

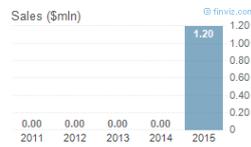
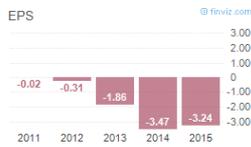


АЛГОРИТМ SHORT SQUEEZE

Short Squeeze (короткое сжатие) – вызвано закрытием позиций продавцами по причине того, что они могут понести существенные потери или забрать гораздо меньшую прибыль. В результате происходит быстрый рост акции.

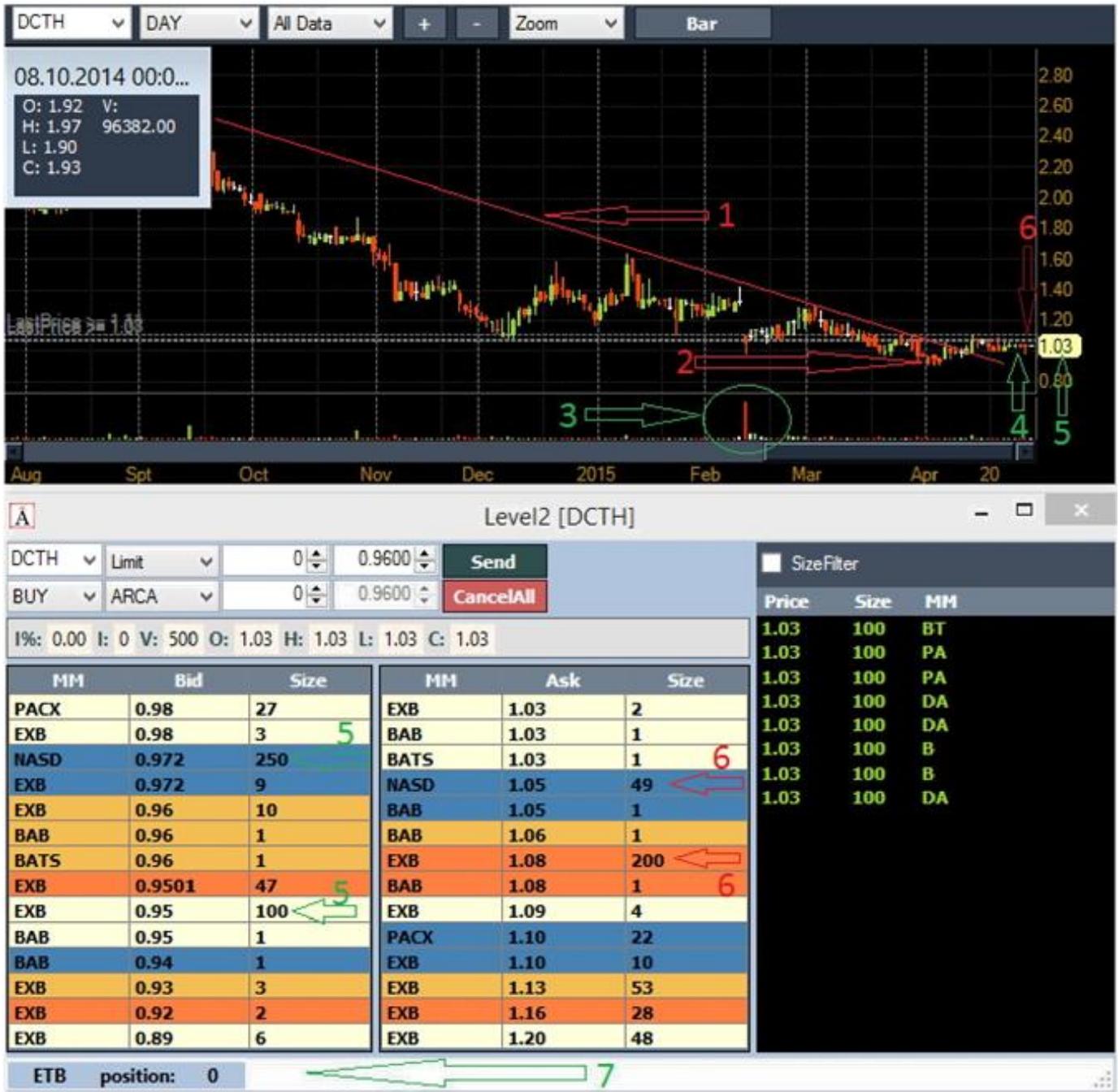


| | | | | | | | | | | financial highlights statements | |
|------------|---------|---------------|---------|---------------|------------|---------------|---------|-----------------|-------------|---|---------------|
| Index | - | P/E | - | EPS (ttm) | -1.52 | Insider Own | 26.44% | Shs Outstanding | 14.85M | Perf Week | 193.04% |
| Market Cap | 50.05M | Forward P/E | - | EPS next Y | - | Insider Trans | 0.00% | Shs Float | 13.19M | Perf Month | 443.55% |
| Income | -22.50M | PEG | - | EPS next Q | - | Inst Own | 50.80% | Short Float | 0.15% | Perf Quarter | 132.41% |
| Sales | 1.00M | P/S | 50.05 | EPS this Y | 6.70% | Inst Trans | 49.24% | Short Ratio | 0.02 | Perf Half Y | 55.30% |
| Book/sh | 1.18 | P/B | 2.86 | EPS next Y | - | ROA | -64.70% | Target Price | 15.00 | Perf Year | 23.17% |
| Cash/sh | 0.49 | P/C | 6.86 | EPS next 5Y | - | ROE | -91.70% | 52W Range | 0.50 - 3.89 | Perf YTD | 471.19% |
| Dividend | - | P/FCF | - | EPS past 5Y | - | ROI | -60.10% | 52W High | -13.37% | Beta | - |
| Dividend % | - | Quick Ratio | 2.00 | Sales past 5Y | - | Gross Margin | - | 52W Low | 571.31% | ATR | 0.39 |
| Employees | 6 | Current Ratio | 2.00 | Sales Q/Q | -85.70% | Oper. Margin | - | RSI (14) | 84.08 | Volatility | 50.78% 32.91% |
| Optionable | No | Debt/Eq | 0.37 | EPS Q/Q | 36.80% | Profit Margin | - | Rel Volume | 26.43 | Prev Close | 2.22 |
| Shortable | Yes | LT Debt/Eq | 0.22 | Earnings | Feb 03 BMO | Payout | - | Avg Volume | 983.41K | Price | 3.37 |
| Recom | 2.00 | SMA20 | 274.23% | SMA50 | 338.70% | SMA200 | 96.74% | Volume | 25,995,369 | Change | 51.80% |





АЛГОРИТМ SHORT SQUEEZE



1. Наличие плавного нисходящего тренда желательно не менее **50%** после большого роста, возможно **Pump and Dump**.
2. Обновление **Low** (срывание стоп).
3. Остановка движения большим объемом.
4. Желательно закрепление выше какой-либо фигуры.
5. Наличие в **level 2** нескольких крупных **Bid**, которые будут служить прикрытием на случай, если акция пойдет вниз, и в эти **Bid** можно будет выйти.
6. Наличие в **level 2** как минимум одного большого **Ask**, в разбор которого (желательно, когда уже забрали примерно **60-70%** от первоначального) будет делаться вход. Выше этого **Ask** уже не должно быть больших, **пример: 1.08 = 200 лотов**, и выше таких больших нет. Акции будет легко идти вверх.



АЛГОРИТМ SHORT SQUEEZE

7. Акция желательно должна быть **ЕТВ** , а не **НТВ**  и желательно не должна стоять на

UpTickRule .

UpTickRule - включается для акций, которые упали более чем на **10%** за одну торговую сессию.



| Delcath Systems, Inc. Healthcare Drug Delivery USA | | | | | | | | | | financial highlights statements | |
|--|---------|---------------|-------|---------------|------------|---------------|----------|--------------|-------------|-----------------------------------|-------------|
| Index | - | P/E | - | EPS (ttm) | -1.84 | Insider Own | 1.50% | Shs Outstand | 12.21M | Perf Week | 2.00% |
| Market Cap | 12.45M | Forward P/E | - | EPS next Y | - | Insider Trans | 0.00% | Shs Float | 12.03M | Perf Month | 0.99% |
| Income | -17.40M | PEG | - | EPS next Q | - | Inst Own | 12.40% | Short Float | 2.05% | Perf Quarter | -22.14% |
| Sales | 1.10M | P/S | 11.32 | EPS this Y | 61.70% | Inst Trans | 0.33% | Short Ratio | 1.85 | Perf Half Y | -41.38% |
| Book/sh | 1.88 | P/B | 0.54 | EPS next Y | - | ROA | -58.90% | Target Price | 1.30 | Perf Year | -72.21% |
| Cash/sh | 1.68 | P/C | 0.61 | EPS next 5Y | 15.00% | ROE | -74.30% | 52W Range | 0.91 - 3.75 | Perf YTD | -15.70% |
| Dividend | - | P/FCF | - | EPS past 5Y | 32.40% | ROI | -106.60% | 52W High | -72.53% | Beta | 1.99 |
| Dividend % | - | Quick Ratio | 4.70 | Sales past 5Y | - | Gross Margin | 72.70% | 52W Low | 13.19% | ATR | 0.06 |
| Employees | 25 | Current Ratio | 4.80 | Sales Q/Q | 0.00% | Oper. Margin | - | RSI (14) | 47.79 | Volatility | 4.59% 6.58% |
| Optionable | Yes | Debt/Eq | 0.00 | EPS Q/Q | 50.80% | Profit Margin | - | Rel Volume | 0.11 | Prev Close | 1.02 |
| Shortable | Yes | LT Debt/Eq | 0.00 | Earnings | May 06 AMC | Payout | - | Avg Volume | 132.91K | Price | 1.03 |
| Recom | 4.00 | SMA20 | 2.28% | SMA50 | -3.63% | SMA200 | -34.08% | Volume | 2,719 | Change | 0.98% |

8. **Short Float** – желательно **5%** и больше.

ShortFloat – это процентный показатель, который считается от общего количества акций в свободном для торговли доступе, он показывает какое количество акций сейчас торгуется в Short.

ShortFloat – меньше 10% (в шорте не сильно большое количество трейдеров).

ShortFloat – от 10% до 20% (в шорте более-менее нормальное количество трейдеров).

ShortFloat – больше 20% (в шорте большое количество трейдеров).



Набор позиции:

%

Первая часть позиции берется в размере **20%** от запланированного объема на сделку.

Вторая часть позиции берется в размере **20%** от запланированного объема на сделку.

Третья часть позиции берется в размере **20%** от запланированного объема на сделку.

Четвертая часть позиции берется в размере **40%** от запланированного объема на сделку.

Итого:

20% + 20% + 20% + 40% = 100% запланированная позиция на сделку.

Так же можно: **10% + 20% + 30% + 40% = 100%** запланированная позиция на сделку.

Добор позиции осуществляется лишь в том случае, когда акция движется в прибыльном для нас направлении. Если акция движется против нас, добор позиции (усреднение) не делается.

Выход из позиции осуществляется методом:

Первая часть позиции выходим в размере **10%** от объема в сделке при достижении **5-10%** движения в нашу сторону. Данная часть позиции перекрывает нам комиссию, которую мы понесли на приобретение позиции + расходы за удержание позиции через ночь и, возможно, дает небольшую чистую прибыль.

Остальную позицию делим на части равные **5-10%** от объема в сделке. Выход осуществляется по мере роста актива.

Если был сделан выход из позиции в размере **90%** от первоначального объема, оставшиеся **10%** оставлять на долгосрочный промежуток времени.

В случае большой коррекции нужно забрать не менее **40%** движения от максимального после нашего входа в позицию.



ДМИТРИЙ ФЁДОРОВ
ИЗДАТЕЛЬСТВО INFO-DVD

АЛГОРИТМ SHORT SQUEEZE

Правила риск-менеджмента:

- никогда не инвестировать больше, чем можете позволить себе потерять;
- набирать позицию частями;
- риск на отдельно взятую сделку не более 1% относительно торгового депозита;
- риск на весь портфель не более 5% относительно торгового депозита;
- просадка в стоимости инвестируемого актива - 5-8%;
- не брать больше 10% капитала в одну сделку;
- ни когда не добавлять к убыточной позиции (не усредняться);
- не вкладывать в один сектор больше 10-15% от портфеля.

Примечания:

1. Всегда нужно учитывать направление рынка. Работать по тренду.
2. Отобранные акции не должны реагировать на поведение рынка.
3. Если до квартального отчета остается менее одной недели, сделку не заключать.
4. Если до FDA остается менее одного месяца, сделку не заключать.
5. Если у компании судебные тяжбы, расторжение контрактов с другими компаниями по отношению к первой или расследования SEC, сделку не заключать.
6. Риск/Прибыль = менее 1 к 5 - сделка не заключается.
7. Средний объем в акции за одну торговую сессию 50к и больше.
8. Учитывать новостной фон компании.