

# Newsletter November 2022

November 2022

▲ +0,64 %

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 prispôsobuje trhovým podmienkam.

Zakladáme si na atraktívnom pomere výnosu voči riziku a stabilite.

## Hedge fund

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac

**0,64 %**

Max. drawdown from peak

**2,76 %**

Zhodnotenie od založenia fondu

▲ **+97,07 %**

Sharpe ratio

**0,82**

Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov

▲ **+22,72 %**

Profit factor

**1,82 %**

Počet obchodov za posl. mesiac

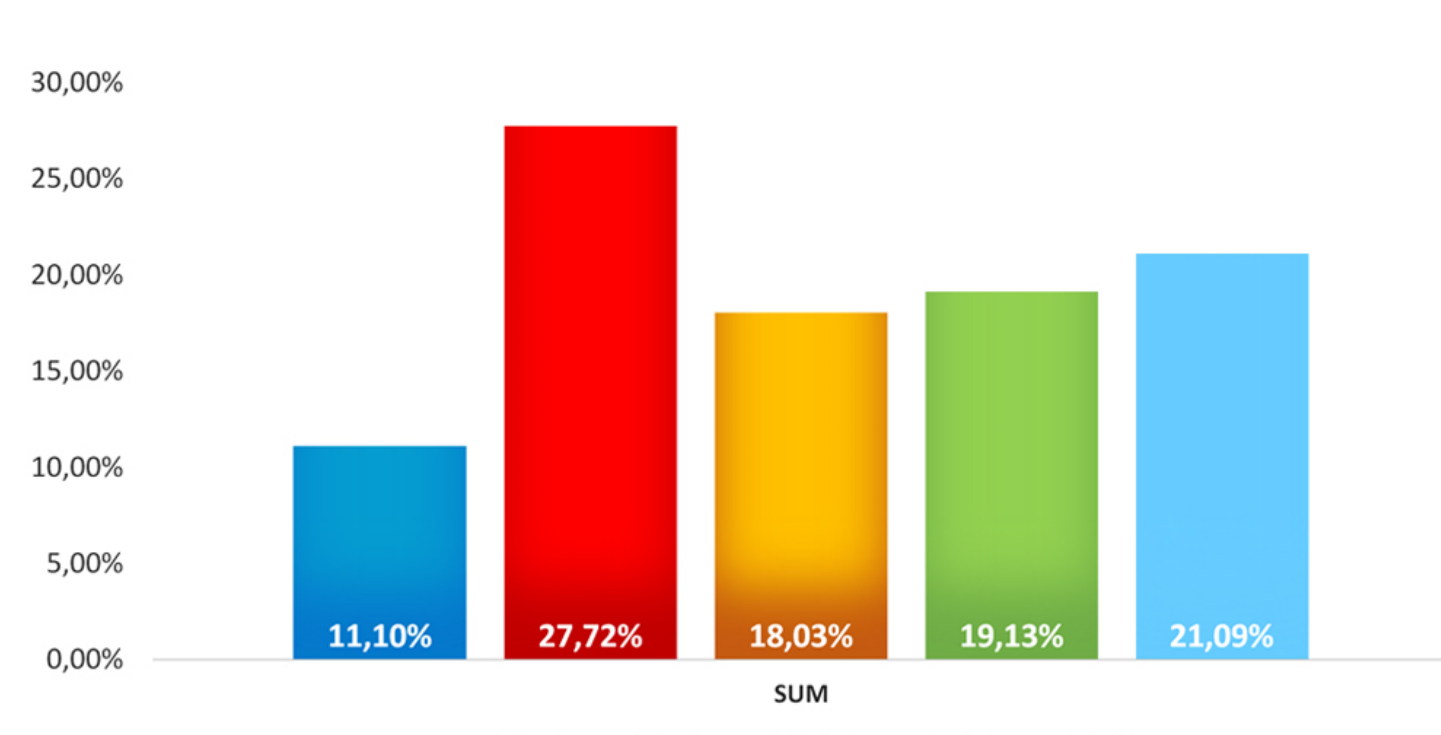
**137**

Positive trades

**75,4 %**

## HEDGE FUND

NOVEMBER 2022



## 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 %	2,07 %	-1,14 %	1,43 %	3,42 %	1,14 %	0,64 %		21,09 %



O začiatkoch, ideálnom profile správcu investícií a o všetkých podnikateľských aktivitách skupiny Atlantis Capital Group porozprával náš CEO Ľuboš Žuffa v relácii **Biznis na ta3**. Celú reláciu si môžete pozrieť na tomto linku:

<https://www.ta3.com/relacia/26483/investicie-s-absolutnym-vynosom>

## Bitcoin sa môže stať pre stagnáciu aj tradičnou formou investovania. K odpovediam sa vyjadril v denníku Hospodárske noviny CEO Ľuboš Žuffa

### KRYPTOMENY

Napriek výkyvom na finančnom trhu s kryptomenami si experti na investovanie myslia, že ide naďalej o veľmi atraktívnu formu investovania. Otázka je len to, ako sa k téme krypta vyjadrí v budúcnosti. Momentálne sa trh s kryptomenami nachádza vo výraznejšom poklese. Najznámejšia kryptomena bitcoin odpísala od svojho maxima 70 percent. Aj napriek krátkej histórii je pre trh s kryptomenami takéto správanie bežné. V minulosti sme s podobným klesaním stretli, a to napríklad v rokoch 2014, 2017 a 2018.

### Bitcoin stále jednotkou

Ľuboš Žuffa, CEO spoločnosti Atlantis Capital Group, je presvedčený, že aktuálne sme, čo sa týka kryptomien, v takom pohotovom móde. „To znamená, že trh je vystrašený, ľudia sú vystrašení tiež a riešia vážnejšie problémy. Takže teraz si asi chvíľu počkáme na to, ako sa k téme krypta vyjadrí postaviť“, hovorí Žuffa. Osobne si myslí, že ešte budeme svedkami istého poklesu s tým, že časom by sme sa mohli dostať do nejakého dlhodobého trendu. „Ak však krypto ešte trochu vyklesá, bude to stávkou o to, či tento trh v dlhodobom horizonte prežije. A to je pre mňa tá základná otázka.“, zdôrazňuje odborník na investície do kryptomien. „V téme krypta sa ukýva tiež obrovské množstvo podvodov. Je to jednoducho nový trh, ktorý sa stále len formuje“, pripomína šéf spoločnosti Atlantis Capital Group s tým, že o budúcnosti kryptomeny nemá pochybnosti. „Ale otázny je objem trhu, aký sa vyformuje.“