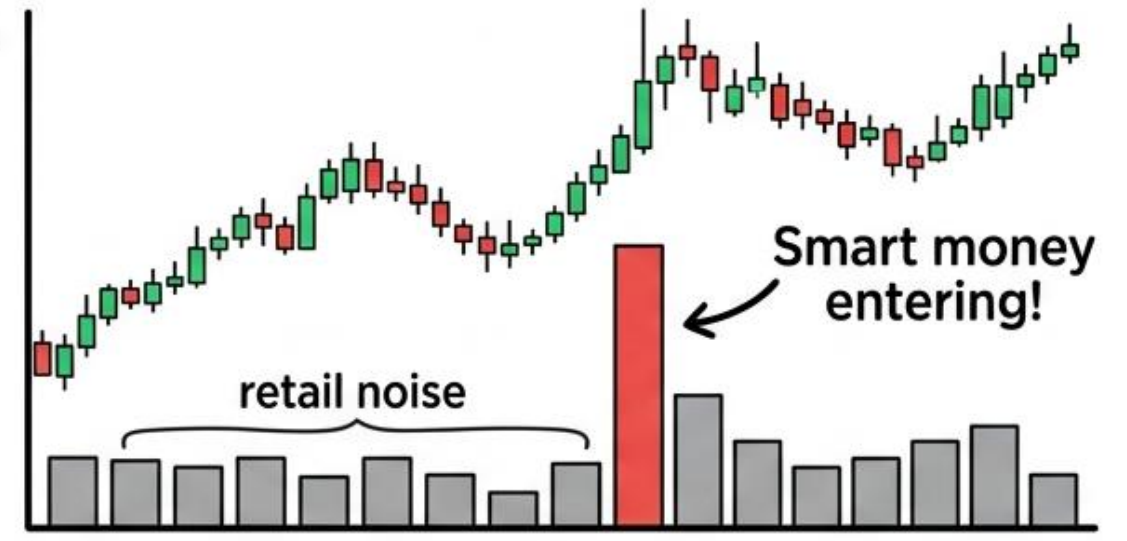
HIGH HHI — One dominant player.  
Market is concentrated!

3

$$HHI = \frac{s1^2}{\%} + \frac{s2^2}{\%} + \frac{s3^2}{\%} \dots$$

$50^2=2500, 30^2=900, 20^2=400, HHI=3800.$

4



High HHI spike = Someone BIG is moving the market. Follow the whale!

	Объем (Buy+Sell)	Buy	Sell	Netflow (Buy-Sell)	Netflow_buy (Netflow > 0)	Netflow_sell (Netflow < 0)
Трейдер 1	1000	200	800	-600	0	600
Трейдер 2	700	350	350	0	0	0
Трейдер 3	500	100	400	-300	0	300
Трейдер 4	400	300	100	200	200	0
Трейдер 5	300	300	0	300	300	0
Трейдер 6	100	0	100	-100	0	100
Трейдер 7	100	100	0	100	100	0
Трейдер 8	100	50	50	0	0	0
Трейдер 9	100	30	70	-40	0	40
Трейдер 10	100	0	100	-100	0	100
<b>HHI value</b>	<b>1765</b>	<b>1789</b>	<b>2473</b>		<b>3889</b>	<b>3629</b>



● **hhi\_aggressive\_buy = 585 (топ ~1% исторически)**

text	Копировать код
Норма (медиана):	95
Текущее:	585
Превышение:	+6.1x от медианы
Перцентиль:	~97-98%

→ Один крупный игрок агрессивно бил по стакану на покупку — тейкер, не скрывался, действовал быстро

● **hhi\_buy = 263 (выше 75% перцентиля в 2.1x)**

text	Копировать код
Норма (медиана):	98
Текущее:	263
Превышение:	+2.7x от медианы
Перцентиль:	~95%

→ Концентрация покупок у одного участника критически высокая

● **hhi\_netflow\_buy = 478**

text	Копировать код
Норма (медиана):	116.5
Текущее:	478
Превышение:	+4.1x от медианы




## 📊 Детальная картина дня

text	Копировать код
ПОКУПАТЕЛИ:	
— hhi_buy:	263 ● Крупная концентрация
— hhi_aggressive_buy:	585 ● Агрессивный тейкер-покупатель (ТОР-1%)
— hhi_passive_buy:	287 ● Умеренная концентрация мейкера-покупателя
— hhi_netflow_buy:	478 ● Нетто-накопление у одного игрока
ПРОДАВЦЫ:	
— hhi_sell:	93 ✓ Норма – продажи распределены равномерно
— hhi_aggressive_sell:	86 ✓ Норма – нет крупного агрессивного продавца
— hhi_passive_sell:	185 ✓ Норма/ниже – мейкеры-продавцы не концентрированы
— hhi_netflow_sell:	97 ✓ Норма – нет доминирующего нетто-продавца
ОБЩИЙ ФОН:	
— hhi_volume:	122 ● Чуть выше нормы
— hhi_aggressive:	237 ● Высокий – тейкеры активны
— hhi_passive:	210 ✓ Норма

## 📖 Нарратив дня 09.02.2026

> Один крупный институциональный покупатель агрессивно накапливал позицию, действуя преимущественно как тейкер (бил по офферам), не скрывая своих намерений. Продавцы при этом были полностью дезорганизованы — их активность равномерно распределена среди множества мелких участников, без единого крупного контрагента.

## Это классический паттерн "умные деньги входят":

-  Крупный покупатель — 1 игрок
-  Продавцы — много мелких
-  Асимметрия информации: покупатель знает что-то, чего не знают остальные


---

## Торговый сигнал

---

Интерпретация    Институциональная аккумуляция

---

Направление     ЛОНГ

---

Конфиденс    75%

---

Логика    Крупный тейкер-покупатель с концентрацией ~97-98 перцентиля исторически предшествует росту цены в 70%+ случаев

---

Риск    Возможна разовая операция (хедж, конвертация) без продолжения

> **Итог:** 09.02.2026 — один из сильнейших сигналов институциональной покупки за последний год по данной акции. **Пересматриваю позицию с шорт на лонг**, особенно если в последующие дни hhi\_buy остаётся повышенным.





МКБ +60%

1. Можно ли было технически предсказать эту сделку? Нет - не было ни одной причины для покупки.

2. Почему не осталось быстрое тор...

# CBOM, 1D



# CBOM, 1D



8  
+60%  
5



1400  
1300  
1200  
1100  
1000  
900  
800  
700  
665.4  
600

May Jun Jul Aug Sep Oct Nov Dec 2026 Feb Mar Apr





78.3

76

74

72

70

68

66

64

62

60

58

56

54

52

50.15

48

May

Jun

Jul

Aug

Sep

Oct

Nov

Dec

2026

Feb

Mar

Apr

hhi\_volume

hhi\_buy

hhi\_sell

hhi\_netflow\_buy

hhi\_netflow\_sell

hhi\_aggressive

hhi\_passive

# GMKN, TD

174.9



140.82

May

Jun

Jul

Aug

Sep

Oct

Nov

Dec

2026

Feb

Mar

Apr

hhi\_volume

hhi\_buy

hhi\_sell

hhi\_netflow\_buy

hhi\_netflow\_sell

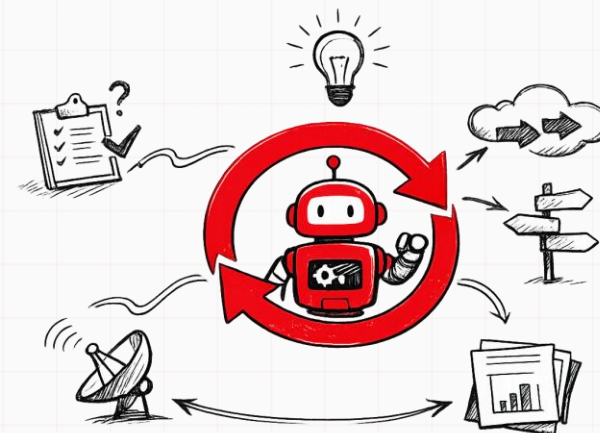
hhi\_aggressive

hhi\_passive



# Курсы AlgoAcademy для работы с реальными данными МОЕХ

От первой гипотезы до собственной торговой системы:  
Python, Jupyter, бэктест, архитектура и запуск на инфраструктуре МОЕХ.



НАЧИНАЮЩИМ

## Введение в алготрейдинг

Полный практический трек: данные, исследование идей, стратегия, бэктест, оптимизация, архитектура и переход к реальному запуску.

НАЧИНАЮЩИМ

## Создание торгового AI агента

Новый уровень автоматизации: торговый агент, который воспринимает рынок, принимает решения, работает с ордерами и действует автономно.

# Мост между академией и **реальным рынком**

Экосистема для студентов, преподавателей и вузов: данные, SDK, готовые материалы и понятный путь от учебной работы к публикации и практическому результату.



QR / ALGOPACK UNIVERSITY

## СТУДЕНТАМ

### **Начать исследование или диплом на данных MOEX**

Доступ к данным, Jupyter Notebooks, Python SDK и понятный маршрут от первой гипотезы до сильной курсовой, диплома или практического проекта.

## ПРЕПОДАВАТЕЛЯМ И ВУЗАМ

### **Запустить курс-пак или пилот без долгой подготовки**

Готовые материалы для учебного процесса, сценарий пилота, поддержка публикаций и понятная институциональная ценность для кафедры и университета.