

Стратегия торговли

Pump and Dump

На основе
эмпирических данных
одного трейдерского
комьюнити



Стратегия Pump and Dump

Стратегия торговли Pump and Dump заключается в поиске акций, цены которых были разогнаны с помощью новостей, слухов, сильно преувеличенных или ложных заявлений и других манипуляций. Часто такие высокие цены (доходность за день может составлять 50%-800%) являются результатом PR компаний, они не обоснованы и не имеют под собой фундамента в виде финансовых результатов фирм.

Отслеживая новостной фон вокруг компании, динамику внутридневной цены и объема, можно купить акции, когда накачка только начинается (памп), или зашортить акции после сильной накачки, когда рост составляет, например 100% и более, и становится очевидно, что такой рост ничем не обоснован (дамп), и в этом случае мы рассчитываем взять на падении 50-70% от этого роста).

Часто под стратегией торговли дамп имеют в виду именно открытие шорт позиций, когда в сильно выросшей акции после резких вертикальных движений возникает дисбаланс. Организаторы накачки распродают акции толпе на росте, и когда интерес у толпы покупать по высоким ценам пропадает, цены начинают сами обваливаться и возвращаются к точке, от которой начался рост и даже падают ниже.



Search ticker, company or profile



Home News Screener Maps Groups Portfolio Insider Futures Forex Crypto Backtests Elite

Wed OCT 13 2021 6:43 PM ET ? Help Login Register

My Presets	Order:	Change	Desc	Signal:	None (all stocks)	Tickers:	>	Filters ▾
Filters: 0								
Exchange	Any	Index	Any	Sector	Any	Industry	Any	Country
Market Cap.	Any	Dividend Yield	Any	Float Short	Any	Analyst Recom.	Any	Option/Short
Earnings Date	Any	Average Volume	Any	Relative Volume	Any	Current Volume	Any	Price
Target Price	Any	IPO Date	Any	Shares Outstanding	Any	Float	Any	
Overview Valuation Financial Ownership Performance Technical Custom Charts Tickers Basic TA News Snapshot Stats								

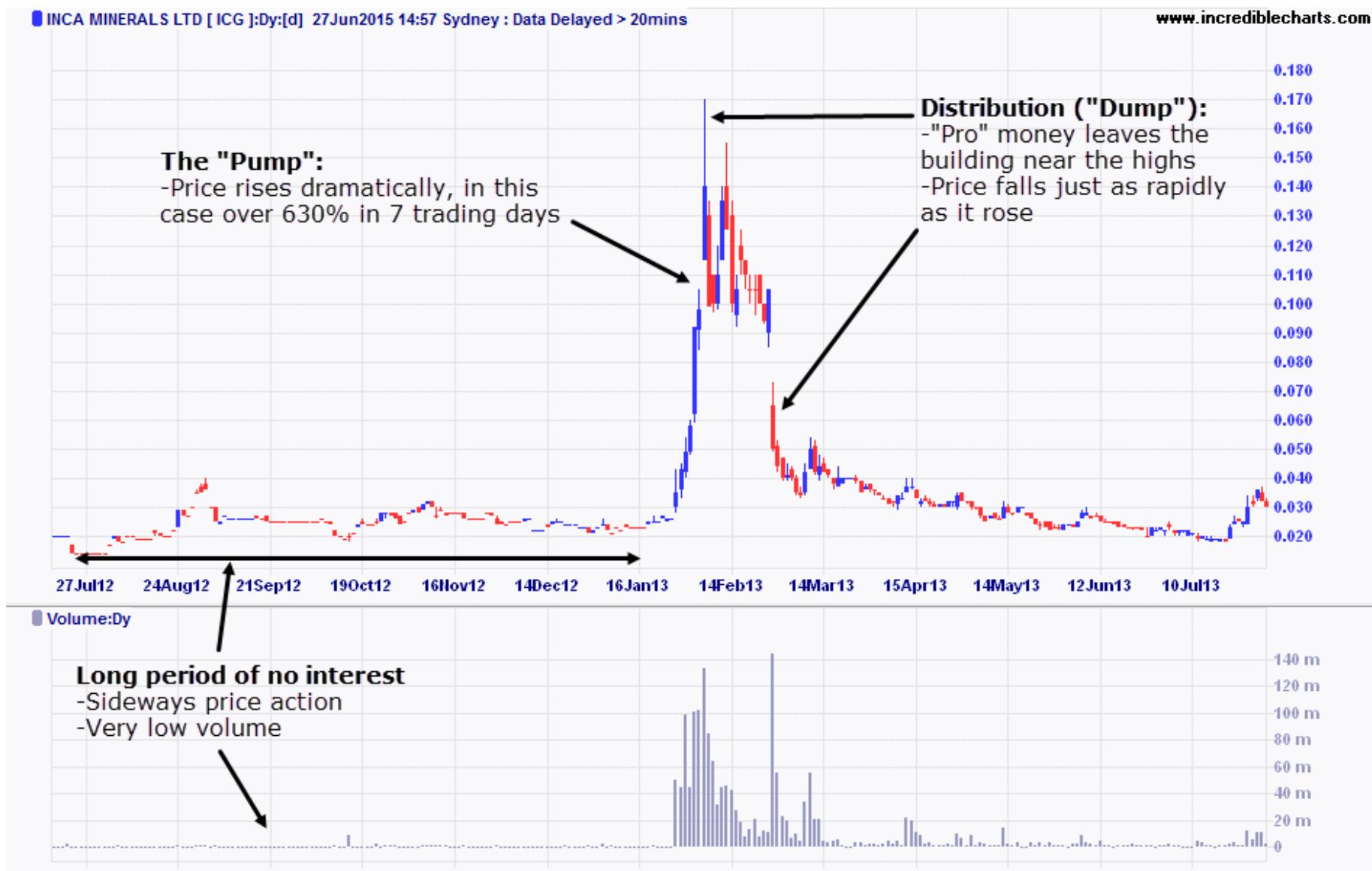
Доходность
за день

Total: 8352 #1									
No.	Ticker	Company	Sector	Industry	Country	Market Cap	P/E	Price	Change
1	JSPR	Jasper Therapeutics, Inc.	Healthcare	Biotechnology	USA	564.53M	-	14.79	105.13%
2	WTRH	Waitr Holdings Inc.	Technology	Software - Application	USA	155.12M	-	1.27	58.45%
3	SOTK	Sono-Tek Corporation	Technology	Scientific & Technical Instruments	USA	94.62M	46.03	6.49	44.22%
4	CRXT	Clarus Therapeutics Holdings, Inc.	Healthcare	Drug Manufacturers - General	USA	109.82M	11.50	5.29	29.02%
5	SESN	Sesen Bio, Inc.	Healthcare	Biotechnology	USA	207.43M	-	1.05	26.90%
6	ORPH	Orphazyme A/S	Healthcare	Biotechnology	Denmark	179.41M	-	4.91	23.37%
7	NEW	Puxin Limited	Consumer Defensive	Education & Training Services	China	49.13M	7.44	0.56	23.02%
8	RDW	Redwire Corporation	Industrials	Aerospace & Defense	USA	745.87M	-	12.13	22.03%
9	HUDI	Huadi International Group Co., Ltd.	Basic Materials	Steel	China	57.26M	18.04	5.99	19.56%
10	ICD	Independence Contract Drilling, Inc.	Energy	Oil & Gas Drilling	USA	30.49M	-	4.27	18.94%
11	ALLO	Allogene Therapeutics, Inc.	Healthcare	Biotechnology	USA	4.21B	-	15.94	18.69%
12	SGH	SMART Global Holdings, Inc.	Technology	Semiconductors	USA	1.27B	160.12	51.72	18.06%
13	RLAY	Relay Therapeutics, Inc.	Healthcare	Biotechnology	USA	2.80B	-	32.76	17.97%
14	LTBR	Lightbridge Corporation	Industrials	Electrical Equipment & Parts	USA	41.86M	-	6.42	16.94%
15	ANY	Sphere 3D Corp.	Technology	Software - Application	Canada	476.01M	-	8.13	15.65%
16	NCNA	NuCana plc	Healthcare	Biotechnology	United Kingdom	141.03M	-	2.81	15.64%
17	OTIC	Otonomy, Inc.	Healthcare	Biotechnology	USA	117.26M	-	2.01	15.52%
18	SLI	Standard Lithium Ltd.	Basic Materials	Other Industrial Metals & Mining	Canada	1.75B	-	9.70	15.34%
19	CETX	Centrex, Inc.	Industrials	Conglomerates	USA	23.28M	-	1.03	15.29%
20	STAB	Statera Biopharma, Inc.	Healthcare	Biotechnology	USA	78.65M	-	3.11	15.19%

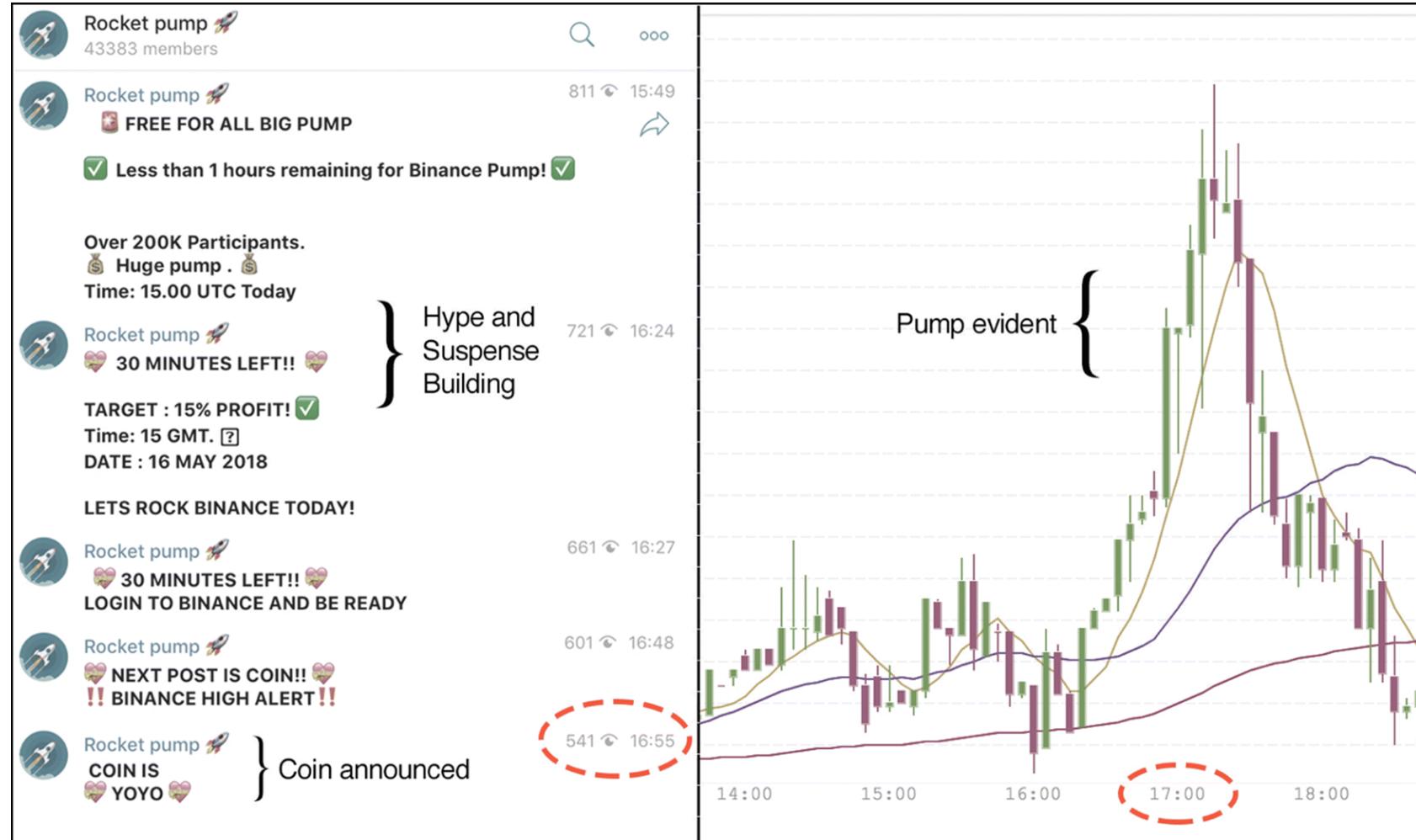
export

Обычно **пампы и дампы** наблюдаются по акциям компаний **малой капитализации** чаще с **индустрии биотехнологий и IT**, с **ценой акции не больше \$50**. Намного реже встречаются такие наблюдения: по mid cap компаниям, акциям с более высокой ценой и компаниям из других секторов.

Pump and Dump, пример по акции компании INCA Minerals:



Pump and Dump, пример по криптовалюте YOYO:



Чат telegram-группы «Rocket dump» по пампам и дампам криптовалют с более чем 40 000 участников.

Внутридневная цена криптовалюты YOYO с криптобиржи Binance, показывающая эффект накачки.

Pump

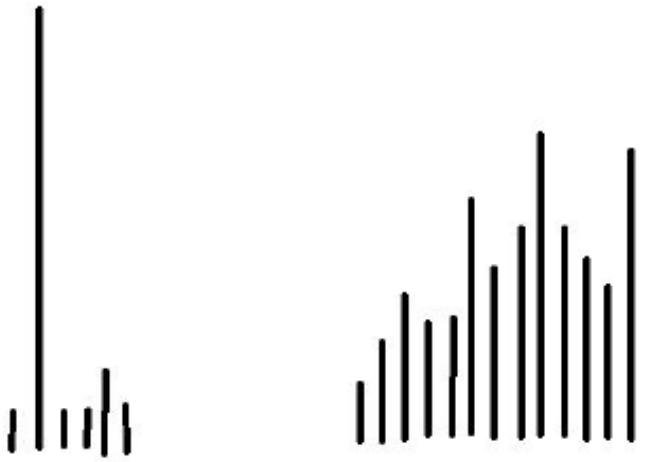
Признаки:

1. Цена плавно растет (тренд имеет малую волатильность, тиковые и минутные свечи с относительно низким high-low диапазоном, цена находится близко к SMA).
2. Средние объемы намного больше, чем в предыдущих сессиях и плавно растут вместе с ценой.
3. Из больших таймфреймов есть задел для роста (глобальные уровни сопротивления находятся далеко).
4. По компании объявляются положительные новости:
 - Одобрение FDA (Администрация по делам продовольствия и медикаментов) для сектора биотехнологий.
 - Специальные дивиденды.
 - Квартальный отчет.
 - Особые поставки.
 - Получение патента.
 - Крупный спонсор.

Инфо поводы:

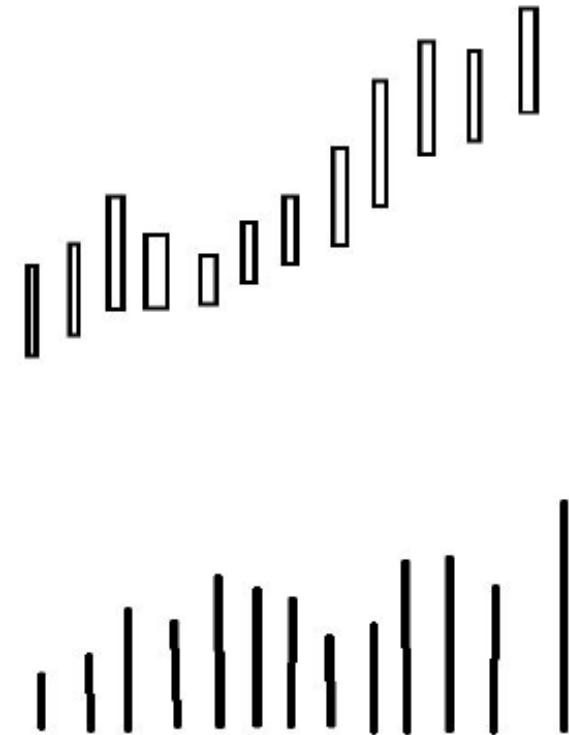
- Новый продукт, технология
- Расширение сферы влияния
- Достижение результатов
- Финансовый отчет
- Контракты

Pump



Большой и единичный объем – признак слабого интереса.

Большой, распределенный по времени объем – признак интереса к акции (Pump)



Плавный рост цены и поддерживаемые объемы говорят об интересе к акции.
Плавный рост - признак инвестора.

Торговые сессии

Подразумевается взаимодействовать только с акциями, листингующимися на биржах США. Пампы и дампы могут наблюдаться в течение всего торгового дня. Рассмотрим примеры пампов и дампов, наблюдавшихся в разных торговых сессиях. В течение дня: начало – 04:00, конец – 20:00.

Например:

NYSE Arca Equities

Pre-Opening Session: 2:30 a.m.

- Orders can be entered and will be queued until the Early Open Auction at 4:00 a.m. ET*

Early Trading Session: 4:00 a.m. to 9:30 a.m. ET

- 3:59 a.m. to 4:00 a.m. ET - Early Open Auction Imbalance Freeze Period
- 4:00 a.m. ET - Early Open Auction
- 9:29:55 a.m. to 9:30 a.m. ET - Core Open Auction Imbalance Freeze Period

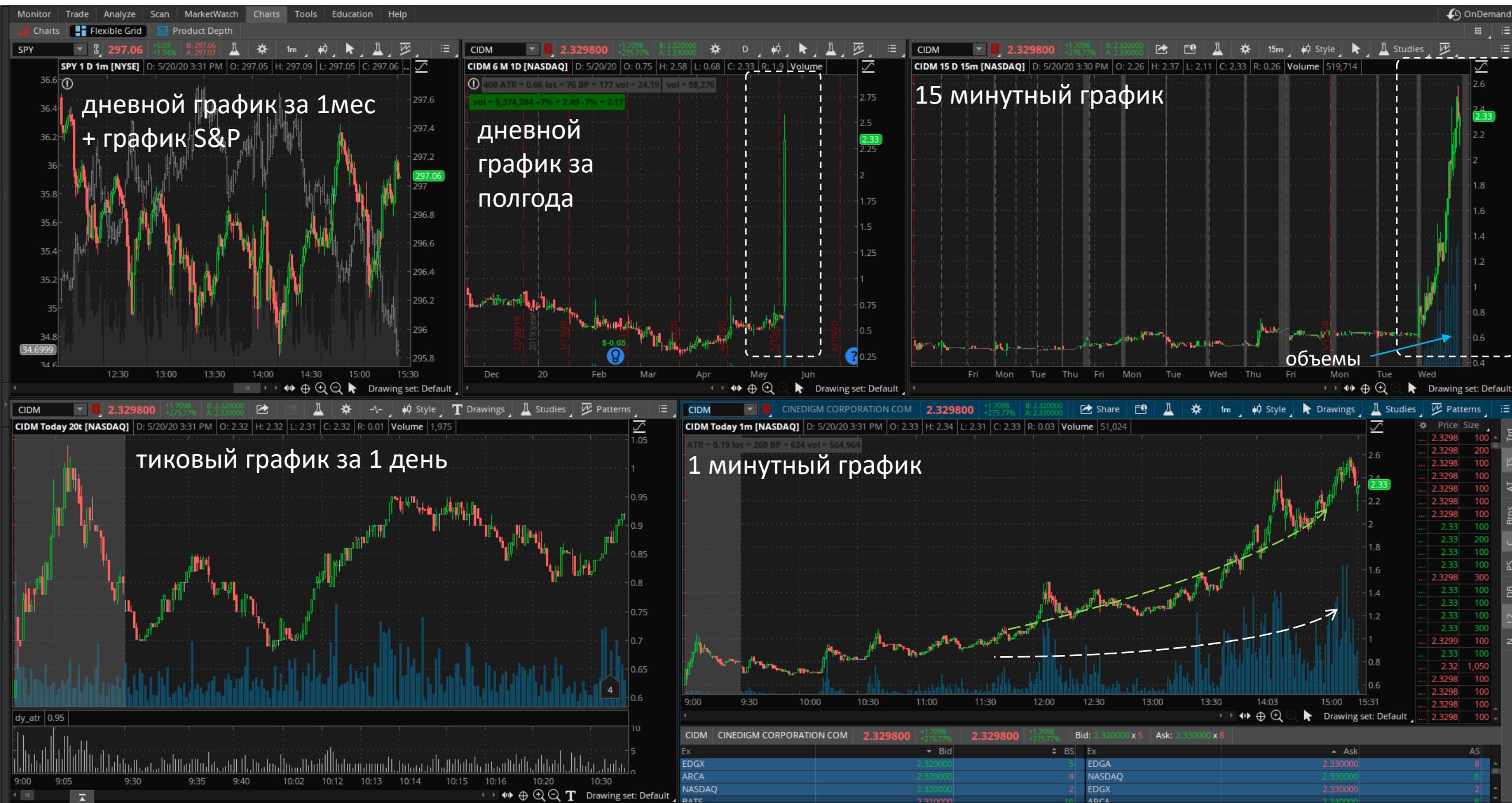
Core Trading Session: 9:30 a.m. to 4:00 p.m. ET (основная сессия)

- 9:30 a.m. ET - Core Open Auction
- 3:59 p.m. to 4:00 p.m. ET - Closing Auction Imbalance Freeze Period
- 4:00 p.m. ET - Closing Auction

Late Trading Session: 4:00 p.m. to 8:00 p.m. ET

Ритм в основную сессию, примеры

20.05.2020. Тикер: CIDM. Рост за день : 276%.



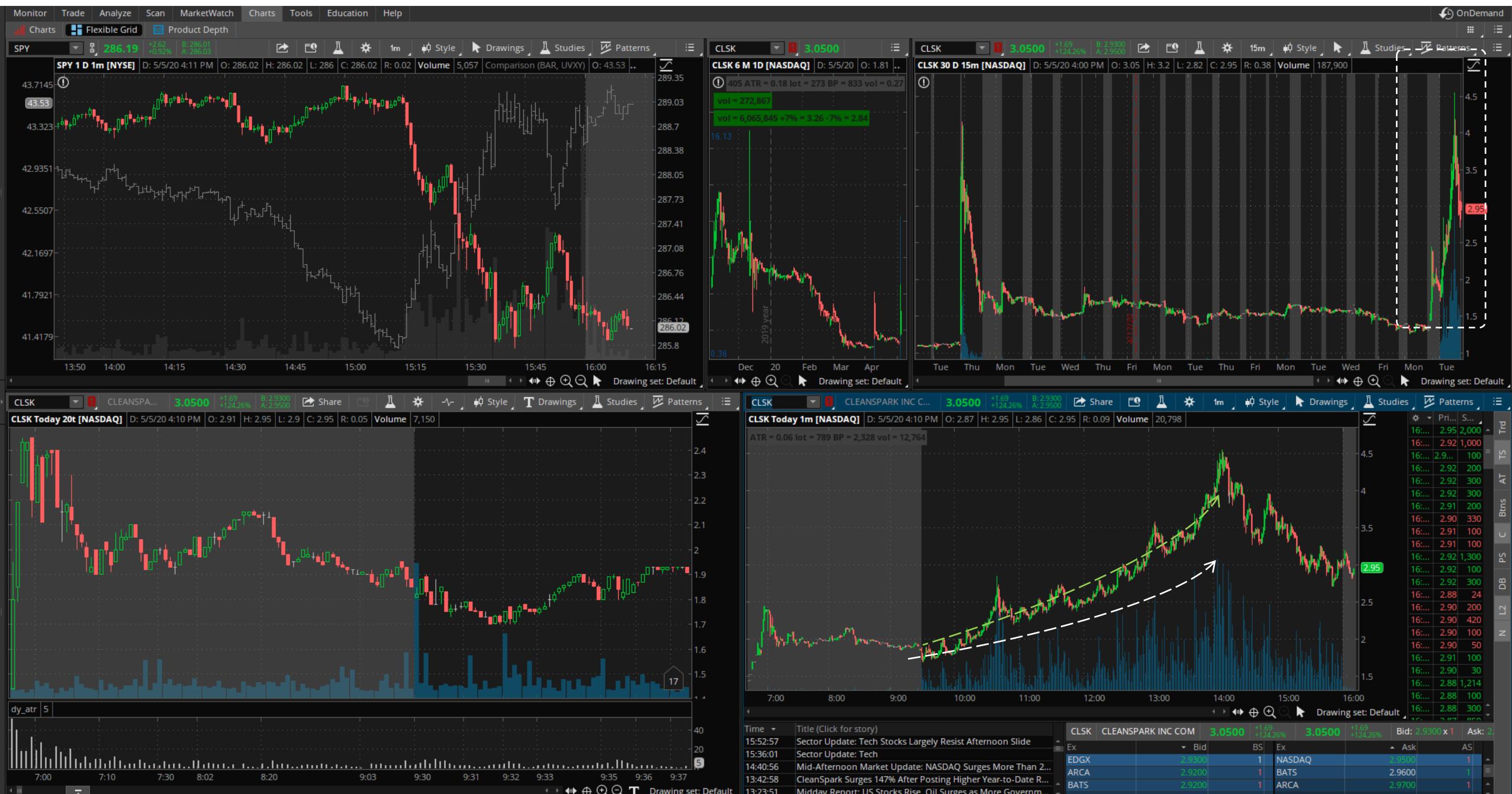
15.07.2020. Тикер: AXIM. Рост за день : 205%.



07.07.2020. Тикер: MOGU. Рост за день : 105%.

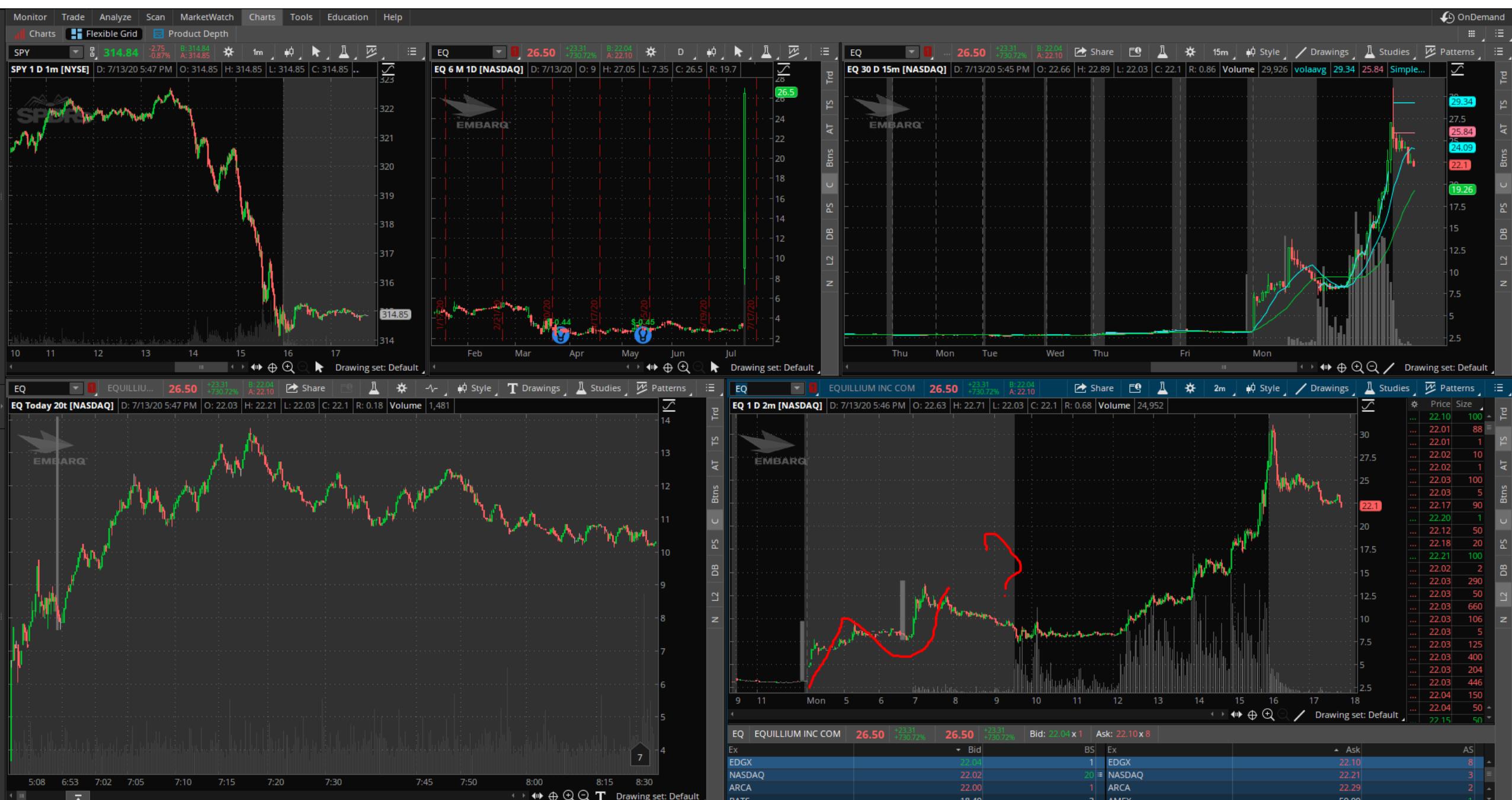


05.05.2020. Тикер: CLSK. Рост за день : 124%.

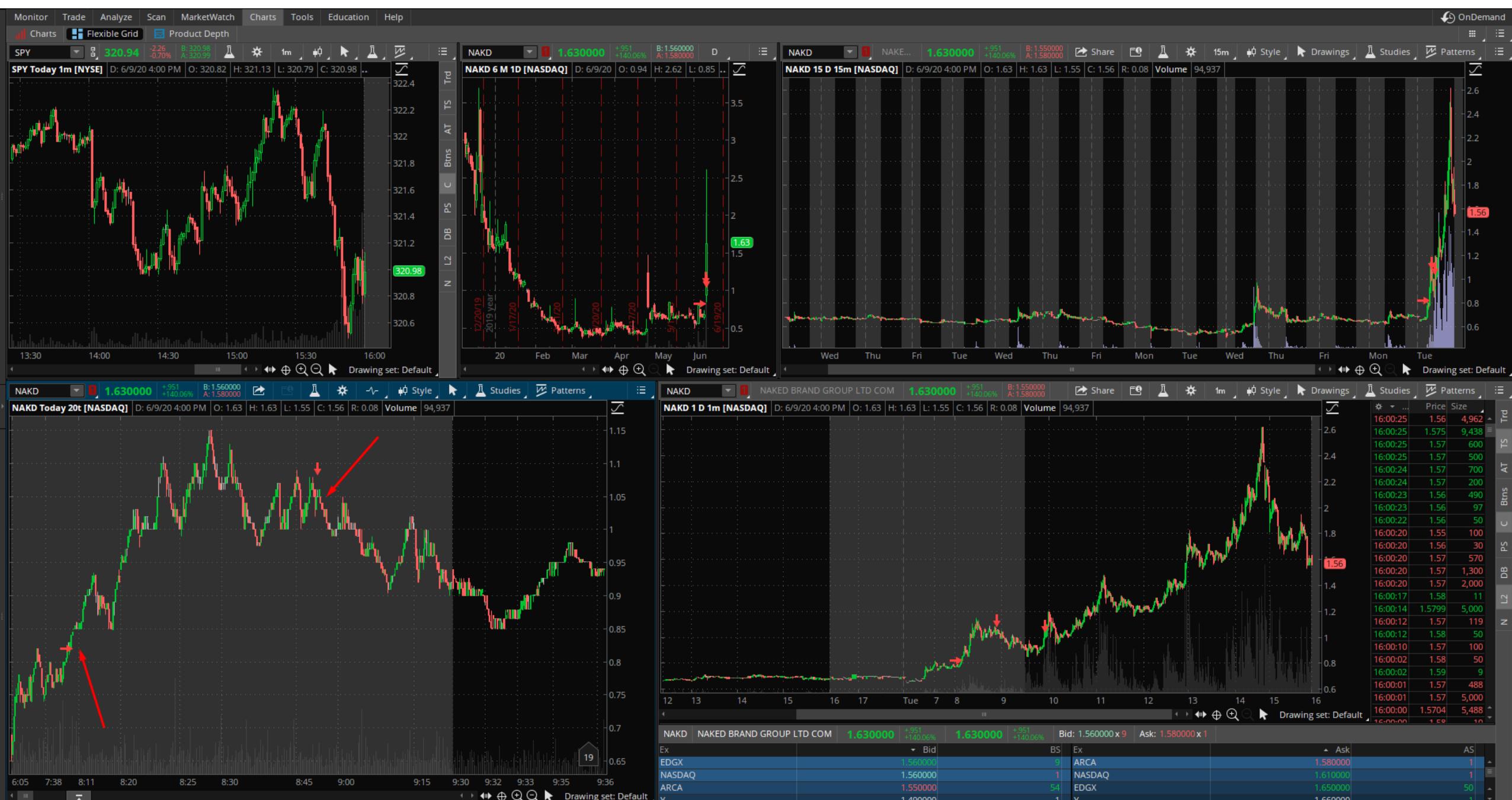


Ритм на весь день (премаркет, основная, постмаркет), примеры

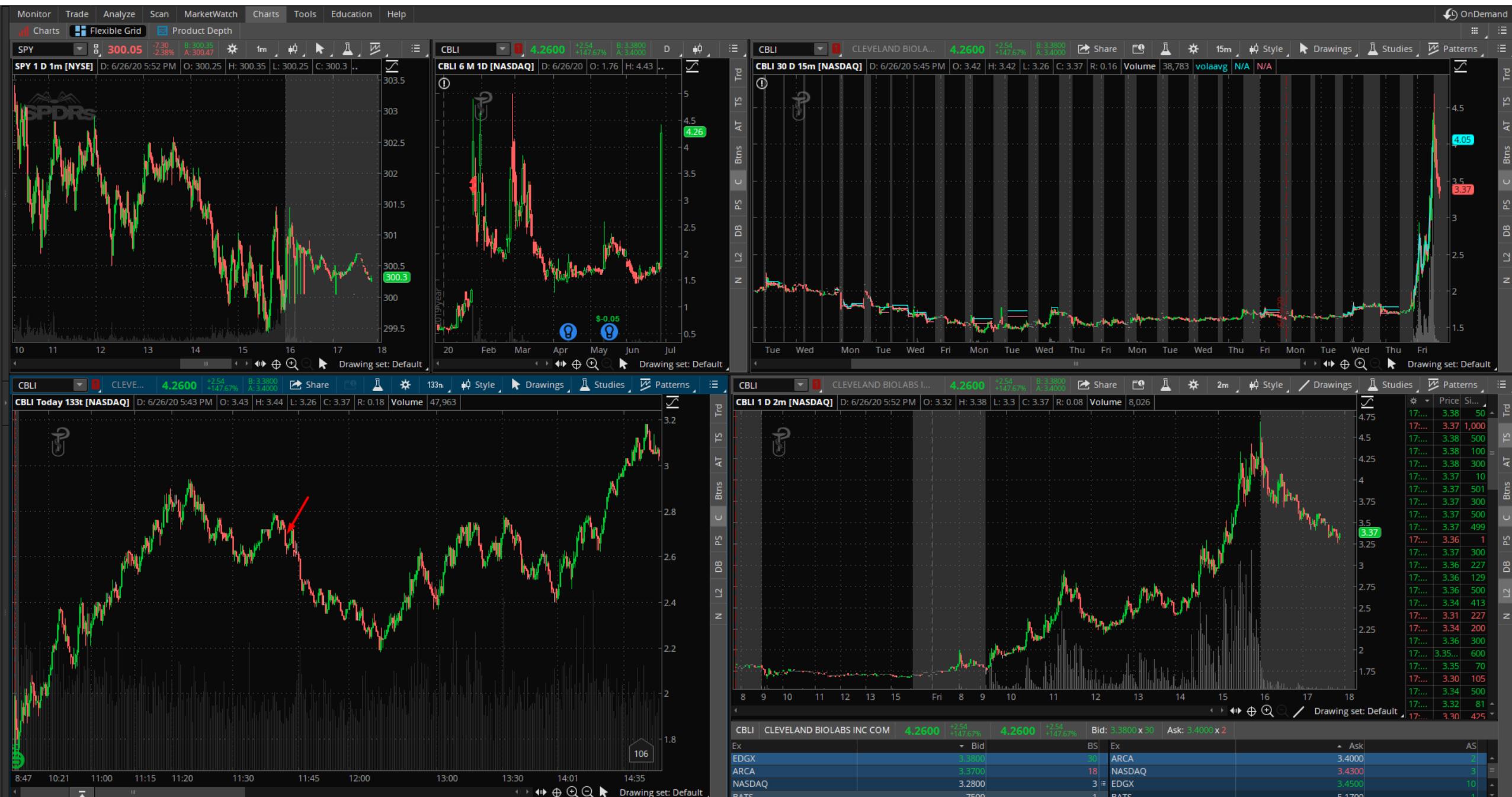
13.07.2020. Тикер: EQ. Рост за день : 731%.



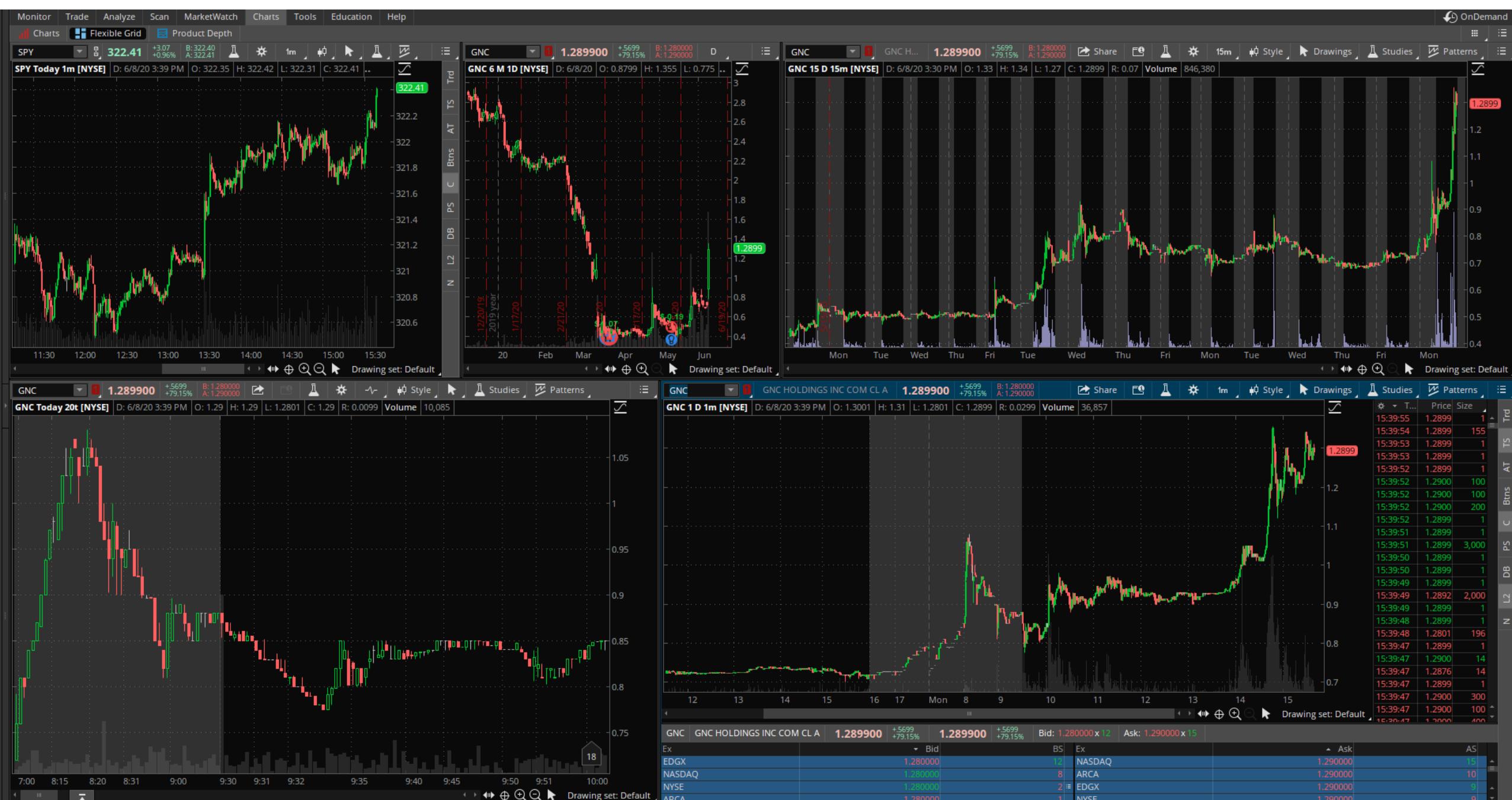
09.06.2020. Тикер: NAKD. Рост за день : 140%.



26.06.2020. Тикер: CBLI. Рост за день : 148%.



08.06.2020. Тикер: GNC. Рост за день : 79%.



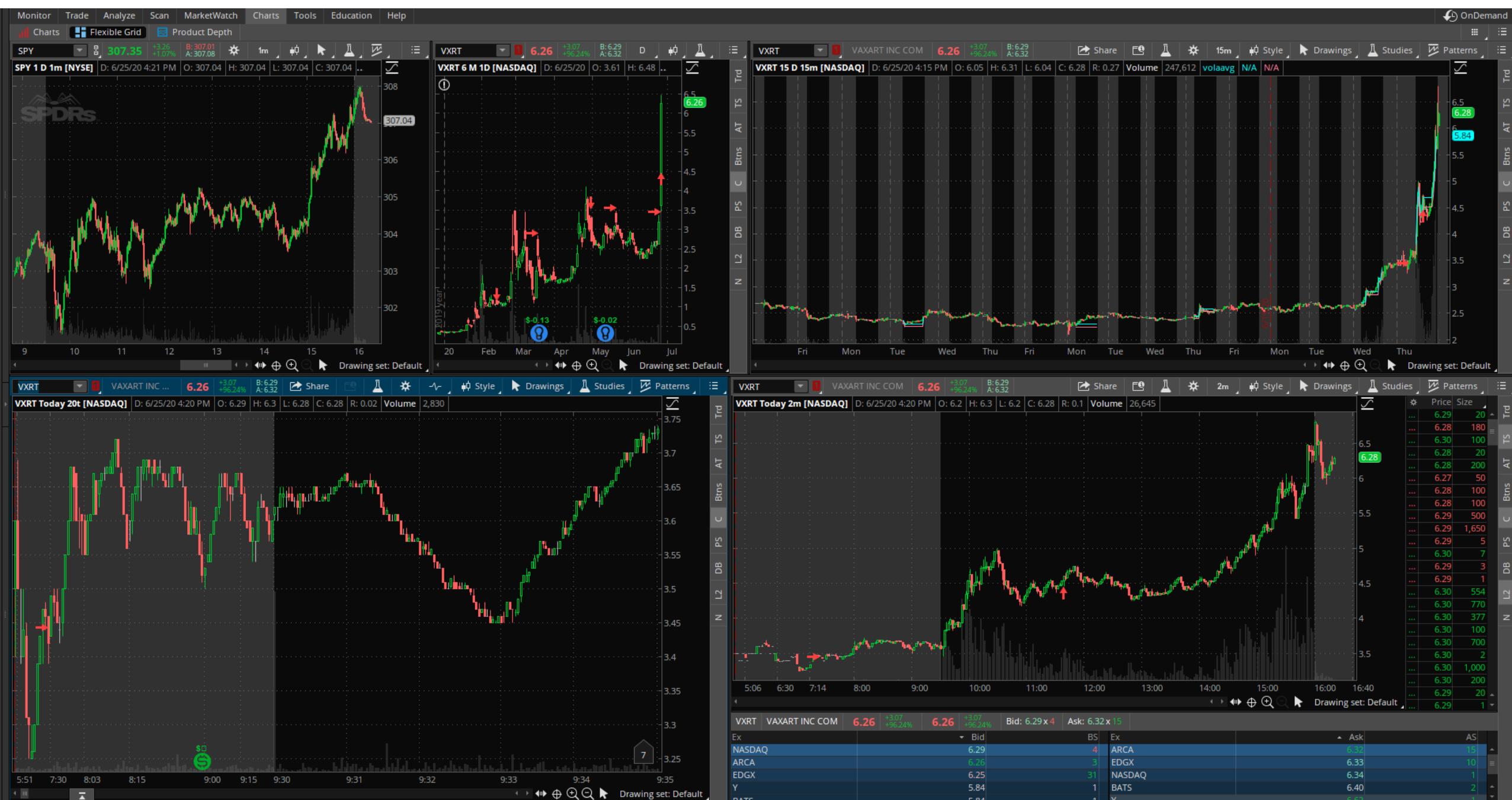
Ритм в на несколько дней, примеры

06.07.2020. Тикер: AYRO. Рост за последний день: 64%.

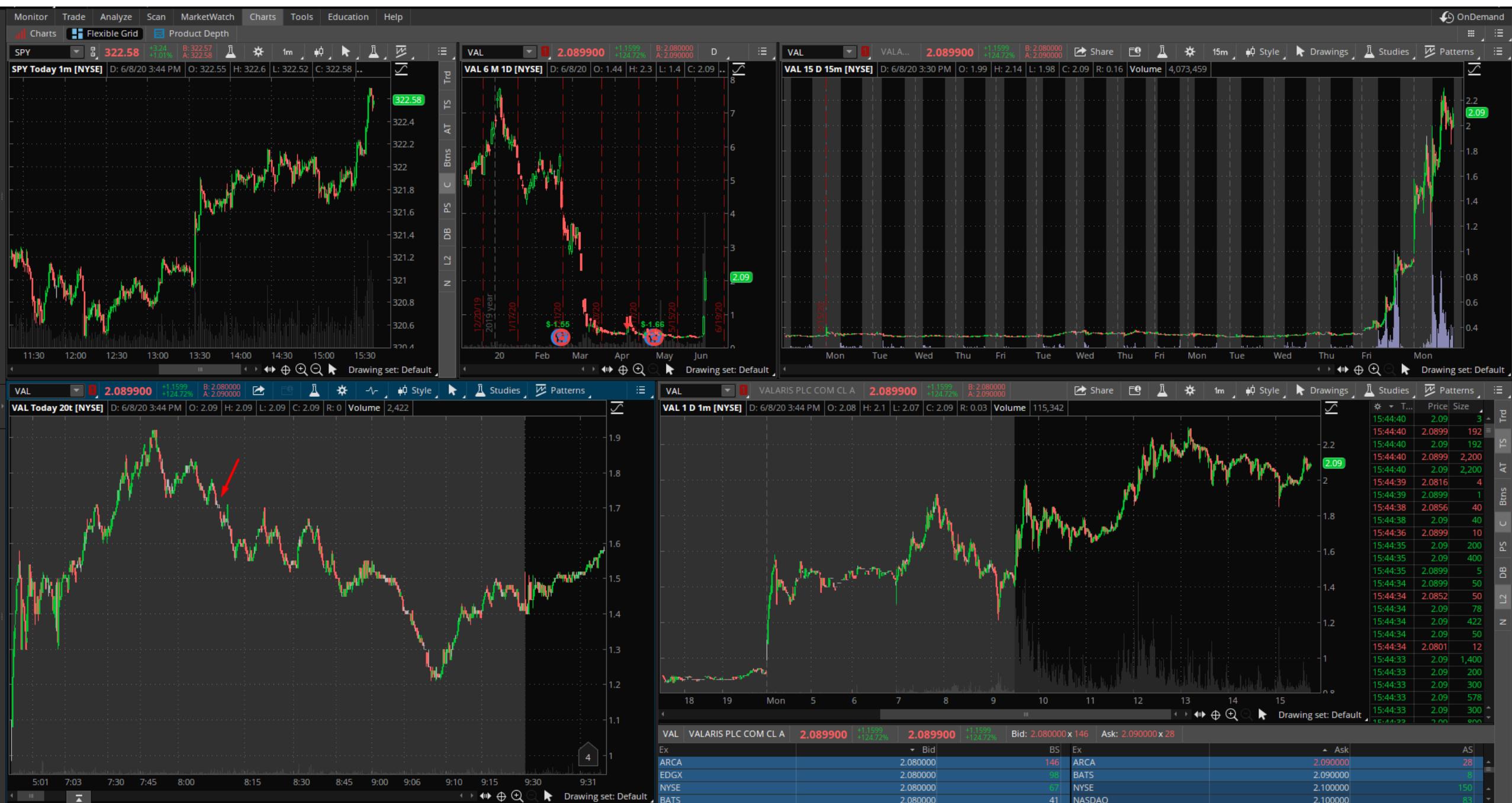
The figure displays a financial analysis interface with several windows:

- Top Bar:** Includes tabs for Monitor, Trade, Analyze, Scan, MarketWatch, Charts, Tools, Education, Help, and OnDemand.
- Left Panel:** Shows a chart for SPY 1D 1m [NYSE] with a price of 317.05, a green candlestick pattern, and a red annotation "SPDRs".
- Middle Left Chart:** AYRO 6 M 1D [NASDAQ] showing a price of 5.35, a green candlestick pattern, and a red annotation "5.35".
- Middle Right Chart:** AYRO 30 D 30m [NASDAQ] showing a price of 5.35, a green candlestick pattern, and a red annotation "5.2".
- Bottom Left Chart:** AYRO Today 133t [NASDAQ] showing a price of 5.35, a green candlestick pattern, and a red annotation "5.2".
- Bottom Right Chart:** AYRO 1 D 2m [NASDAQ] showing a price of 5.35, a green candlestick pattern, and a red annotation "5.2".
- Bottom Right Table:** A trade history table for AYRO INC COM, showing bid and ask prices, and exchange information like EDGX, ARCA, NASDAQ, and BATS.

25.06.2020. Тикер: VXRT. Рост за последний день : 96%.



08.06.2020. Тикер: VAL. Рост за последний день : 125%.



08.06.2020. Тикер: BORR. Рост за последний день : 129%.



Dump

1. Цена имеет взрывной рост и большое отклонение от SMA (достаточно лишь несколько свечей, огромная волатильность).
2. После резкого роста и возникновения локального максимума объемы начинают падать.
3. Из больших таймфреймов есть задел для падения (глобальные уровни поддержки находятся далеко внизу).
4. По компании объявляются обычные новости.

Dump на премаркете, примеры

01.06.2020. Тикер: DGLY. Доходность от шорта за день (от вероятной точки входа до текущей цены) : ~51%.



01.06.2020. Тикер: HEXO. Доходность за день : ~22%.



01.07.2020. Тикер: NMTR. Доходность за день : ~53%.



05.06.2020. Тикер: TTPH. Доходность за день : ~40%.



05.10.2020. Тикер: IMGN. Доходность за день : ~25%.



Dump в основную сессию, примеры

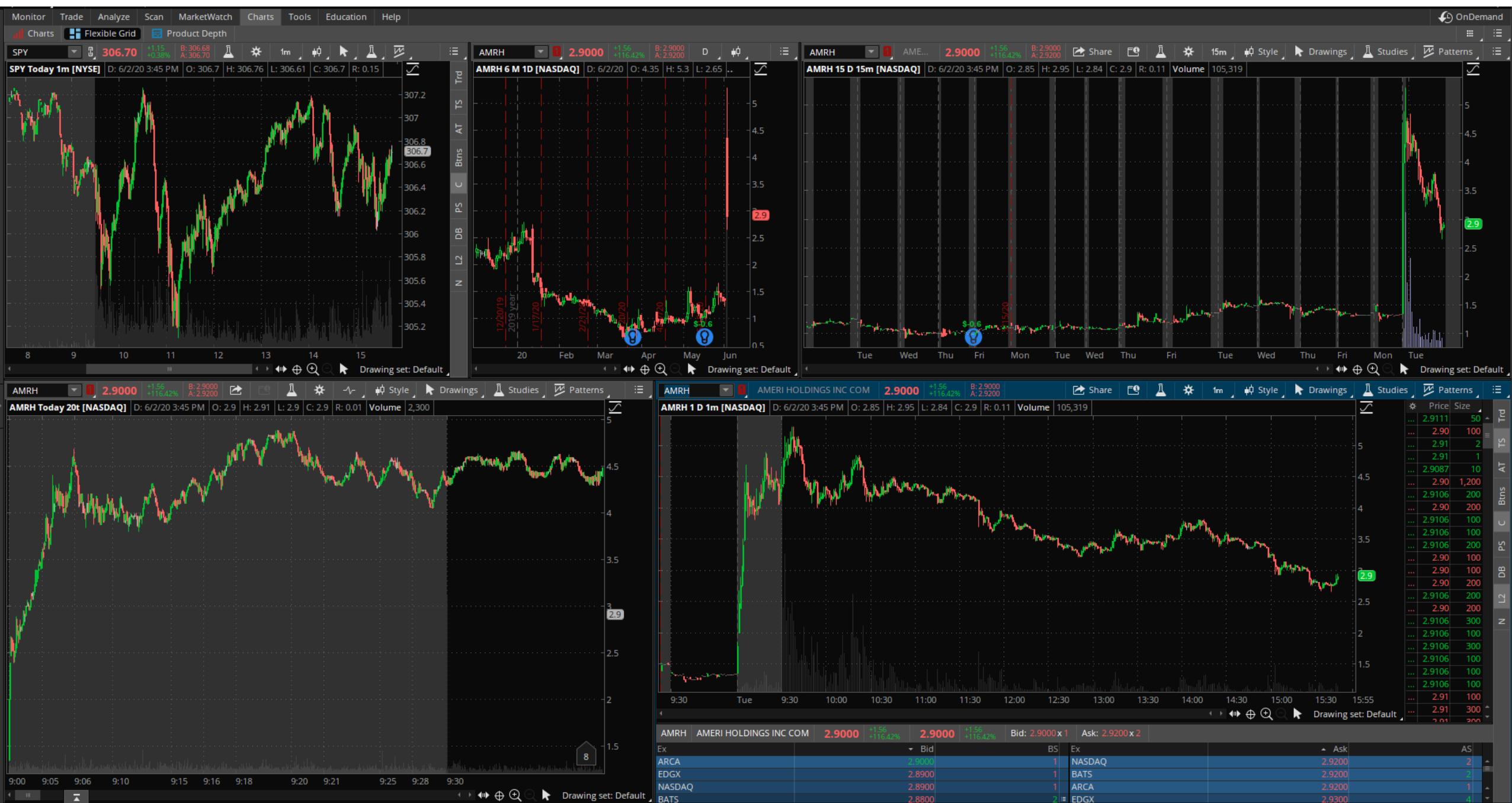
01.07.2020. Тикер: QLGN. Доходность за день : ~33%.

The figure displays a financial trading interface with six main windows:

- Top Left:** SPY 1 D 1m [NYSE] chart showing price action from July 1, 2020, to July 16, 2020.
- Second Column:** QLGN 6 M 1D [NASDAQ] chart showing price action from February to July 16, 2020.
- Third Column:** QLGN 30 D 15m [NASDAQ] chart showing price action from June 19, 2020, to July 16, 2020.
- Bottom Left:** QLGN Today 133t [NASDAQ] chart showing price action from 8:05 AM to 11:00 AM on July 1, 2020.
- Fourth Column:** QLGN 1 D 2m [NASDAQ] chart showing price action from July 13, 2020, to July 16, 2020.
- Bottom Right:** A table showing the trade history for QLGN (Qualigen Therapeutics Inc) from July 1, 2020, to July 16, 2020, including columns for Bid, Ask, BS, and AS.

The interface includes various toolbars at the top and bottom, and a legend for drawing sets in the center. The overall theme is dark with light-colored charts and text.

02.06.2020. Тикер: AMRH. Доходность за день : ~42%.



02.07.2020. Тикер: FRAN. Доходность за день : ~37%.



04.06.2020. Тикер: CIDM. Доходность за день : ~36%.



15.06.2020. Тикер: NETE. Доходность за день : ~41%.

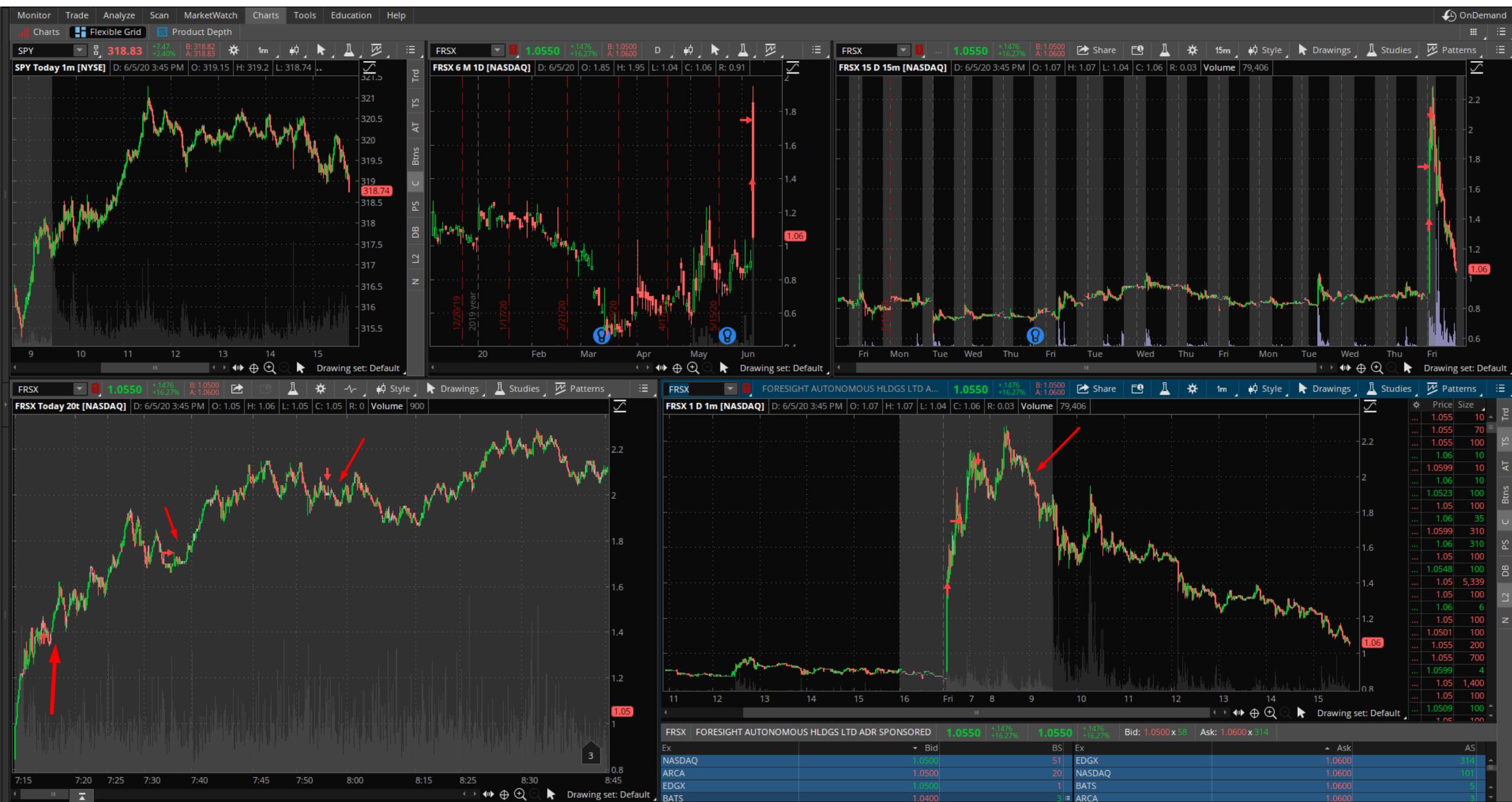


15.07.2020. Тикер: MOGO. Доходность за день : ~46%.

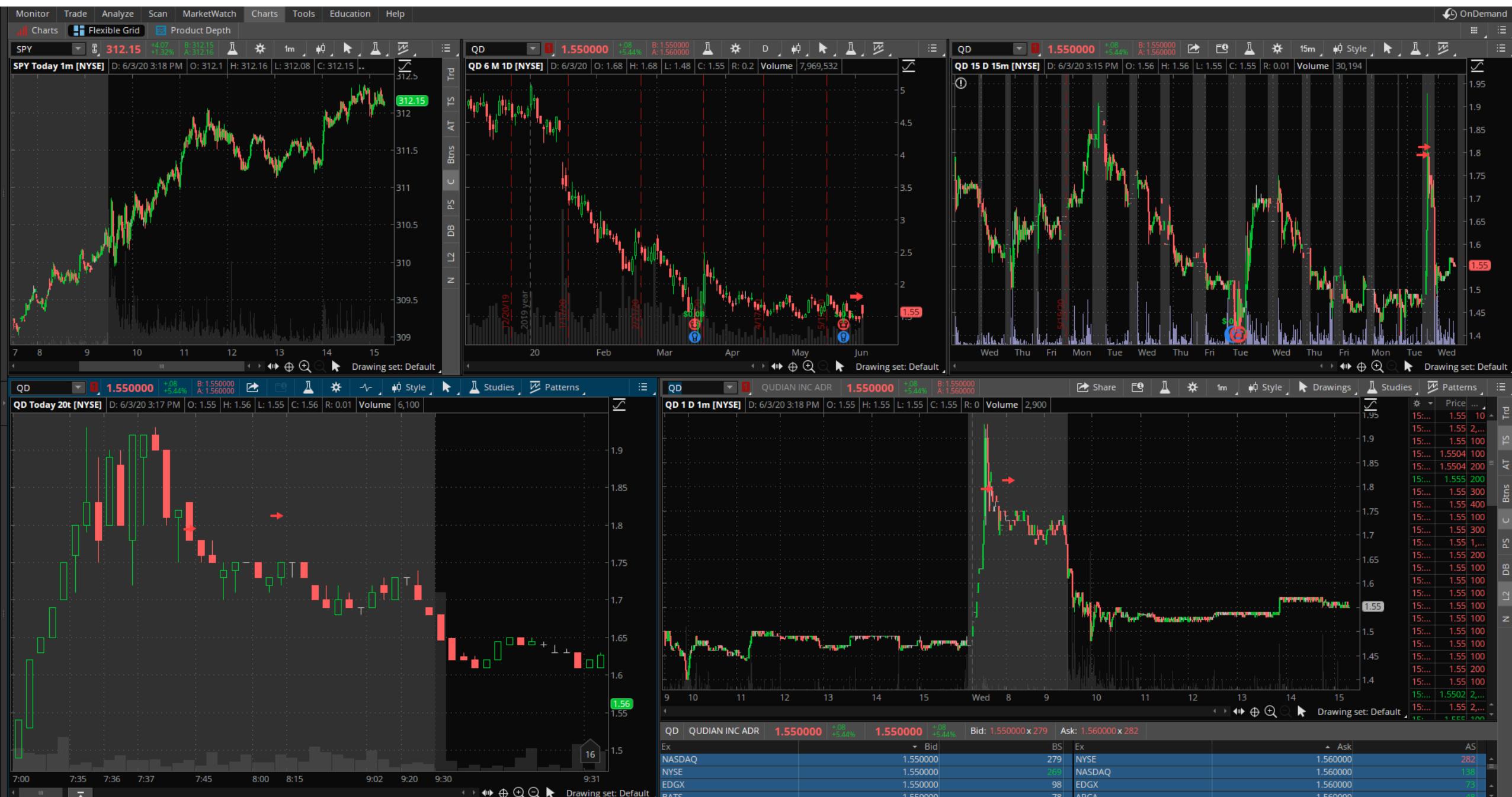


Dump на премаркете и основную сессию, примеры

05.06.2020. Тикер: FRSX. Доходность за день : ~45%.



03.06.2020. Тикер: QD. Доходность за день : ~17%



08.06.2020. Тикер: ENOB. Доходность за день : ~60%.

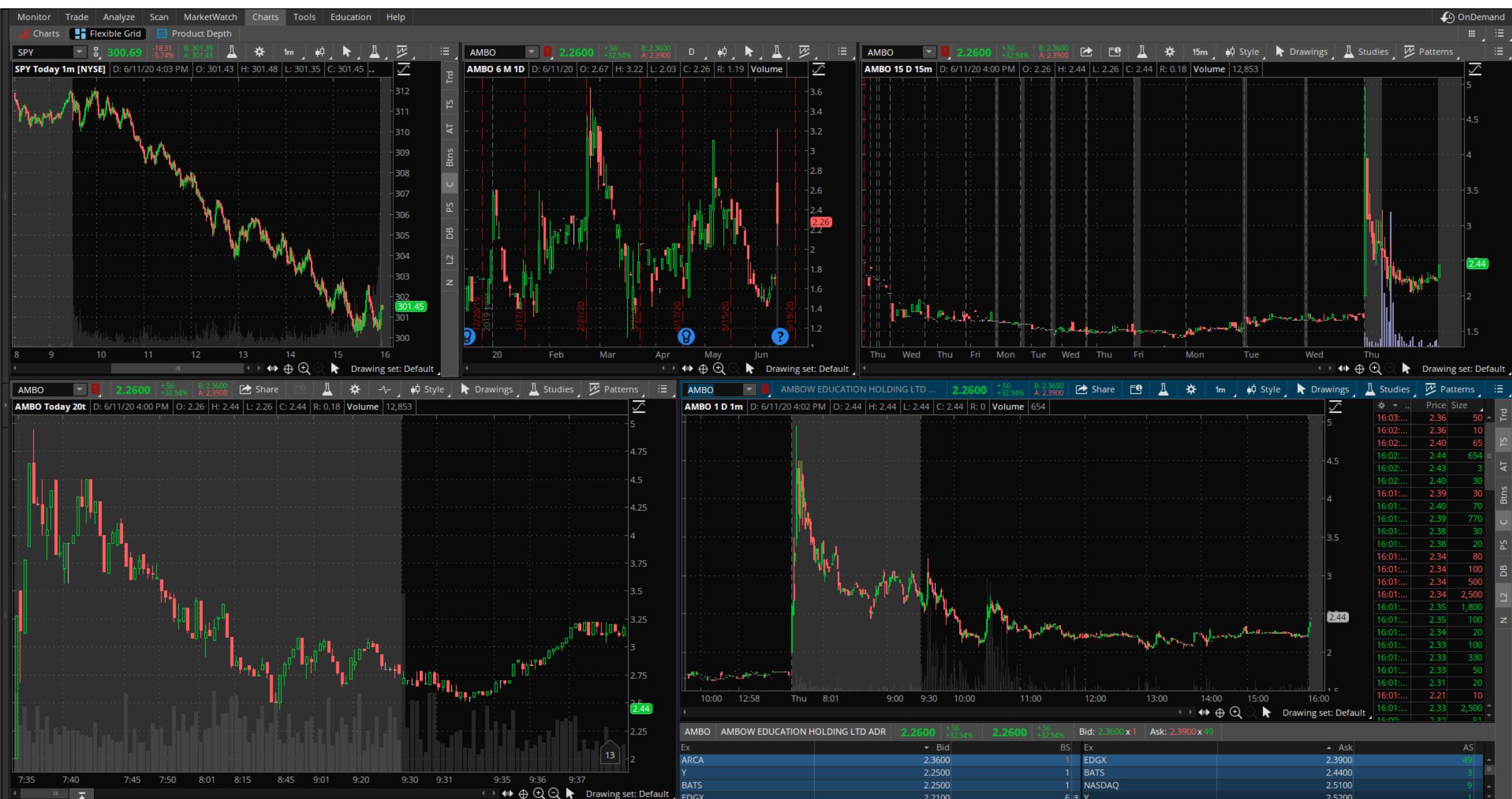


09.06.2020. Тикер: OPGN. Доходность за день : ~24%

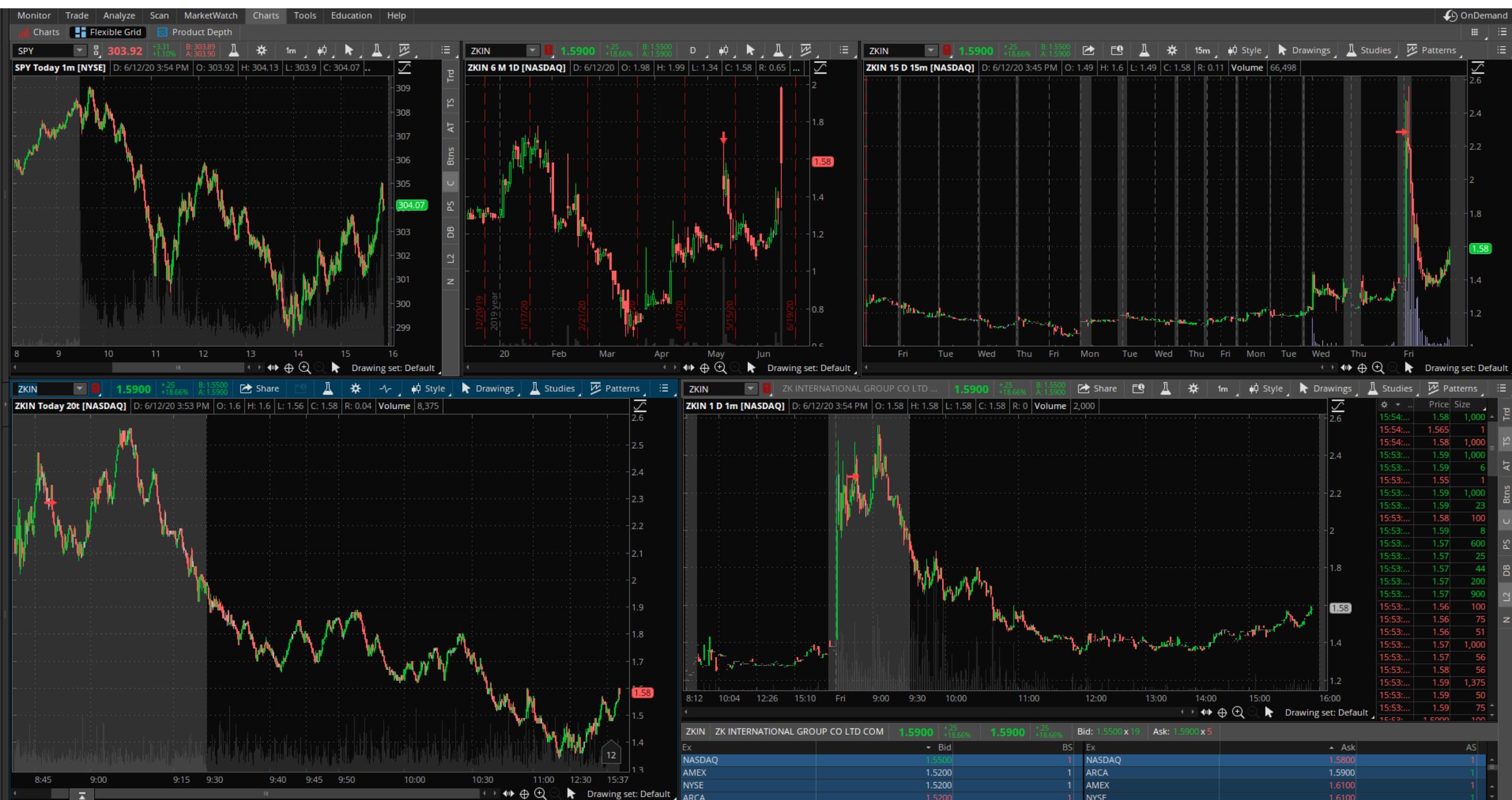
The figure displays a financial trading interface with five main windows:

- Top Left Chart:** SPY Today 1m [NYSE] from 13:30 to 16:00. Price starts at 320.94, dips to 320.93, and then recovers to 320.95.
- Middle Left Chart:** OPGN 6 M 1D [NASDAQ] from January to June. Price starts at 2.200, dips to 2.1500, and then recovers to 2.200.
- Middle Right Chart:** OPGN 15 D 15m [NASDAQ] from Tuesday to Tuesday. Price starts at 2.200, dips to 2.1500, and then recovers to 2.200.
- Bottom Left Chart:** OPGN Today 20t [NASDAQ] from 7:30 to 9:45. Price starts at 2.200, dips to 2.1500, and then recovers to 2.200.
- Bottom Right Table:** Trade history for OPGN 1 D 1m [NASDAQ] from 16:00:02 to 16:00:46. The table shows bid and ask prices, sizes, and timestamps.

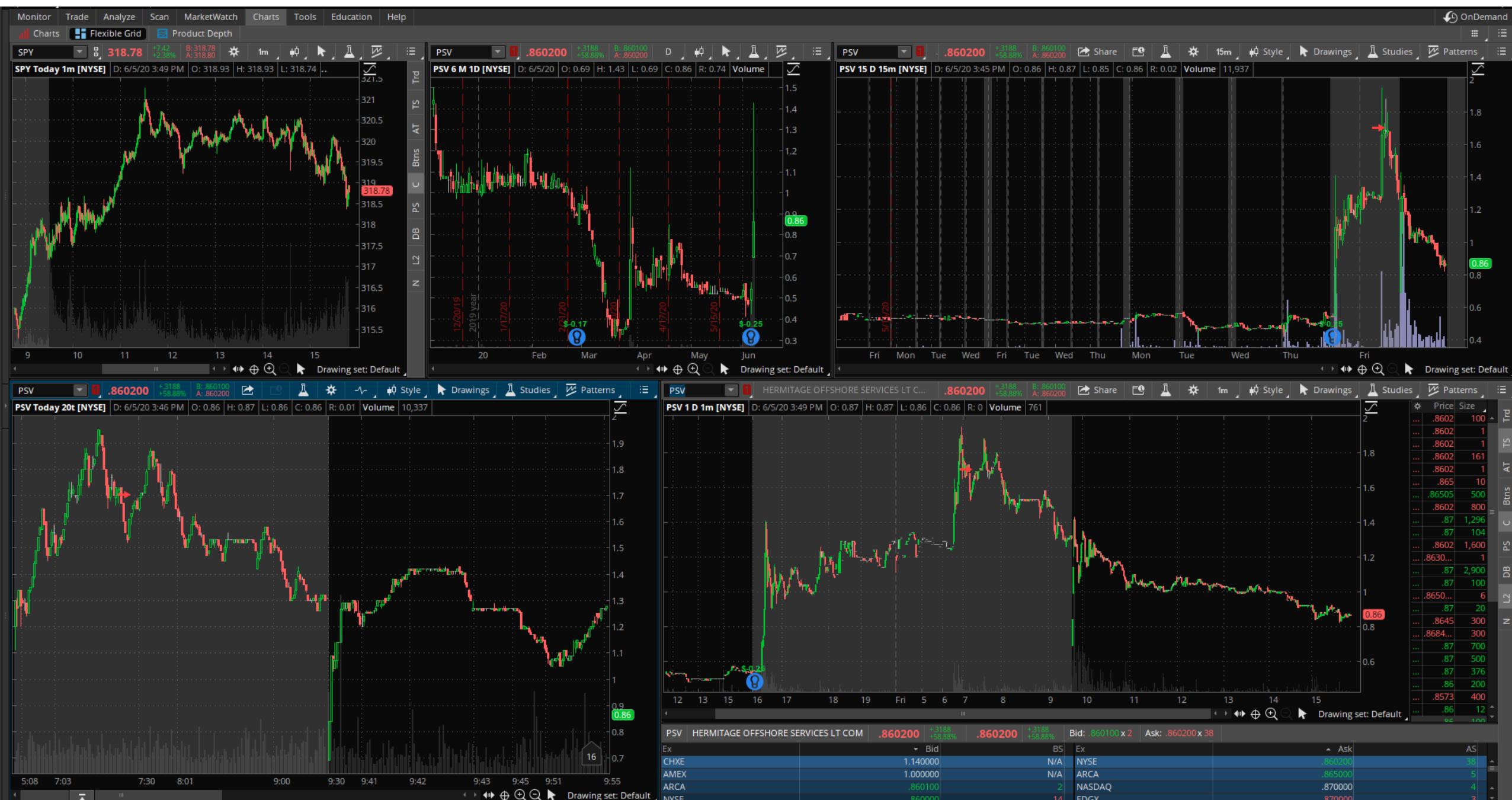
11.06.2020. Тикер: AMBO. Доходность за день : ~39%.



12.06.2020. Тикер: ZKIN. Доходность за день : ~36%

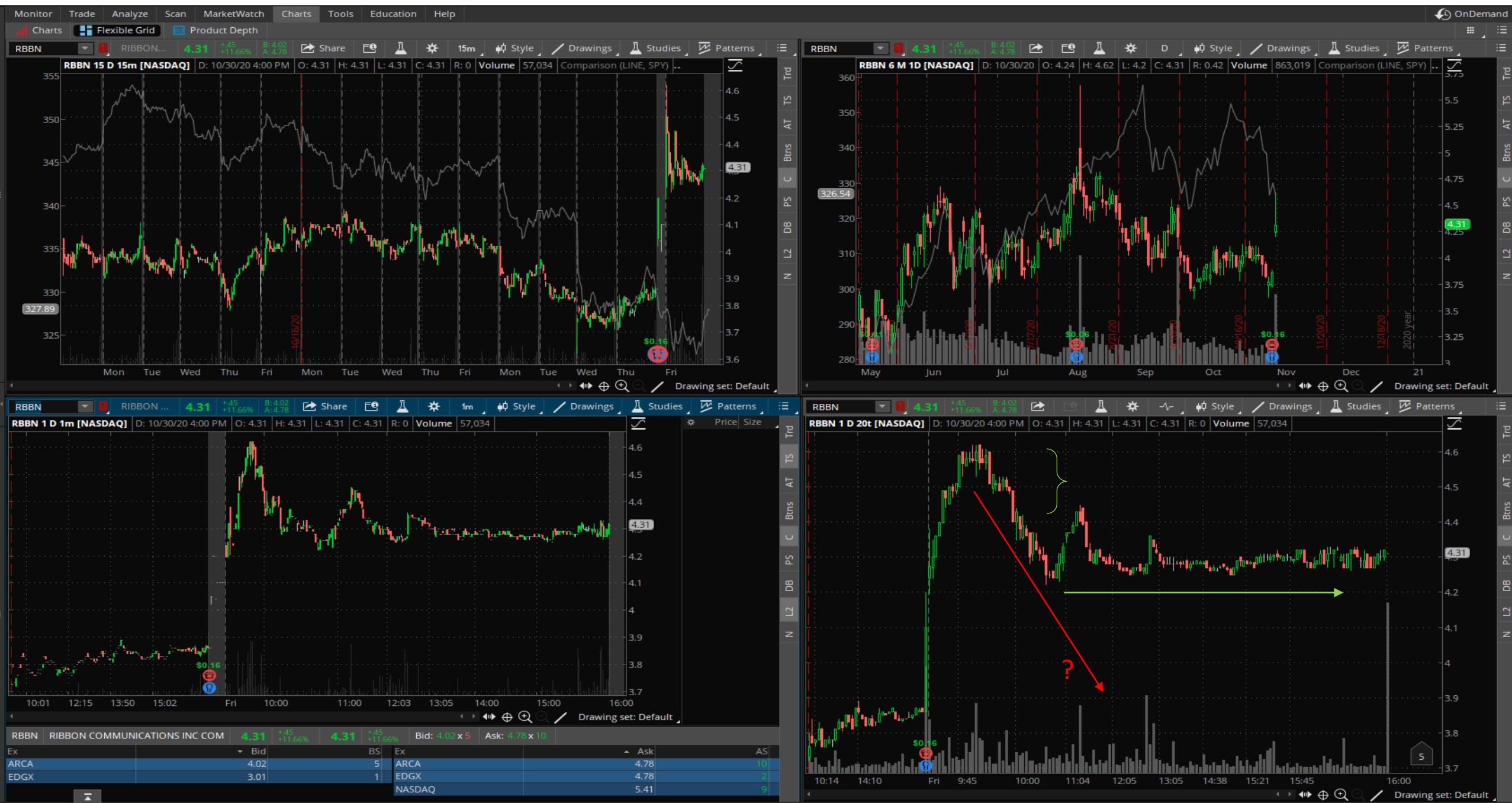


05.06.2020. Тикер: PSV. Доходность за день : ~49%

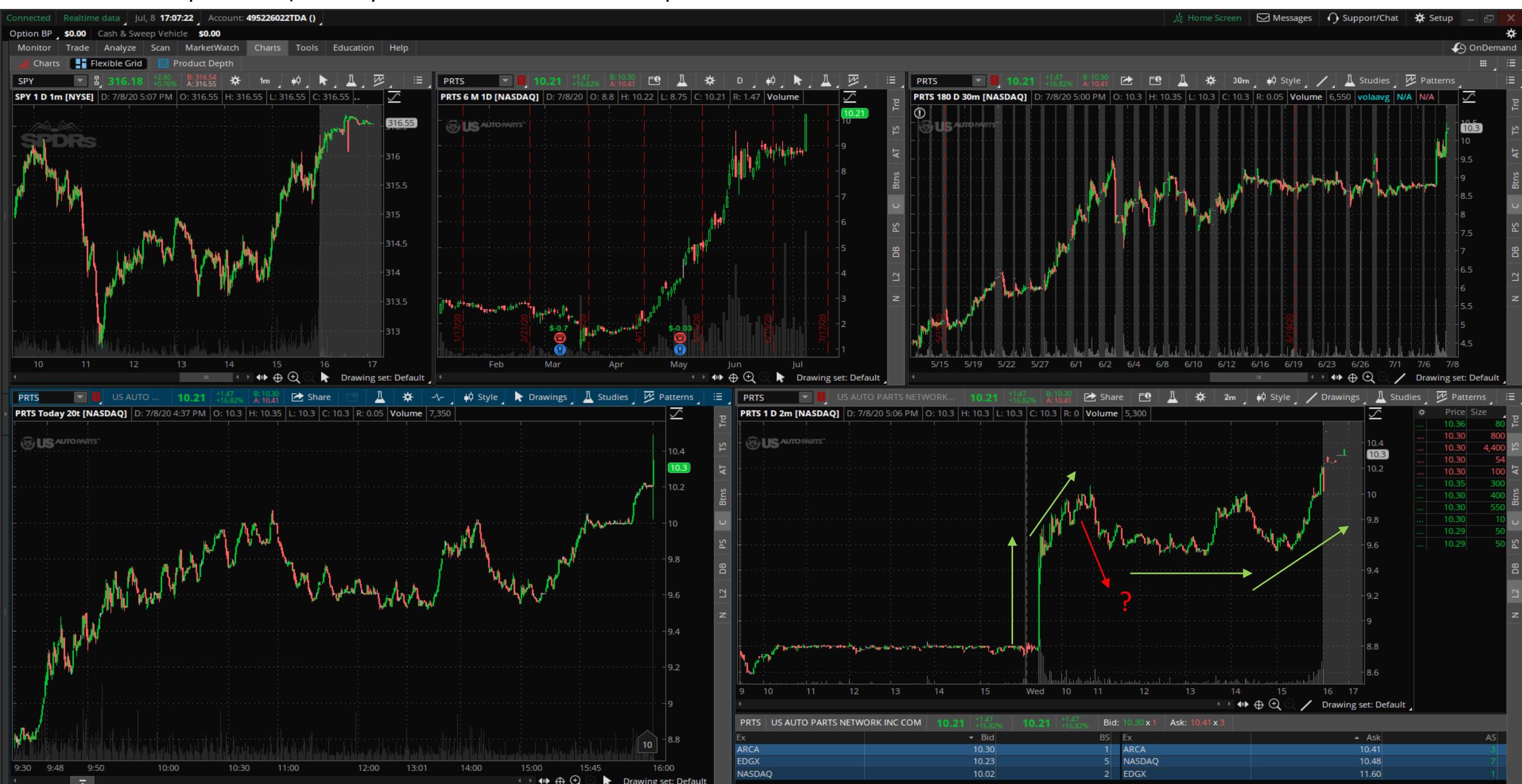


Есть случаи, когда стратегия не работает или приносит очень мало:

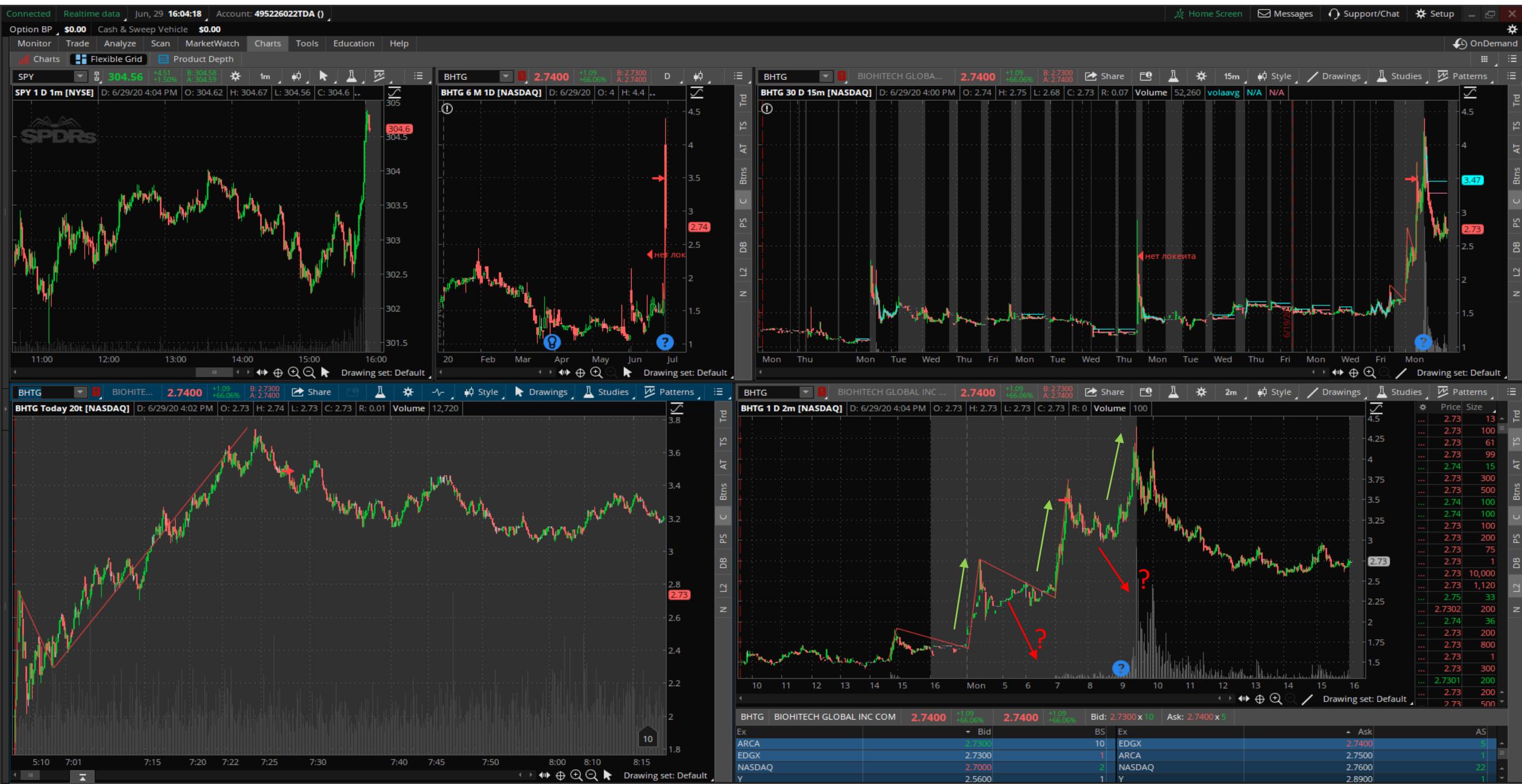
30.10.2020. Тикер: RBBN. Цена не упала не до основания.



08.07.2020. Тикер: PRTS. Цена не упала так сильно как планировалось.



29.06.2020. Тикер: BHTG. Резкие взлеты могли рассматриваться как точки входа для dump. Однако это оказался большой ритр.



01.05.2020. Тикер: GENE. Был довольно короткий промежуток времени, когда можно было закрыть dump.



04.11.2020. Тикер: YINN. Длинная свеча в начале характеризует дамп, однако цена наоборот пошла стабильно вверх.



YINN	DIREXION SHARES ETF TRUST DL FTSE BLL 3X ETF	20.12	+2.21 +12.34%	20.12	+2.21 +12.34%	Bid: 20.12 x 8	Ask: 20.24 x 3
Ex				Ex			
NASDAQ		20.12	8	NASDAQ		20.24	3
ARCA		20.12	5	BSE		20.24	1
EDGX		20.12	4	CINN		20.24	1
RATE		20.12	4	EDGY		20.24	1



Сканер пампов и дампов

Для того, чтобы в течение торгового дня выявлять потенциальные пампы и дампы, необходимо настроить сканер в торговом терминале.

Обычный процесс отбора:

Обычно настройки очень простые:

- 1) сравнение объемов торгов,
- 2) % изменения цены,
- 3) наличие нескольких принтов баров за промежуток времени для отсечения особо не ликвидных бумаг.

Далее этот список помещается в watchlist и обновляется ежесекундно. Затем трейдер сам в ручную производит отбор, исходя из дневных графиков, просмотра новостей и отчетности по бумаге и опыта понимая сформированной ценой фигуры (когда видно яркое проявление дампа или пампа).

Сканер пампов и дампов. Фильтр.

Первоначальные настройки фильтра:

Для дампов:

1. Объем 5мин бара должен превышать объем такого же по счету бара на предыдущей сессии в десятки раз.
2. Цена как мин на 50% выше последней цены последней сессии.
3. Поведение цены: одна или несколько длинных свеч.
4. Необходимо определять максимумы и уровни сопротивления на графиках дневных таймфреймов за последний год.

Для пампов:

1. Объем 5мин бара должен превышать объем такого же по счету бара на предыдущей сессии в несколько раз.
2. Средняя цена и объем плавно возрастают.
3. Уровни поддержки в тренде обычно имеют экспоненциальный рост, реже логарифмический или линейный.
4. Памп обычно может затянуться на несколько дней и на несколько стадий.
5. Необходимо определять максимумы и уровни сопротивления на графиках дневных таймфреймов за последний год.

Доходность стратегии

В среднем эта стратегия срабатывает в 70% случаев (выведено эмпирически). Можно настроить сканер так, чтобы увеличить точность, и, тем самым, сузить watchlist, ускорить отбор, быть всегда начеку и успевать с подачей ордеров (ордера и управление капиталом это отдельный процесс, который более-менее понятен для автоматизации).

Пампы и дампы не обязательно наблюдаются строго на премаркете или в другие сессии. Процесс зарождения пампа или дампа может происходить в любой промежуток времени. Если дампы легче найти из-за их несложной ценовой фигуры, то пампы куда тяжелее, но они и намного прибыльнее.

В сканер могут попадать также и бумаги с очень маленькой капитализацией, например около \$10 mln, и они могут быть Hard to Borrow (недоступность шортов), и локейтов (ордер брокеру на поиск данной бумаги где-то еще) может и не быть, а если будут, то могут стоить дорого. Поэтому необходимо найти баланс между капитализацией, ликвидностью и потенциальной прибылью, которую такие бумаги могут дать.