



ATLANTIS CAPITALGROUP

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.

Zakladáme si na atraktívnom pomere výnosu voči riziku a stabilite:

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	1,76%
Zhodnotenie od založenia fondu	+89,51%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+22,56%
Počet obchodov za posl. mesiac	171
Max. drawdown from peak	3,93%
Sharpe ratio	0,79
Profit factor	2,17%
Positive trades	79,3%



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%	1,76%								13,53%

Newsletter Máj 2022

Aktivity ťažobnej spoločnosti AGM INVEST C.A. naďalej výrazne napredujú. V máji sme absolvovali pracovnú cestu do Južnej Ameriky, aby sme osobne podporili našich baníkov, geológov a ďalších našich zamestnancov. Okrem samotnej ťažby zlata, výrazne postupujeme aj vo výstavbe komerčného laboratória. To bude poskytovať služby vo forme chemických rozborov nerastných surovín nielen nám, ale aj iných baníckym spoločnostiam v okolí.

