



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 prispôsobuje trhovým podmienkam.

Zakladáme si na atraktívnom pomere výnosu voči riziku a stabilite:

**ŠTATISTIKY FONDU**

Zhodnotenie za posl. mesiac	-1,14%
Zhodnotenie od založenia fondu	+90,44%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+20,27%
Počet obchodov za posl. mesiac	169
Max. drawdown from peak	3,91%
Sharpe ratio	0,76
Profit factor	1,53%
Positive trades	71,8%



Year	TRADING RESULT												SUM
	1.	2.	3.	4.	5.	6.	7.	8.	9.	10.	11.	12.	
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%	1,76%	2,07%	-1,14%						14,46%

Ťažobná spoločnosť AGM Invest C.A. naďalej výrazne napreduje. V mesiaci júl sme zrealizovali technologický audit, ktorého sa osobne zúčastnili aj naši investori. Inovali sme technické možnosti ďalšieho hĺbenia v snahe zrýchliť procesy ťažby zlata. V týchto dňoch taktiež finišujeme s hrubou stavbou nášho komerčného laboratória, ktoré bude slúžiť na odbery a rozbery vzoriek nerastných surovín v oblasti. S našimi odborníkmi sme si naplánovali ďalšie postupy, aby ťažba zlata napredovala.

