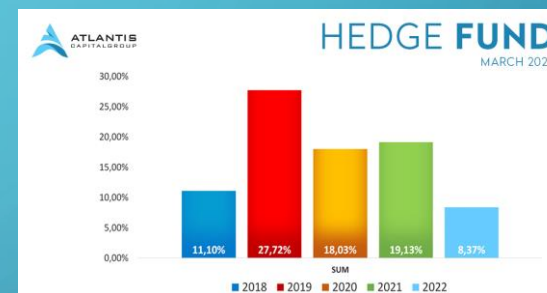




Obchodné portfólio privátneho algoritmického hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou automatických obchodných stratégií založených na systematickom a algoritmickom obchodovaní. Portfólio zahŕňa viaceré aktíva trhu s kovmi, menovými nástrojmi, indexami a energetickými aktívami. Realizácia jednotlivých obchodov prebieha na regulovaných, centralizovaných a derivátových trhoch. Stratégie uskutočňujú dlhé a krátke pozície s cieľom profitovať z identifikovaných krátkych, stredných a sezónnych trendov a trendov plynúcich z opakujúcich sa patternov, cenových formácií. Vytvorené systémy dokážu v kritických situáciách a pri vysokej volatilitě aplikovať hedge obchodný prístup. Cieľom portfólia, ktoré je kalibrované z ~ 50 logicky odlišných obchodných systémov, je dosahovať zisk v každom mesiaci. Naše riadenie rizika je prísne, založené na jasne definovaných pravidlách dynamicky sa meniaceho portfólia, ktoré sa neustále prispôbuje trhovým podmienkam.

## HEDGE FUND

- Zakladáme si na atraktívnom pomere výnosu voči riziku a stabilite.
- Spravuje 5,66 mil., kde v roku 2022 je odhad priblížiť sa až k 10,00 mil. v správe.
- Podarilo sa úspešne testovať nový typ algoritmického robota so zaujímavými výsledkami. Vďaka tomuto robotu očakávame ďaleko lepšiu diverzifikáciu portfólia, pričom nám táto dynamika, ktorá sa na trhu nachádza umožňuje vykonávať výraznejší výkon.



### ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	3,14%
Zhodnotenie od založenia fondu	+84,35%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+10,76%
Počet obchodov za posl. mesiac	178
Max. drawdown from peak	4,27%
Sharpe ratio	0,75
Profit factor	2,55%
Positive trades	80,9%



### TRADING RESULT

Year	1.	2.	3.	4.	5.	6.	7.	8.	9.	10.	11.	12.	SUM
2018								2,26%	2,96%	2,04%	1,90%	1,93%	11,10%
2019	2,61%	1,61%	5,63%	3,57%	1,20%	2,69%	2,74%	2,33%	0,87%	3,23%	1,85%	-0,61%	27,72%
2020	0,89%	-1,19%	2,11%	2,31%	1,91%	0,54%	2,13%	1,86%	1,97%	2,28%	1,73%	1,49%	18,03%
2021	1,57%	2,14%	2,05%	1,91%	2,43%	-0,42%	3,04%	1,13%	-0,83%	2,15%	2,33%	1,63%	19,13%
2022	2,17%	3,06%	3,14%										8,37%

Spoločnosť Atlantis Capital Group neustále napreduje vpred a sa rozrastá, kde sme rozšírili oddelenie o novú pozíciu projektový manažér pre Južnú Ameriku.

