

اختبار ICT Silver Bullet

على QQQ (وكيل Nasdaq-100) · نافذة نيويورك 10:00–11:00 · بعد التكاليف

RULES.md SHA-256

82e159b95fdf17aa22de5ede272b5021baecbad4bc3cd605742c9fed7529674e

scuta.io/ar · محتوى تعليمي، ليس نصيحة استثمارية

{{HANDLE}} · 2003-09-10 → 2026-10-13

1. الخلاصة في صفحة

الصفقات	السنوات (QQQ)
1,145	23
Win Rate مقابل تعادل 2R	التوقع الرياضي بعد التكاليف
30.3% / 33.3%	-0.124 R
% من التشغيلات العشوائية التي تفوقت عليه	
84%	
الحكم: لا دليل على ميزة Edge. التوقع الرياضي -0.124 R بعد التكاليف، وتوقع على 16% فقط من 1,000 تشغيل عشوائي (p = 0.842). العلامة: X.	

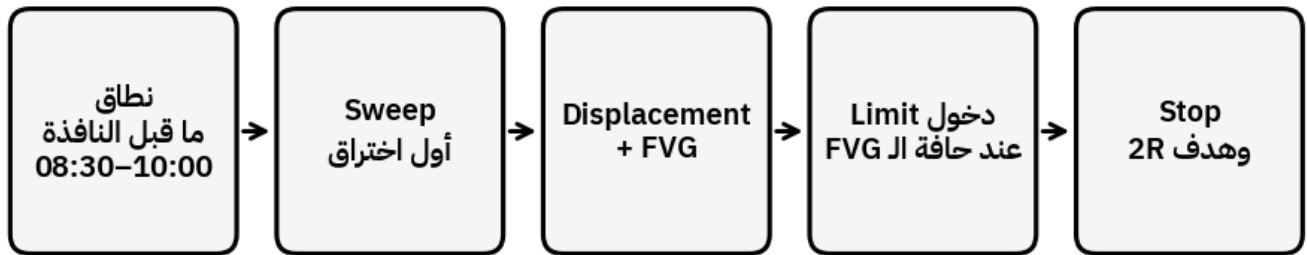
عينة: 1,831 يوماً قابلاً للتداول من 5,810 يوم عمل؛ 3,979 يوماً أسقط لنقص دقيقة في 11:00-08:30.

2. القواعد كما اختُبرت

الخلاصة بصيغة مباشرة (نافذة نيويورك 10:00–11:00):

- ابنى نطاق ما قبل النافذة 08:30–09:59 (PWL / PWH)، مع PDH/PDL إن بقيت سليمة.
- أول Sweep داخل 10:00–10:59 يحدد الاتجاه (بيع سيولة → صاعد فقط، والعكس).
- ابحث عن Displacement (جسم $\leq 1.5 \times$ متوسط 20) يترك FVG؛ خذ أول FVG فقط.
- أمر Limit عند الحافة القريبة من الـ FVG؛ Stop خلف طرف الـ Sweep؛ هدف 2R.
- تنفيذ متحفظ على الـ Ask/Bid النموذجي؛ خروج زمني عند 16:00 إن لزم.

مسار الإعداد كما اختبر



اختيارات التفسير (مقفلة قبل النتائج)

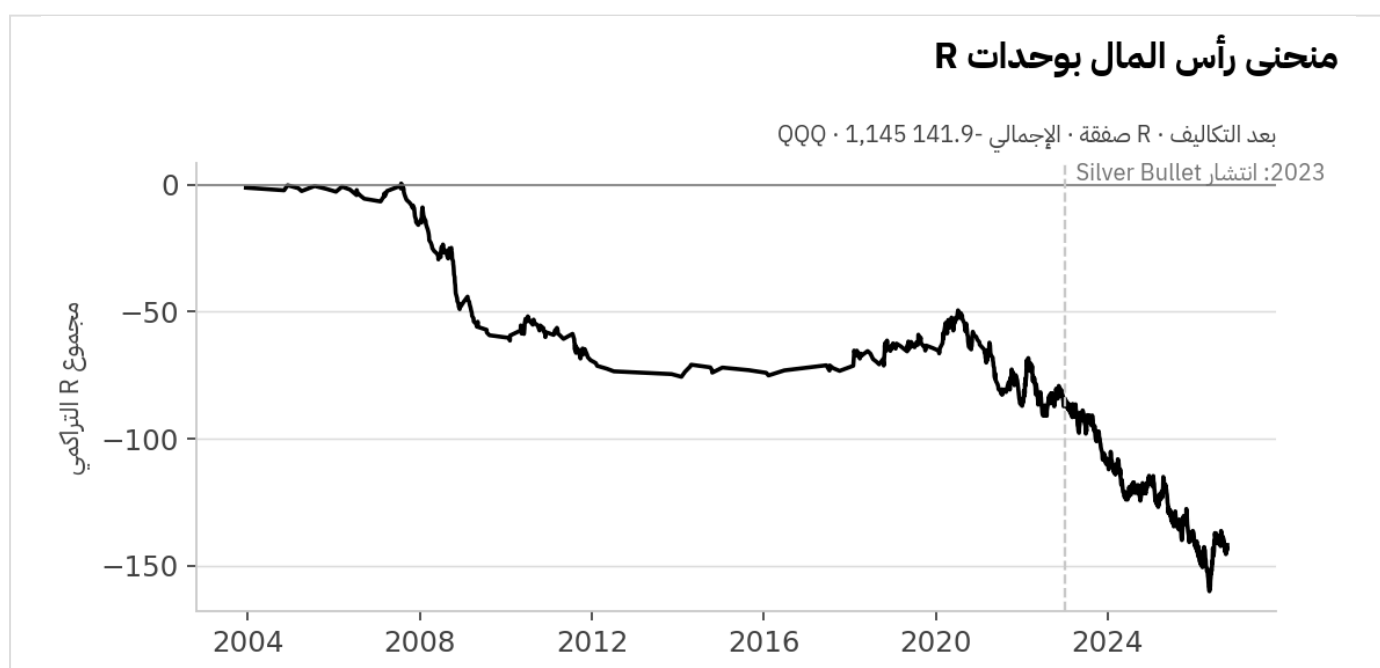
#	الموضوع	الاختيار
I-3	أي مستويات تُحسب	مستوى اليوم السابق يُحسب فقط إن بقي سليماً عند فتح النافذة.
I-4	اكتساح الجانبين معاً	يُتخطى اليوم (الاتجاه غير معرّف).
I-5	بداية الـ FVG	الشمعة 1 قد تكون شمعة الـ Sweep نفسها.
I-6	اتجاه الـ Displacement	الشمعة 2 تُغلق في اتجاه الإعداد + قاعدة $\times 1.5$.
I-7	أي FVG	أول FVG مؤهل فقط؛ إن لم يُملأ الأمر فلا صفقة.
I-8	سعر التنفيذ	سعر الـ Limit تماماً، بلا تحسين.
I-9	طرف الـ Sweep لا Stop	أدنى/أعلى من شمعة الـ Sweep حتى الشمعة 3، ± 1 tick.
I-11	ترتيب شمعة التنفيذ	الـ Stop يمكنه التفعيل على شمعة التنفيذ؛ الهدف لا.

3. كيف اختبرناه

- البيانات: QQQ كوكيل لـ Nasdaq-100، دقائق 3,902,982، 2003-09-10 → 2026-10-13، شمعة بعد التنظيف.
 - التكاليف: فارق سعري نموذجي \$0.01 لكل جهة (ذهاباً وإياباً \$0.02) + انزلاق \$0.01 Stop.
 - قواعد الملء متحفظة: لا سعر أفضل من الـ Limit؛ التباس الشمعة الواحدة → Stop.
 - القواعد أُقفلت قبل النتائج. SHA-256 لـ RULES.md:
82e159b95fdf17aa22de5ede272b5021baecbad4bc3cd605742c9fed7529674e
 - DATA_ADDENDUM.md أُقفل قبل تنزيل Massive الكثيف:
45174c8fbd5436bfccce1688a117dbca560eab2f65a191602037d7924ba90102c
- بدون فارق سعري ولا انزلاق كان التوقع -R 0.037؛ التكاليف سحبت نحو -R 0.124.

4. النتائج

المقياس	القيمة
Trades	1,145
Trades / month	4.1
Win Rate	30.3%
Expectancy R	-0.124
Total R	-141.9
Profit factor	0.83
Max DD R	160.6
Avg win / loss R	+1.952 / -1.027
vs random (pct / p)	16 / 0.842
الحكم	x



حسب السنة

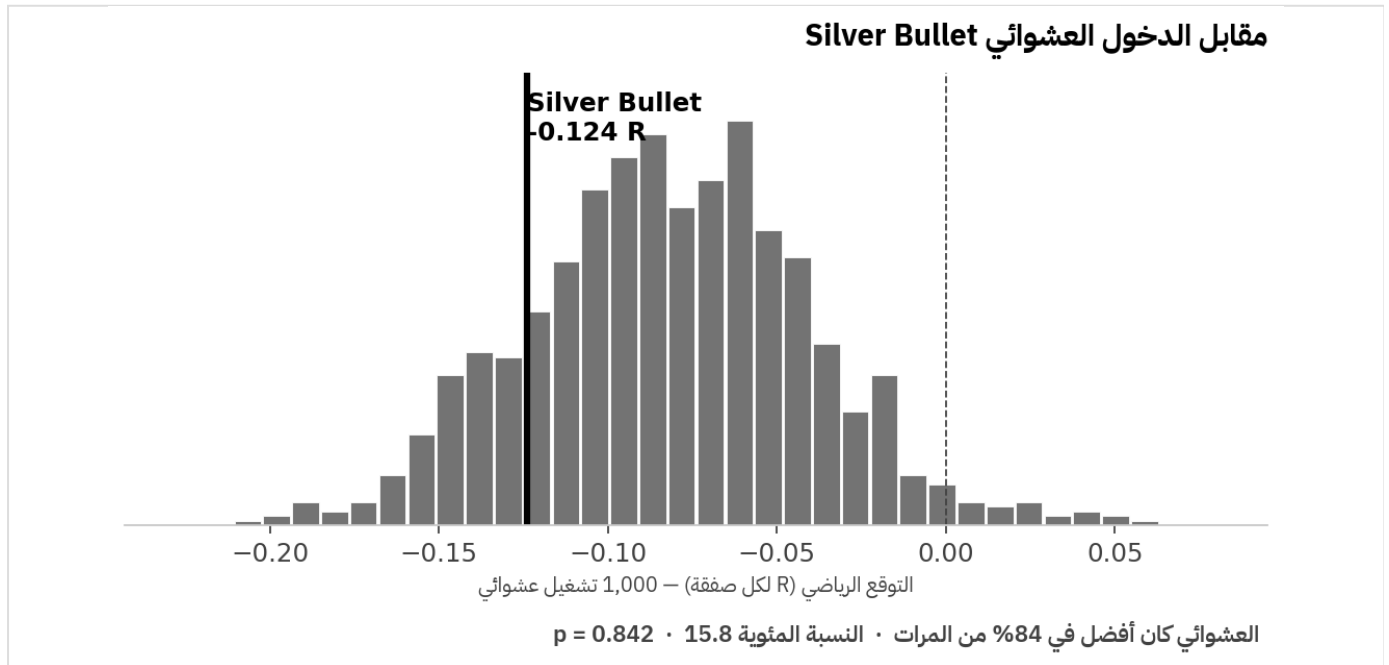
PF	Total R	Exp. R	Win %	Trades	Year
0.0	-1.1	-1.100	0.0	1	2003
1.92	+1.0	+0.478	50.0	2	2004
0.58	-1.4	-0.356	25.0	4	2005
0.51	-3.9	-0.430	22.2	9	2006

PF	Total R	Exp. R	Win %	Trades	Year
0.5	-10.3	-0.414	24.0	25	2007
0.44	-32.2	-0.474	20.6	68	2008
0.35	-11.2	-0.590	15.8	19	2009
1.06	+1.3	+0.043	36.7	30	2010
0.59	-11.1	-0.337	24.2	33	2011
0.0	-4.4	-1.098	0.0	4	2012
0.0	-1.1	-1.080	0.0	1	2013
1.14	+0.6	+0.081	42.9	7	2014
1.96	+1.0	+0.491	50.0	2	2015
0.96	-0.1	-0.029	33.3	3	2016
0.95	-0.2	-0.033	33.3	6	2017
1.38	+8.8	+0.227	41.0	39	2018
1.0	+0.1	+0.002	34.3	35	2019
1.08	+3.4	+0.049	35.7	70	2020
0.61	-25.1	-0.299	23.8	84	2021
1.01	+0.8	+0.005	34.2	158	2022
0.77	-22.8	-0.169	28.9	135	2023
0.91	-7.7	-0.061	31.7	126	2024
0.8	-21.6	-0.142	29.6	152	2025
0.95	-4.6	-0.035	32.6	132	2026

SCUTA · 5

scuta.io/ar · محتوى تعليمي، ليس نصيحة استثمارية

5. المقارنة مع الدخول العشوائي



لكل يوم تداول فيه Silver Bullet فعلياً، نختار دقيقة عشوائية داخل الساعة نفسها واتجهاً عشوائياً (50/50)، بنفس مسافة ال Stop ونفس هدف 2R ونفس التكاليف، ونكرر ذلك 1,000 مرة (seed = 20231015). النسبة المئوية 15.8 تعني أن النتيجة الحقيقية كانت أفضل من تلك النسبة فقط من التشغيلات العشوائية. قيمة $p = 0.842$ هي احتمال (تحت العشوائية) للحصول على نتيجة $\leq$ الحقيقية؛ هنا العشوائي كان أفضل في 84% من المرات. المتوسط العشوائي -0.082 R مقابل -0.124 R للحقيقي.

6. النسخ الأخرى

كل نسخة تغيّر شيئاً واحداً فقط مقابل العنوان. London غير قابلة للاختبار على QQQ (لا شموع قبل 04:00 ET).

النسخة	Trades	Win %	Exp. R	PF	Pct	p
London 03:00–04:00	n/a					
PM 14:00–15:00	2,839	26.0	-0.348	0.56	0	1.0
CE (منتصف ال FVG)	1,061	29.0	-0.159	0.78	10	0.898
هدف 3R	1,145	24.1	-0.117	0.85	22	0.781
هدف نطاق معاكس	1,099	20.1	-0.077	0.91	34	0.66
فلتر Daily bias	564	28.7	-0.172	0.77	6	0.942

7. حسب الفترة

الفترة	Trades	Win %	Exp. R	Total R	PF	Pct	p
before 2019	253	27.3	-0.255	-64.4	0.67	19.4	0.806
2019-2022	347	32.0	-0.060	-20.8	0.91	49.5	0.505
2023-2026	545	30.6	-0.104	-56.7	0.85	22.5	0.775

8. الإنصاف والحدود

- QQQ صندوق مؤشر؛ سلوكه قريب من Nasdaq-100 لكنه ليس عقود (MNQ/NQ) futures بفارقها وساعاتها.
- التعليمليم العام لـ ICT تقديري؛ هذه قراءة واحدة مقفلة، ليست «كل» Silver Bullet.
- أسقطت 3,979 يوماً لنقص دقيقة في نافذة 08:30–11:00 (خصوصاً في السنوات الأولى من بيانات ما قبل الافتتاح).
- الفارق السعري نموذجي ومتحفظ، لا مقتبس لحظة بلحظة من دفتر أوامر حي.
- علامة X/V وُضعت في RULES.md قبل أي نتيجة: توقع $0 < p < 0.05$ مقابل العشوائي.

9. ملحق: كود كشف الإعداد

مقتطف من engine.py (منطق FVG → Sweep → دخول). ملف القواعد الكامل RULES.md متاح مع الدراسة.

```
# engine.py - sweep → FVG → entry (excerpt)
for i in range(w0, w1 + 1):
    sb = [n for n, lv in buy.items() if b.mh[i] > lv]
    ss = [n for n, lv in sell.items() if b.ml[i] < lv]
    if sb and ss:
        sweep_i, side = i, "both"
        break
    if sb or ss:
        sweep_i, side, swept = i, ("buy" if sb else "sell"), (sb or ss)
        break
if sweep_i is None:
    rec["status"] = "no_sweep"
    continue
rec.update(sweep_idx=sweep_i, sweep_side=side, swept="+".join(swept))
if side == "both":
    rec["status"] = "sweep_both_sides" # [I-4]
    continue
long = side == "sell"
rec["direction"] = "long" if long else "short"

fvg = None
for c1 in range(sweep_i, w1 - 1): # [I-5] c1 ≥ sweep bar, c3 ≤ last window bar
    c2, c3 = c1 + 1, c1 + 2
    if c2 - cfg.disp_lookback < 0:
        continue
    avg = float(b.body[c2 - cfg.disp_lookback:c2].mean())
    if b.body[c2] < cfg.disp_mult * avg:
        continue
    if long and b.mh[c1] < b.ml[c3] and b.mc[c2] > b.mo[c2]:
        fvg = (c1, c2, c3, avg)
        break
```

SCUTA

اكتب لنا القواعد التي تريد اختبارها

scuta.io/ar

{{HANDLE}}

scuta.io/ar · محتوى تعليمي، ليس نصيحة استثمارية

