



Obchodné portfólio prívätneho 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.

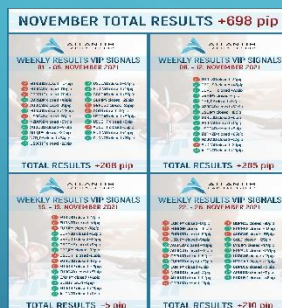
Spoločnosti Atlantis Capital Group sa podarilo založiť vo východnej Afrike ťažobnú spoločnosť. Rozvoj ďalších aktivít čakáme po ukludnení situácii v krajine.



Zakladáme si na atraktívnom pomere výnosu voči riziku a stabilite

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	2,33%
Zhodnotenie od založenia fondu	+74,35%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+20,72%
Počet obchodov za posl. mesiac	114
Max. drawdown from peak	-2,58%
Sharpe ratio	0,70
Profit factor	2,53
Positive trades	84,60%



VÝSLEDKY OBCHODOVANIA

ROK	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	1,6	5,63%	3,57	1,20	2,69	2,74	2,33	0,87	3,23	1,85	-	27,72
	%	1%		%	%	%	%	%	%	%	%	0,61%	%
2020	0,89	1,1	2,11%	2,31	1,91	0,54	2,13	1,86	1,97	2,28	1,73	1,49%	18,03
	%	9%		%	%	%	%	%	%	%	%		%
2021	1,57	2,1	2,05%	1,91	2,43	-0,42	3,04	1,13	-	2,15	2,33		17,50
	%	4%		%	%	%	%	%	0,83	%	%		%



Zo života Atlantis Capital Group, kde každý týždeň sa vzdelávame, rastieme a posúvame vpred.

