



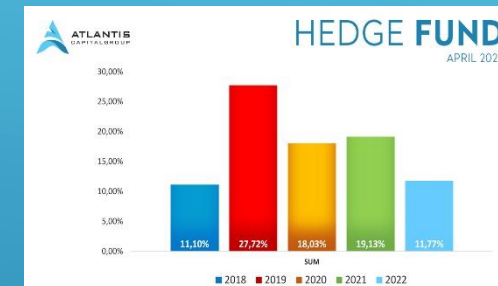
Obchodné portfólio privátneho algoritmickeho hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou automatických obchodných stratégií založených na systematickom a algoritmickej 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 5,85 mil., kde v roku 2022 je odhad približný sa až k 10,00 mil. v správe.
- Podarilo sa úspešne testovať nový typ algoritmickeho 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.

Krátke doporučenia na neistú dobu:

- Hlavnou témou je inflácia, kde bude tlak na výkonnosť portfólia a tlak na úrokové sadzby, bude zásadné, ako sa k tomu centrálni bankári postavia. Náš osobný názor je, že úrokové sadzby sa zásadne nezvýšia. To je náš názor, chcú držať infláciu vyššiu aby mohli odpísať dlhy, ktoré sú v trhu naakumulované. Vôbec by sme sa nečudovali, že by takáto inflácia trvala aj nasledujúce roky. Aktuálne napäté situácie na trhu, na základe vojenského konfliktu s Ukrajinou, môžu spôsobiť tlak na akcie, inflácia spôsobuje tlak na dlhopisy. Čo sa týka realitných vecí, nepredpokladáme nejaký výrazný prepád, ak banky nezvýšia výrazne úrokové sadzby na hypotékach. Voči výraznejšiemu ďalšiemu posilovaniu sme tiež skeptický. Záverom zdôrazňujeme, čo sme upozorňovali pred 2 rokmi, že náš čaká výrazná inflácia, preto naše aktivity v rámci komodít baní zažívajú úspech, kde sme pred supercyklom komodít, ktorý bude trvať roky.



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%	3,40%									11,77%

STATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	3,40%
Zhodnotenie od založenia fondu	+87,75%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+23,23%
Počet obchodov za posl. mesiac	191
Max. drawdown from peak	4,86%
Sharpe ratio	0,77
Profit factor	2,61%
Positive trades	81,1%