

AKIN+BOT: INFQ SAVDOSI CHUQUR AUDITI VA INSTITUTIONAL ZONA STRATEGIYASI

Matematik Tahlil, S&P; 500 & VIX Filtrlari, Level 2 Bookmap va IBKR Ma'lumotlar Tarifi

Ijroiya Xulosasi: 2026-yil 30-sentyabr kuni soat 23:33 UZT da ochilgan **INFQ** savdosi **Engine 2 (Connors RSI(2))** signali asosida amalga oshirilgan. Narx \$13.61 dan olinib, Stop Loss \$13.20 (-3.15%) darajasida urildi (zarar -\$11.89). Ushbu hisobotda savdo nima sababdan xato bo'lgani, S&P; 500 va VIX makro ko'rsatkichlarining ta'siri, Level 2 Order Book zonalarini va stop-lossni to'g'ri qo'yish matematikasi to'liq asoslab beriladi.

1. INFQ SAVDOSINING CHUQUR AUDITI VA 4 TA ASOSIY XATOLIK SABABI

Parametr	Qiymat	Xatolik Tahlili va Xulosa
Kirish Vaqti	2026-09-30 23:33:35 UZT (14:33 EDT)	Bozor yopilishidan 1.5 soat oldin (institutlar pozitsiyani tozalash vaqti)
Kirish Narxi & Qty	\$13.61 (29 dona, jami \$394.69)	Pozitsiya hajmi to'g'ri, lekin kirish vaqti xavfli
RSI(2) Indikatori	3.8 < 12.0 (Ekstremal arzonlashuv)	Texnik jihatdan Engine 2 qoidasiga mos kelgan
SMA(200) Masofasi	SMA200 = \$13.24 (Bor-yo'g'i +2.79%)	KRITIK XATO: Narx SMA200 ga juda yaqin edi! Kamida +5% bufer bo'lishi shart edi!
Tarixiy Dinamika	4 kun ketma-ket qizil sham (\$14.88 -> \$13.05)	Falling Knife: Kuchli pasayuvchi impulsda arzonlashuv dip emas, buzilishdir
S&P; 500 (SPY) Holati	SPY 769.40 dan 762.63 ga quladi (-0.9%)	Bozor darsi: Bozor sotuvda bo'lganda individual aksiyalar ham oqib ketadi
Stop Loss Joylashuvi	\$13.20 (-3.15%)	Stop Hunting Qurboni: Stop aynan SMA200 (\$13.24) tagiga qo'yilgan!

2. AKIN+BOT: YOMON SAVDOLARDAN SAQLOVCHI 4 BOSQICHLI FILTR (GATEKEEPER)

1-Bosqich: Makro Iqtisodiy Kalendar Filtri: FOMC (stavka foizi), CPI (inflyatsiya), PPI, NFP (mehnat bozori) va FED raisi Powell nutqi kunlarida e'lon vaqtidan 30 daqiqa oldin va 30 daqiqa keyin savdoga kirish butunlay bloklanadi.

2-Bosqich: S&P; 500 va VIX Qo'rquv Indeksi:

- SPY > Intraday VWAP va SPY > 20 EMA bo'lishi shart (faqat buqa bozorida LONG ochiladi).
- VIX < 20.0 bo'lishi va VIX kunlik sakrashi < +5% bo'lishi shart. Agar VIX portlab o'sayotgan bo'lsa, savdo to'xtatiladi.

3-Bosqich: SMA200 Xavfsiz Buferi (+5% Qoidasi):

- Narx SMA200 dan kamida +5.0% balandda bo'lishi shart ($Price \geq 1.05 * SMA200$).
- SMA200 ning 20-kunlik nishabi musbat ($Slope > 0$) bo'lishi shart (pasayuvchi SMA200 da xarid yo'q!).

4-Bosqich: Institutsional Likvidlik va Spread: Spread <= 0.4%, RVOL >= 2.0x, ATR >= \$0.30.

3. INTERACTIVE BROKERS: LEVEL 2 BOOKMAP VA ORDER BLOCK MA'LUMOT TARIFLARI

Professional darajada fondlar va yirik market-meykerlarning **Order Block** (yirik limit xarid/sotuv devorlari)larini ko'rish uchun IBKR Client Portal orqali quyidagi rasmiy tariflarni faollashtirish tavsiya etiladi:

Tarif Nomi (IBKR Portal)	Oylik Narxi	Imkoniyati va Foydasi
US Securities Snapshot & Futures Value Bundle	\$10.00 / oy (Komissiya > \$30 bo'lsa BEPUL)	AQSH barcha aksiyalari uchun 1-darajali (Level 1) real-time streaming NBBO narxlar (Bid, Ask, Last, Volume).

US Equity and Options Add-On Streaming Bundle	\$4.50 / oy	NASDAQ, NYSE, AMEX bo'yicha uzluksiz sekundlik kotirovka oqimi.
NASDAQ TotalView-OpenView (Level 2)	~\$15.00 / oy	BOOKMAP STANDARTI: NASDAQ birjasidagi har bir sentdagi barcha ochiq limit buyruqlarini (Order Book / Deep Liquidity) to'liq ko'rsatadi. Yirik institutsional xaridor devorlari (Buy Walls) darhol aniqlanadi.
NYSE OpenBook (Level 2)	~\$15.00 / oy	NYSE birjasidagi to'liq Level 2 kitob chuqurligi.

4. INSTITUTIONAL ZONALAR VA STOP LOSS:TAKE PROFIT (R:R 1:2, 1:3) QOIDASI

Nima uchun Stop Loss juda uzoqqa qo'yilmasligi kerak?

INFQ savdosida ko'rganimizdek, agar Stop Loss qo'llab-quvvatlash zonasidan (SMA200) pastga qo'yilsa, u stop-ovchilar (Stop Hunters) tomonidan uriladi. To'g'ri stop loss matematikasi:

- **Stop Loss Formulasy:** $SL = \text{Order Block Support} - (0.3 * ATR)$. Stop masofasi kirish narxidan maksimal 1.5% - 2.0% dan oshmasligi shart!
- **Take Profit 1 (50% hajm yopish):** $TP1 = \text{Entry} + 2.0 * (\text{Entry} - SL)$ (**Risk:Reward 1:2**). Birinchi nishonga yetganda pozitsiyaning yarmi sotiladi va Stop darhol **NOLGA (Breakeven / Kirish narxiga)** suriladi!
- **Take Profit 2 (qolgan 50% hajm):** $TP2 = \text{Entry} + 3.5 * (\text{Entry} - SL)$ (**Risk:Reward 1:3.5**) yoki Trailing Stop orqali foydani maksimal ushlab.

Matematik Kutilma: Agar 10 ta savdodan 5 tasi zarar (-1R) va 5 tasi foyda (+2R va +3.5R) bo'lsa ham: $\text{Net Foyda} = (5 * 2.75R) - (5 * 1.0R) = +8.75R$ toza foyda beradi!

5. AKIN+BOT: AVTOMATIK POST-TRADE TAHLIL TIZIMI (O'Z-O'ZIDAN O'RGANISH)

Har bir tugallangan savdo (foydali yoki zararli) darhol trade_post_mortem_warehouse.db bazasiga quyidagi parametrlar bilan yoziladi:

1. Savdo vaqtidagi S&P; 500 va SPY VWAP masofasi.
2. VIX indeksi darajasi va kunlik o'zgarishi.
3. SMA200 dan uzoqlik foizi va SMA200 nishabi.
4. Order Block qo'llab-quvvatlash darajasi.
5. Sabab tahlili: Stop urilishiga nima sabab bo'ldi (Makro xabar, Spred, yoki Bozor drayveri).

O'z-o'zidan takomillashish mexanizmi: Har juma kuni bot ushbu bazani o'rganib chiqadi. Agar biron parametr (masalan, SMA200 ga 3% dan yaqin bo'lgan aksiyalar) 60% dan ko'p zarar keltirgan bo'lsa, bot avtomatik ravishda ushbu shartni o'z kodiga yangi taqiq sifatida kiritadi!