

# ТРЕНИНГ CME MASTERY

от Романа Анкудинова

Профессиональная система чтения рынка по данным CME, которая снимает иллюзии и показывает, где лежат настоящие деньги



## CME Mastery

### Профессиональная система чтения рынка по данным CME

Добро пожаловать в программу обучения на основе опционного анализа биржи CME. Этот интенсивный 10 модульный курс разработан для трейдеров, готовых перейти от поверхностного технического анализа к глубокому пониманию механики рынка. Вы узнаете, как институциональные игроки используют опционные контракты для управления фьючерсными ценами, и научитесь видеть рынок глазами профессионалов.

Программа построена на практическом разборе реальных сделок и биржевых механизмов. Вы освоите работу с уровнями MDD, поймете логику хеджеров и научитесь использовать вероятностные области для фильтрации сигналов. Каждый модуль включает конкретные инструменты, пошаговые алгоритмы и разбор типичных ошибок, которые мешают большинству трейдеров достичь стабильной прибыльности.

<https://myevelab.ru/>

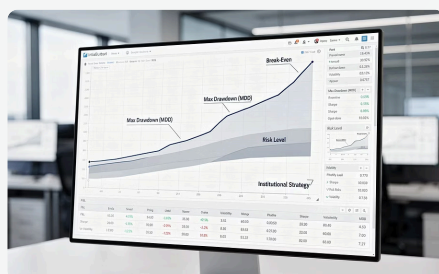
# Модуль 1: Механика опционов и физика уровней MDD

Первый модуль погружает вас в фундаментальные процессы, управляющие движением цены на бирже СМЕ. Вы узнаете, как небольшие объемы опционных контрактов способны направлять гигантский рынок фьючерсов и как опционы превращаются в фьючерсные сделки при экспирации. Ключевое внимание уделяется уровням MDD — точкам математического безубытка крупных игроков.



## Оptionная механика

Понимание того, как опционы влияют на фьючерсный рынок и конвертируются при экспирации.



## Точки безубытка

Уровни MDD как ключевые зоны для хеджеров, где они защищают свои позиции от убытков.



## Биржевое сведение

Изучение механики сбора ликвидности и формирования ценовых зон на бирже СМЕ.

# Содержание Модуля 1: От теории к практике

01

## **Введение: Роль опционов в управлении рынком**

Разбор реальных сделок по MDD на примере золота и австралийского доллара. Изучение механики превращения опционов в фьючерсные позиции и понимание, почему малые объемы опционов управляют огромным рынком деривативов.

02

## **Анатомия Call и Put опционов**

Математика покупателя и продавца опционов. Понятие премии, страйка и точки безубыточности. Анализ асимметрии рисков: ограниченный риск покупателя против потенциально безграничного риска продавца контракта.

03

## **Профессиональные опционные конструкции**

Обзор стратегий хедж-фондов: бабочки, кондоры и стреддлы. Изучение способов создания беспроигрышных сценариев и методов заработка на волатильности или её отсутствии на рынке.

04

## **Физика уровней MDD**

Понимание MDD как первого рубежа обороны институциональных игроков. Детальный разбор того, почему хеджеры начинают продавать фьючерс именно на этих уровнях для минимизации убытков по опционам.

05

## **Сведение ордеров и механика ликвидности**

Работа в стакане цен (DOM). Понимание разницы между лимитными и стоп-ордерами. Изучение того, как крупные игроки инициируют срабатывание стоп-лоссов розничных трейдеров.

06

## **Охота за стопами: Захват ликвидности**

Развенчание мифа о «защите позиций». Понимание реальной механики биржи: использование Buy Stop ордеров толпы как контрагента для крупных Sell Limit заявок профессиональных игроков.

07

## **Работа с данными CME и индикатором OI**

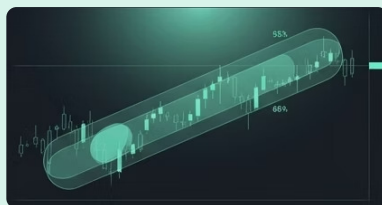
Практическая работа с отчетами Daily Bulletin на сайте биржи CME. Обзор функционала индикатора для автоматизации расчета уровней MDD и зон повышенной волатильности на рынке.

# Ключевые концепции модуля 1



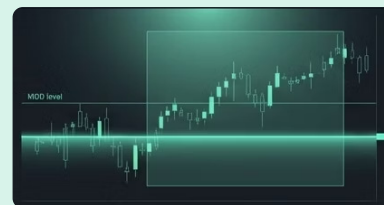
## Опционы как драйвер движения

Опционные контракты являются первичным источником направленного движения фьючерсного рынка. Понимание этой связи позволяет предвидеть развитие ценового движения и определять зоны вероятных разворотов или ускорений тренда.



## Баланс против Equity

Критическая разница между балансом счета и реальным капиталом (Equity) при продаже опционов. Это понимание необходимо для правильной оценки рисков и управления позициями в условиях изменяющейся волатильности рынка.



## MDD как точка безубытка

Уровень MDD - это не просто техническая отметка на графике, а математически рассчитанная точка безубыточности хеджера. Здесь крупный капитал начинает активно защищать свои позиции, создавая мощное сопротивление или поддержку.

## Биржевое сведение ордеров

Stop-ордера всегда исполняются об Limit-ордера. Понимание этого механизма объясняет многие «неожиданные» движения рынка и позволяет видеть манипуляции с ликвидностью.

## Спреды институционалов

Диагональные и календарные спреды в работе профессиональных участников рынка. Эти конструкции позволяют зарабатывать на временном распаде опционов и изменении волатильности.

# Инструменты и методика работы

## Необходимые инструменты

- **Сайт биржи CME**

Работа с ежедневными отчетами Daily Bulletin для получения актуальных данных по опционным позициям и открытому интересу на различных инструментах



- **Индикатор OI**

Автоматический расчет уровней MDD и зон волатильности на основе опционных данных с биржи

- **Стакан цен (DOM)**

Анализ плотностей лимитных ордеров для определения зон накопления крупных позиций

- **Магнитные уровни**

Уровни H1, H4 и сетка Фибоначчи 23.6% для определения направления тренда

---

## Пошаговый алгоритм торговли

### Определение тренда

По уровням H1 и H4

### Анализ стакана

Лимитные работы

### Вход в сделку

За пределами H1

### Поиск уровней MDD

Точки торможения

### Подтверждение

Отбой от уровня

<https://myevelab.ru/>

# Типичные ошибки и результаты модуля 1

## Чего следует избегать

### **Критические ошибки начинающих**

- Попытка торговать опционы без понимания греков, дельты и влияния времени до экспирации контракта
- Вера в миф о «защите уровней» вместо понимания реальной механики набора ликвидности крупными игроками
- Торговля внутри диапазона H1, когда рынок находится в стадии неопределенности и консолидации
- Игнорирование разницы между ценой Форекс и Фьючерса (Forward Point) при переносе уровней

## Ожидаемые результаты

После завершения первого модуля вы получите «рентгеновское зрение» рынка. Вы перестанете видеть в графике случайные свечи и начнете видеть реальную борьбу за ликвидность и уровни, на которых крупный капитал обязан принимать решения.

Вы сможете идентифицировать зоны, где хеджеры защищают свои позиции, понимать логику движения цены к этим уровням и использовать это знание для построения высоковероятностных торговых сценариев с оптимальным соотношением риска к прибыли.

# Модуль 2: Опционные области и техника входа

## Фильтрация сигналов

Работа с вероятностными зонами 68% и 95% для отсеивания ложных пробоев и определения истинных точек разворота

## Выбор уровней

Правило «Второго Call/Put» для приоритизации уровней при наличии нескольких потенциальных точек входа

## Техника изломов

Авторская методика постановки лимитных ордеров на основе структурных изломов графика для оптимизации входа

Второй модуль курса фокусируется на практическом применении знаний, полученных в Модуле 1. Вы научитесь профессионально фильтровать рыночный шум, отделяя высоковероятностные торговые возможности от случайных колебаний цены. Особое внимание уделяется технике точного входа в рынок с минимальным стоп-лоссом.

Вы освоите работу с вероятностными областями, поймете, как выбирать приоритетные уровни MDD из нескольких доступных, и научитесь использовать структурные изломы графика для оптимизации точки входа. Этот модуль превращает теоретические знания в практические навыки профессионального трейдера.

# Программа второго модуля: Практическая фильтрация

## 1 Анализ текущих сделок

Разбор реальных входов по золоту, австралийскому доллару и франку.

Понятие «отрыва свечи» для переноса сделки в безубыток.

Трансформация уровней MDD из сопротивления в поддержку.

1

2

## Опционные области 95% и 68%

Статистическое обоснование вероятностных зон. Объяснение, почему цена 95% времени находится внутри расчетной области. Влияние фундаментальных событий на расширение границ.

## 3 Психология закрытия вне области

Анализ ситуаций, когда торговый день закрывается за пределами вероятностной области. Инерция рынка и поиск оптимальных точек входа на продолжение движения.

3

4

## Алгоритм фильтрации уровней

Правило «Второго Call/Put» для выбора приоритетного уровня при наличии нескольких в одной области. Работа с уровнями вблизи границ и учет Forward Point.

## 5 Опционная плотность

Работа со скоплениями опционных контрактов. Объяснение, почему в плотностях нельзя работать по лимиткам и как использовать 30-минутные разворотные паттерны.

5

6

## Взаимодействие уровней

Логика движения от H1 к H4 через уровень 23.6 Фибоначчи. Приоритет опционной плотности над расчетными величинами. Работа по тренду и против него.

## 7 Техника входа по изломам

Поиск идеальной точки входа через постановку лимитных ордеров на телах свечей в местах структурного слома. Оптимизация на основе анализа исторических данных.

7

8

## Правила стоп-лосса

Математический расчет стоп-лосса по «половине зеленой области». Фиксированные стопы для различных валютных пар и товаров в зависимости от волатильности.

# Ключевые концепции и инструменты модуля 2

## Фундаментальные принципы

### Иерархия фильтрации

Приоритет второго уровня в зоне волатильности над первым для повышения вероятности успешной сделки

### Свежие уровни

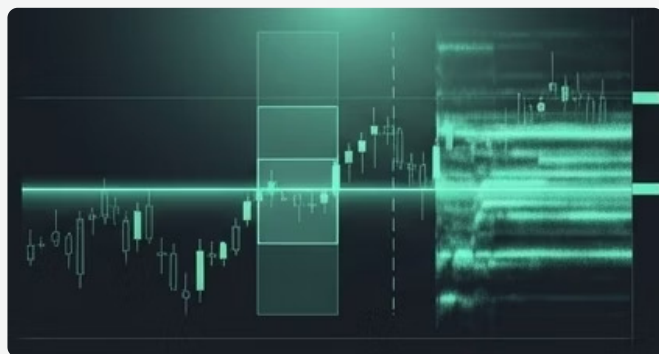
Разница между новыми и «заезженными» уровнями MDD, которые уже отработали свой потенциал

### Forward Point

Обязательный учет разницы котировок CME и Forex-брокеров при построении уровней

### Опционная плотность

Зоны накопления крупных позиций (Big Money) как области разворота и консолидации



## Алгоритм работы второго дня

- 1 Тренд по магнитам (опционально)**  
Вход в коридор H1-H4
- 2 Фильтрация MDD**  
Выбор второго уровня
- 3 Поиск излома**  
Структурный слом свечей
- 4 Лимитный ордер**  
На тело свечи излома
- 5 Стоп-лосс**  
50% области или фикс
- 6 Безубыток**  
При отрыве свечи

# Модуль 3: Паттерны разворота и механика неопределенности

Третий модуль программы CME Mastery посвящен визуальному подтверждению торговых сигналов. Вы изучите конкретные свечные формации, возникающие на критических уровнях MDD и границах опционных областей, осваивают техники распознавания ложных маневров рынка и применяют авторский «паттерн неопределенности» для защиты капитала.

Модуль построен на принципе перехода от базовых разворотных моделей к продвинутым формациям с двойным и тройным поглощением. Особое внимание уделяется психологическим аспектам системной торговли и борьбе с импульсивными решениями в период просадок.

## Ключевые темы Модуля 3

### Базовая модель разворота

Изучение классического разворота от уровня MDD. Правила закрытия сигнальной и разворотной свечей относительно ключевых уровней. Механика преобладания сил покупателей и продавцов в точке касания.

### Фильтрация ложных паттернов

Анализ теней свечей и техника отсева некачественных сигналов. Определение критического размера хвоста против движения. Оптимальные таймфреймы для корректного чтения паттернов.

### Паттерн неопределенности

Авторская формация из 2-4 свечей с длинными хвостами в обе стороны. Своевременное распознавание отсутствия перевеса сил для выхода из позиции до срабатывания стоп-лосса.

# Программа занятий Модуля 3

01

---

## **Базовая модель разворота: Сигнальная и Разворотная свечи**

Классический разворот от уровня MDD или границы области. Правила закрытия свечи относительно уровня. Механика преобладания сил покупателей/продавцов в точке касания.

02

---

## **Ложные паттерны и фильтрация «хвостов»**

Анализ теней: почему большой хвост против движения отменяет вход. Рекомендуемые таймфреймы (M30, H1) для корректного чтения сигналов.

03

---

## **Однобарный отбой и нюансы входа**

Случаи, когда сигнальная свеча не касается уровня. Логика «полнотелого» закрытия. Техника разделения ордера при значимых хвостах.

04

---

## **Паттерн Неопределенности - «Спасатель депозита»**

Формация из 2-4 свечей с длинными хвостами в обе стороны. Распознавание отсутствия перевеса сил и выход из сделки в «ноль».

05

---

## **Динамический расчет стоп-лосса по волатильности**

Альтернативный метод постановки стопа: замер ширины 95% области. Использование «половины расстояния области» для адаптивного риск-менеджмента.

06

---

## **Практика на графиках и логика «изломов»**

Разбор реальных ситуаций по Нефти и Золоту. Работа с ценой, не дошедшей до «излома». Правило фиксации профита по MDD следующего дня.

07

---

## **Продвинутые модели: Двойное поглощение и 3-барные формации**

Поглощение двух предыдущих тел свечей. Техника входа от «середины тела» поглощающего бара. Специфика работы с Pin-барами.

08

---

## **Психотрейдинг: Системность и борьба с «тильтом»**

Избавление от несистемных сделок и желания «отыграться». Дисциплина соблюдения правил стратегии во время серии стоп-лоссов.

# Методология работы с паттернами



## Две методики торговли

Программа предлагает два подхода к работе с опционными уровнями MDD: автономную торговлю по лимитным ордерам и ручной контроль входов по паттернам подтверждения.

Первый метод подходит для занятых трейдеров, которые не могут постоянно находиться у терминала. Второй обеспечивает более высокую точность входа за счет визуального подтверждения разворота.

## Логическое обоснование

Все паттерны рассматриваются через призму борьбы быков и медведей на критических уровнях. Влияние опционной дельты на выталкивание цены от границ областей создает предсказуемые точки разворота.

## Модуль 4: Практика паттернов и логика нового месяца

### Смена опционного контракта

Анализ экспирации предыдущего месяца и запуск нового опционного контракта. Совпадение опционных уровней с сеткой Фибоначчи. Логика движения валютных пар «лесенками».

### Захват ликвидности

Разбор ситуаций, когда магнитные уровни оказываются сильнее границ рынка. Признаки лимитного покупателя и техника входа дробным лотом.

### Паттерн «Табуретка»

Авторский паттерн с анализом объема: Сигнальная свеча → Доджи/Пинбар → Разворотный бар. Сравнение прогресса свечи с объемом на фьючерсах.

# Содержание Модуля 4

01

## Смена опционного месяца и магнитные цели

Анализ экспирации июля и запуск августа. Совпадение опционных уровней с сеткой Фибоначчи 23.6 и 161.8. Логика движения EURUSD «лесенками» (ступенями).

02

## Захват ликвидности и ловушки у границ рынка

Разбор ситуации, когда магнитные уровни оказываются сильнее границ рынка. Признаки лимитного покупателя: паттерн «Двойное поглощение» и техника входа дробным лотом.

03

## Качество паттернов на MDD и работа с «запиллом»

Определение количества отработок MDD. Различие между «чистым» паттерном (Голова-Плечи, Двойное дно) и «грязным» накоплением. Подтверждение Доджи и Пинбаров.

04

## Зеркальные уровни и подтверждение разворота

Трансформация поддержки в сопротивление. Использование «неопределенности» рынка для безопасного выхода из сделки или фиксации части прибыли.

05

## Паттерн «Табуретка» и объемный анализ

Авторский паттерн: Сигнальная свеча → Доджи/Пинбар → Разворотный бар. Сравнение прогресса свечи с объемом на фьючерсах. Интерпретация соотношения объема и результата.

06

## Обзор мажоров: GBP, AUD, CHF, JPY

Нестандартные открытия фунта. Золотые точки входа по Йене у границ областей. Фильтрация ранних входов по достижению 23.6 по Фибоначчи.

07

## Работа с товарами и фильтрация «шума»

Волатильность нефти и правило стоп-лосса 50% области.

# Пошаговая методика работы

## 1 Поиск паттерна

Нахождение формаций «Двойное поглощение» или «Табуретка» на уровне MDD. Дожидание касания ценой уровня MDD или границы области сигнальной свечой.

## 2 Анализ объема

Сравнение объема разворотной свечи с сигнальной: объем должен падать при сохранении или росте прогресса. Оценка размера хвоста относительно тела.

## 3 Выставление ордеров

50% позиции по рынку, 50% лимиткой на середину тела паттерна или уровень MDD. При значимом хвосте - выставление лимитки на уровень MDD.

## 4 Управление позицией

При появлении паттерна неопределенности в процессе сделки - закрытие в БУ или минимальный профит. Цель - X5 от стопа.

## 5 Фиксация прибыли

При достижении следующего торгового дня проверка реакции на новый MDD. Фиксация при появлении обратных паттернов.

# Результаты обучения и практическое применение модулей 3 и 4

## 8

### Паттернов разворота

Полный набор базовых и продвинутых свечных формаций для работы на опционных уровнях

## 2

### Метода торговли

Автономная работа по лимитным ордерам и ручной контроль входов по паттернам подтверждения

## 4

### Класса активов

Валютные пары, драгоценные металлы, энергоносители и криптовалюты с индивидуальной спецификой

## После Модуля 3

Участники научатся «слышать пульс рынка», понимая, когда крупный игрок действительно разворачивает цену, а когда происходит ложный вынос. Освоение паттерна неопределенности и динамических стоп-лоссов позволит существенно снизить просадки и повысить выживаемость торгового счета.

Третий модуль CME Mastery дает вам «глаза» для подтверждения входов, превращая сухие цифры уровней в живой процесс взаимодействия рыночных сил.

## После Модуля 4

Участники научатся «читать» свечи через объем, понимая, когда сопротивление продавцов сломлено. Освоят эффективную работу в начале нового опционного месяца и начнут фильтровать сделки по принципу «тяготения» к магнитным уровням, избегая опасных входов в середине диапазона.

Модуль 4 дает практический навык соединения геометрии Фибоначчи, опционных барьеров и физики рыночных объемов.

# Модуль 5: Анализ объемов и психотренинг

Пятый модуль основного блока курса интегрирует технический анализ внутрисвечных объемов с системной психологической подготовкой и строгими принципами риск-менеджмента. Участники освоят методику анализа футпринта для понимания внутренней структуры ценовых движений, техники ментальной настройки на торговую сессию и профессиональные подходы к распределению капитала при работе с множественными инструментами.

Программа объединяет три критически важных направления: технологию чтения объемов внутри свечи, психологические техники подготовки сознания и подсознания к торговле, а также математические модели управления рисками в портфельной торговле. Особое внимание уделяется взаимосвязи технических сигналов и психологического состояния трейдера.

01

---

## Футпринт-анализ

Чтение внутрисвечных объемов

02

---

## Психоподготовка

Медитация и визуализация

03

---

## Риск-менеджмент

Портфельное управление

## Структура модуля 5: Основные блоки

- **Актуальный разбор рынка**  
Анализ текущих входов по основным валютным парам, отработка паттернов на живых примерах, работа с магнитными уровнями и зонами перестроения MDD
- **Распределение объема внутри свечи**  
Изучение логики вертикальных объемов и футпринта, понятие формы елочки, взаимодействие Buy Stop ордеров с лимитными стенами
- **Психология трейдинга**  
Ловушки разума и концепция монофреймов, влияние эмоциональной нагрузки слов на торговые решения
- **Техника профессиональной медитации**  
Методика настройки на торговую сессию, визуализация паттернов и концентрация внимания перед началом работы

# Психологическая подготовка трейдера

## Монофреймы и эмоциональный фон

В программе подробно рассматривается феномен монофреймов - слов и числовых значений, несущих избыточную эмоциональную нагрузку для конкретного человека. Понятия «деньги», «кредит», «зарплата», «долг» часто вызывают неосознанные гормональные реакции, влияющие на качество торговых решений.

Участники учатся идентифицировать собственные монофреймы и применять техники нейтрализации их влияния. Специальный психологический опросник помогает выявить скрытые триггеры, мешающие объективной оценке рыночной ситуации.

## Техника медитации для трейдеров

Разработанная специально для трейдинга методика медитации кардинально отличается от классических подходов. Вместо расслабления и «очищения разума» применяется активная визуализация торговых паттернов, их нюансов, вариантов развития и точек входа.

5-15 минутная предсессионная практика включает детальное мысленное проигрывание всех возможных сценариев: появление хвостов, ложные пробой, поведение цены на ключевых уровнях. Это создает готовность подсознания к быстрому распознаванию сигналов в реальном времени.

### Подсознательная защита

Феномен неоткрытого ордера: как мозг предотвращает убыточные входы через технические сбои

### Эмоциональная стабильность

Работа с гормональным фоном и реакциями на рыночные движения

### Концентрация внимания

Визуализация паттернов как инструмент подготовки к торговой сессии

# Управление рисками в портфеле

## Проблема корреляции и фильтрация инструментов

При работе с 9-10 инструментами одновременно критически важно понимать проблему корреляции долларовых пар. Программа обучает методике предотвращения серии одновременных стоп-лоссов, которые могут возникнуть при системном движении доллара против всех позиций.

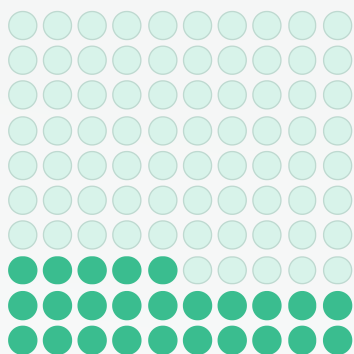
Участники осваивают систему фильтрации инструментов по качеству сигнала и степени достижения магнитных зон. Выбор 3-4 наиболее чистых сигналов из портфеля позволяет избежать избыточной концентрации риска и повысить вероятность успешных сделок.

## Стратегии мани-менеджмента

### Три подхода к объему

Программа представляет три базовых подхода к определению объема входа: фиксированный лот, процент от депозита или денежный риск на сделку. Каждый метод имеет свои преимущества в зависимости от стадии развития счета.

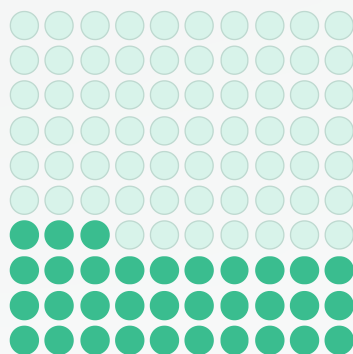
Уникальная техника деления прибыли на три части позволяет агрессивно, но безопасно разгонять депозит: одна треть идет на увеличение базового размера позиции, вторая - в резерв для покрытия просадок, третья выводится или реинвестируется в другие активы.



**25%**

#### Риск в Хедж-фонде

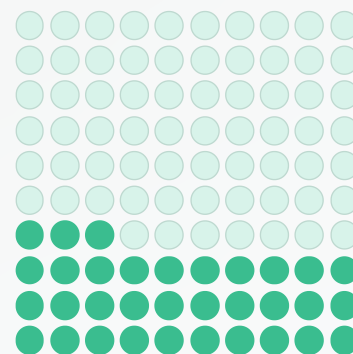
Опыт консервативного управления институциональным капиталом



**33%**

#### Базовый лот

Часть прибыли на увеличение стандартного размера позиции



**33%**

#### Резервный фонд

Накопление подушки безопасности для просадок

# Модуль 6: Границы рынка и опционные накопления

Шестой модуль посвящен фундаментальной концепции границ рынка - максимальных скоплений опционных объемов Call и Put, определяющих зоны наибольшего интереса крупных участников. Программа обучает различению стандартных и аномальных открытий торговых периодов, интерпретации динамики перестроения уровней внутри опционного месяца как индикатора смены рыночных ожиданий.

Участники осваивают методику использования границ рынка в качестве стратегического фильтра для среднесрочных позиций. В сочетании с паттернами технического анализа этот инструмент предоставляет мощную систему определения зон потенциального разворота тренда и точек высокой вероятности отбоя цены.

## Call граница (синяя линия)

Максимальное скопление объемов опционов Call, представляющее верхнюю границу рыночных ожиданий

## Put граница (оранжевая линия)

Максимальное скопление объемов опционов Put, определяющее нижнюю границу зоны интереса

# Структура модуля 6: Ключевые темы

## ● **Определение границ рынка**

Визуализация Call и Put линий, процесс формирования максимальных скоплений объемов, концепция центра тяжести и аналогия со сжатием звезды, годовой цикл накопления

## ● **Логика использования и хеджирование**

Отслеживание ожиданий крупных игроков, хеджирование реальных поставок товаров, лимитные ордера хеджеров как фактор торможения цены на границах

## ● **Перестроение уровней внутри месяца**

Отличие смены контракта от динамического перестроения, правило 100 пунктов для значимых движений, резкий сдвиг границ как сигнал к тренду

## ● **Стандартные и нестандартные открытия**

Анализ открытия цены относительно границ, понятие потолка и поддержки, ограничение потенциала движения в ближайшие дни

## ● **Синтез с магнитными уровнями**

Использование границ как подтверждения для MDD и магнитов H4, зеркальные свойства границ при пробое, техника работы по паттернам на отбой

## ● **Практический разбор инструментов**

Анализ конструкций Straddle/Strangle, работа с золотом, нефтью, S&P 500, поиск точек входа на экстремальных границах и психологических барьерах

# Практическое применение границ рынка



## Инструменты модуля 6

Программа включает специализированный набор инструментов для работы с границами рынка: индикатор толстых жирных линий Call/Put для визуализации границ, интеграция с уровнями MDD для тактического уточнения точек входа, магнитные уровни H1 и H4 для определения среднесрочных целей движения.

Участники получают методичку по чтению перестроений границ рынка в формате PDF, содержащую детальные примеры интерпретации различных сценариев движения границ и их влияния на ценовую динамику.

## Типичные ошибки при работе

- Игнорирование мелких перестроений границ менее 50-100 пунктов
- Торговля против резкого перестроения без подтверждающих паттернов
- Путаница между сменой опционного контракта и реальным движением денег
- Ожидание моментального разворота при касании границы

**Результат обучения:** Участники научатся использовать границы рынка как стратегический навигатор в зонах высокой ликвидности, понимать области защиты позиций крупными игроками и избегать ложных входов на экстремумах движения.



# Модуль 7: Уровни крупных игроков и логика хеджирования

Седьмой модуль посвящен глубокому пониманию природы институциональных уровней на рынке. Вы научитесь различать типы участников по объемным характеристикам их позиций и освоите методику работы с границами тренда через призму крупного капитала.

Ключевой акцент делается на отличиях между спекулятивными и хеджирующими уровнями, что позволяет трейдеру правильно интерпретировать рыночную реакцию на различные типы опционных барьеров. Понимание механики набора позиций институциональными игроками открывает новые возможности для точных входов.

## Идентификация

Распознавание уровней крупных игроков на графике

## Классификация

Отличия спредовых уровней от хеджирующих

# Структура модуля 7: Основные блоки

01

## Анализ рыночных ситуаций

Разбор открытых позиций по основным валютным парам с применением системы уровней МДД и методики ранних входов на практических примерах

02

## Идентификация уровней Large Players

Изучение отображения институциональных уровней: даты экспирации, символы недельных опционов, маркеры аномального объема

03

## Дифференциация типов уровней

Понимание различий в объемах и целях участников, причины задержки реакции цены на крупные объемы

04

## Паттерны отработки

Методика подтверждения через двухдневную систему наблюдения и формирования разворотных паттернов

05

## Логика хеджирования

Глубинное понимание корпоративного страхования валютных рисков на примере реального бизнеса

06

## Спредовые стратегии

Работа с лимитными ордерами, взаимодействие опционных и магнитных уровней системы

07

## Ранние входы

Техника опережающих позиций при движении цены за пределы уровня H4 со сниженным риском

### Классификация опционных уровней

Детальное разделение уровней крупных игроков (Large) и спредовых уровней (Spread) с пониманием их функциональных различий

### Механика товарного хеджирования

Влияние корпоративного страхования рисков на движение фьючерсных контрактов и формирование уровней

### Тактика двухдневного входа

Система подтверждения уровня через наблюдение реакции цены и формирование разворотных паттернов

# Методика работы с крупными игроками



## Обнаружение уровня

Поиск на графике уровней с аномальным объемом, идентифицированных как позиции крупных институциональных участников



## Первое касание

Ожидание достижения ценой идентифицированного уровня и фиксация характера реакции рынка на взаимодействие



## Формирование паттерна

На второй торговый день поиск разворотного паттерна в зоне опционного уровня для подтверждения присутствия игрока



## Сверка направления

Соотнесение планируемого направления входа с общим приоритетом рыночного движения



## Адаптация подхода

При работе со спредовыми уровнями возможность установки лимитного ордера с учетом текущего рыночного контекста



## Управление риском

Снижение риска в 2-3 раза при ранних входах за границу H4 до момента перестроения индикаторов



**Важно:** Правило двух дней является ключевым элементом методики. Первый день служит для подтверждения активности институционального игрока, второй — для формирования технического паттерна входа.

# Типичные ошибки и их предотвращение

## Преждевременный вход

Открытие позиции на первый прокол уровня крупного игрока без ожидания подтверждения через двухдневную систему наблюдения

## Смешение типов хеджирования

Неразличение товарного хеджирования, где отсутствуют лимитные ордера, и спекулятивных позиций с четкими границами

## Игнорирование экспираций

Торговля на устаревших уровнях без учета дат истечения опционных контрактов, что снижает релевантность сигналов

## Избыточный риск

Использование стандартного размера позиции в ранних входах вместо адаптированного уменьшенного лота

Осознание и избегание этих распространенных ошибок значительно повышает эффективность применения методики работы с уровнями крупных институциональных участников. Систематический подход к анализу и строгое следование алгоритму входа минимизируют убыточные сделки и повышают общую прибыльность торговой системы.

# Модуль 8: Спредовые уровни и институциональный анализ

Восьмой модуль программы концентрируется на глубоком понимании спредовых уровней сырьевых рынков и освоении анализа позиционирования институциональных участников через отчеты COT (Commitment of Traders). Интеграция этих знаний с ранее изученными методиками создает целостную систему профессионального трейдинга.

Модуль раскрывает отличия опционных уровней хеджеров от спредовых конструкций на товарных рынках. Особое внимание уделяется объемным характеристикам - понимание того, почему на спредовых уровнях с меньшими объемами можно искать паттерны уже при первом касании, открывает новые тактические возможности.

## Содержание модуля 8



### Дифференциация уровней

Разбор отличий опционных уровней хеджеров от спредовых конструкций на товарных рынках. Анализ объемных характеристик и формирования плотности уровней



### Механика Sell-опционов

Понимание поведения цены у проданных опционов, использование их как целей Take Profit. Тактика лимитных ордеров относительно уровней Sell



### Профессиональный риск-менеджмент

Правило ограничения потерь, адаптация системы под волатильность. Математика прибыльности при различных соотношениях риск/прибыль



### Институциональный анализ COT

Расшифровка действий создателей и последователей тренда. Еженедельное обновление и определение приоритетов торговли

Интеграция всех элементов модуля создает комплексную систему принятия торговых решений, основанную на понимании действий крупнейших участников рынка. Анализ COT-отчетов дополняет техническую картину фундаментальным пониманием позиционирования институционального капитала.

# Результаты продвинутых модулей программы и дальнейшее развитие

По завершении продвинутого этапа программы вы получаете целостную систему торговли, основанную на понимании механики институциональных участников рынка. Освоенные методики охватывают полный цикл: от базовых опционных границ до сложных спредовых конструкций и фундаментального анализа через COT-отчеты.

Ваша торговая система становится самоадаптирующейся под текущую рыночную волатильность, а понимание того, кто является создателем тренда, а кто - его топливом, дает значительное преимущество в принятии торговых решений.

Программа формирует профессиональное «рентгеновское зрение» рынка - способность видеть зоны вероятных остановок и разворотов благодаря пониманию интересов глобального капитала.

Понимание уровней крупных игроков и институционального позиционирования трансформирует подход к рынку, позволяя торговать не против течения, а вместе с глобальным капиталом.

# Модуль 9: Крупные игроки на рынке

## Уровни Big

Сверхкрупные вливания через внебиржевые сделки Dark Pool, не отображаемые в стандартном стакане

## Уровни Futures

Технические уровни как часть дельта-нейтральных хеджирующих конструкций

## COT-отчеты

Интеграция данных о позициях институциональных участников в ежедневную аналитику

## Содержание модуля 9

### Природа институциональных объемов

- Механика сделок Dark Pool
- Регистрация крупных вливаний
- Составные опционные конструкции
- Дельта-нейтральные стратегии

### Практический анализ

- Идентификация экстремумов дня
- Совмещение уровней Big и MDD
- Определение намерений крупного игрока
- Интеграция данных COT-отчетов

## Ключевые понятия модуля

### Big Levels

Сверхкрупные вливания через внебиржевые сделки между институциональными участниками с задержкой регистрации до 20 минут

### Futures Levels

Технические уровни, формируемые как часть сложных хеджирующих конструкций типа "бабочка" и "кондор"

### Mirror Levels

Зеркалирование опционных уровней при пробое: Put-опционы трансформируются в сопротивление

### COT Arrows

Визуальная индикация позиций групп участников: коммерсанты, хедж-фонды, розничные трейдеры

# Алгоритм анализа крупного объема

01

## Фиксация уровня

Определение появления уровня Big или Futures относительно экстремумов торгового дня

02

## Паттерн подтверждения

Ожидание закрытия сигнальной и разворотной свечи для формирования торгового паттерна

03

## Тип реакции

Определение характера движения: отбой от уровня или проторговка с размытием границ

04

## Сверка с COT

Анализ направления позиций крупных игроков по отчетам биржи

05

## Точка входа

Поиск оптимального момента при совпадении с зонами MDD и магнитными уровнями

## Инструментарий модуля 9



### Индикаторы Big и Futures

Мониторинг внебиржевых данных Dark Pool в режиме реального времени



### Шаблоны COT

Визуализация позиций институциональных участников с обновленной системой стрелок



### Магнитные уровни (опционально)

Определение целевых зон движения цены на таймфреймах H1 и H4



### Уровни MDD

Расчет математически обоснованных границ дневного движения

# Модуль 10: CME Mastery

Финальный модуль курса посвящен глубокому изучению механики превращения опционных уровней в поддержку и сопротивление. Вы освоите самостоятельный расчет уровней МДД через биржевые данные CME и QuikStrike, научитесь учитывать Forward Point для точного переноса уровней на Forex и получите полную независимость от сторонних поставщиков сигналов.

Модуль объединяет теоретическую базу о роли маркетмейкеров с практическими навыками работы с биржевой инфраструктурой. Особое внимание уделяется математике опционных премий, синхронизации фьючерсных и спотовых котировок, а также построению комплексной торговой системы на основе институциональных данных.

## Содержание модуля 10

### Механика опционных уровней

Роль маркетмейкера и формирование зеркальных уровней поддержки/сопротивления

### Анализ настроений COT

Взаимодействие институционалов, хеджеров и розничной толпы на бирже

### Инфраструктура расчетов

Регистрация на CME Group и работа с сервисами QuikStrike и Bantix

### Алгоритм расчета МДД

Пошаговая методология самостоятельного вычисления дневных уровней

### Синхронизация Futures-Forex

Расчет Forward Point и перенос уровней между рынками

# Итоги программы

10

## Учебных модулей

Полное погружение в механику опционного и фьючерсного рынка с практическими примерами

15+

## Практических техник

Конкретные алгоритмы работы с уровнями, фильтрации сигналов и постановки ордеров

7

## Ключевых инструментов

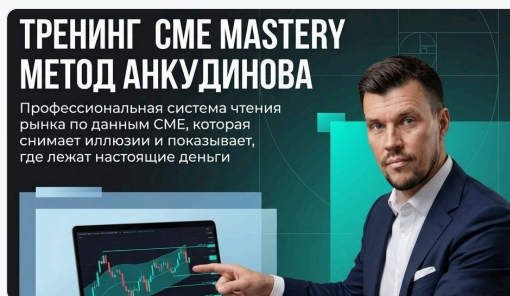
От индикатора OI до стакана цен - полный набор профессионального трейдера

## Что вы получите после курса

После прохождения программы CME Mastery вы обретете профессиональное понимание механики биржевых процессов и сможете применять полученные навыки на любом рынке - Форекс, Товарно-Сырьевой, Криптовалютный. Вы научитесь отделять рыночный шум от зон реального движения крупного капитала и сможете строить высоковероятностные торговые стратегии на основе данных о позициях институциональных игроков.

Вы овладеете техникой «снайперского» входа по изломам графика, что позволит минимизировать стоп-лоссы и значительно улучшить соотношение прибыли к риску в ваших сделках. Вы получите четкий алгоритм отбора уровней и фильтрации сигналов, основанный на реальной работе опционного рынка.

**Профессиональная торговля начинается с понимания того, как работает рынок изнутри.**  
CME Mastery дает вам этот ключ к успеху.



 hi.switchy.io



### CME Mastery: Метод Анкудинова

Профессиональная система чтения рынка по данным CME, которая снимает иллюзии и показывает, где лежат настоящие...