

Newsletter Október 2022

Október 2022
▲ **+1,14 %**

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 volatilitate 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.

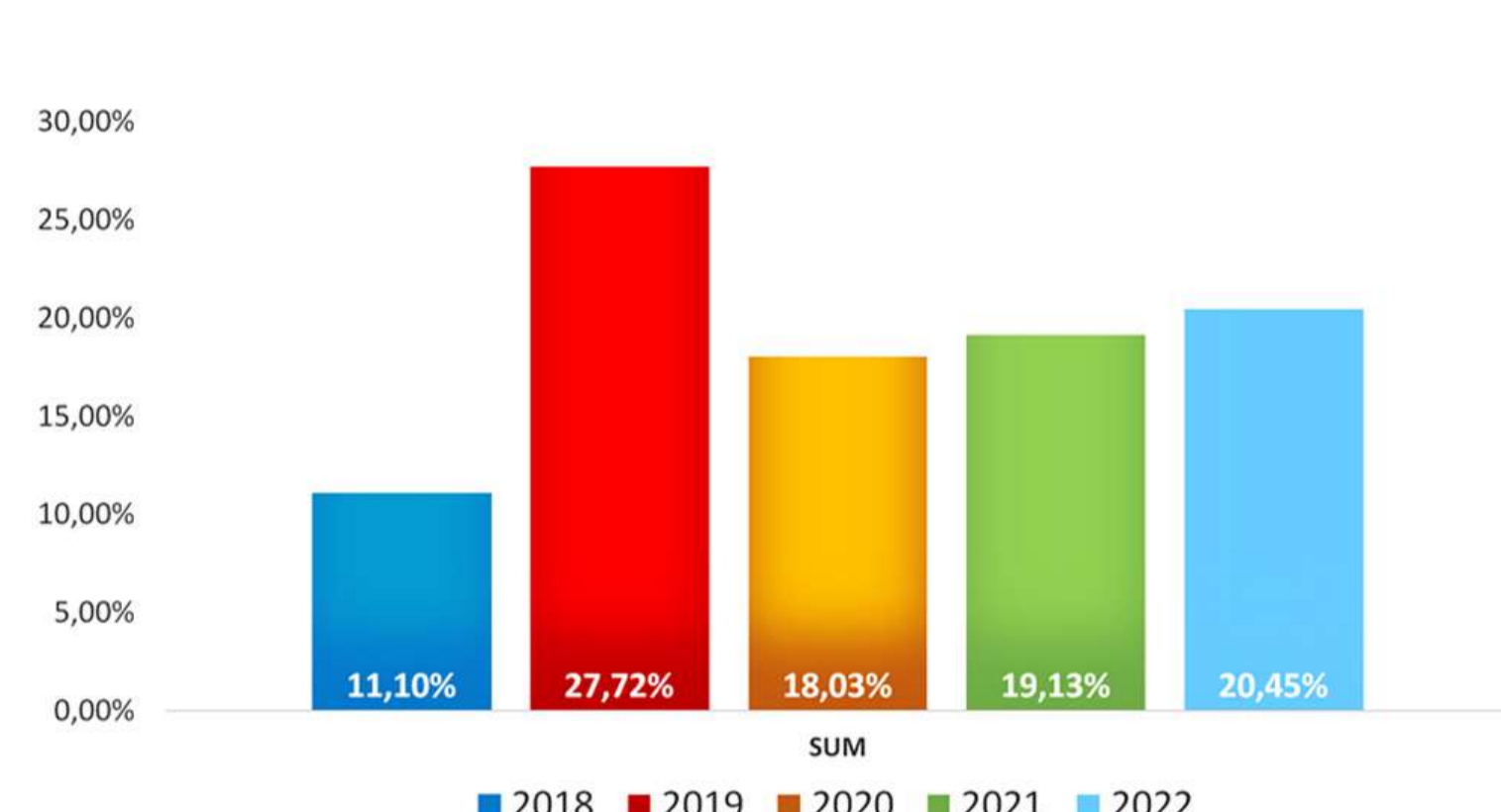
Hedge fund

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	1,14 %	Max. drawdown from peak	2,92 %
Zhodnotenie od založenia fondu	▲ +96,43 %	Sharpe ratio	0,86
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	▲ +24,41 %	Profit factor	1,98 %
Počet obchodov za posl. mesiac	156	Positive trades	76,7 %

HEDGE FUND

OCTOBER 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 %			20,45 %

Atlantis Capital Group v médiach



Vysoká inflácia bude mať negatívny dosah aj na naše úspory. Ako ich môžeme uchrániť? Na túto a aj iné otázky odpovedal náš CEO Atlantis Capital Group Luboš Žuffa vo vysielaní TA3. Celú reláciu Štúdio TA3 si môžete pozrieť na tomto linku

<https://www.ta3.com/relacia/25890/vysoka-inflacia-bude-mat-negativny-dosah-aj-na-nase-uspory-ako-ich-mozeme-uchranit>

Kedy je vhodný čas na investovanie a stačí vám aj 50 eur mesačne? Oplatí sa kúpiť zlato? K odpovediam sa vyjadril v denníku Hospodárske noviny aj náš CEO Ľuboš Žuffa

Za posledné dva roky sledujeme vytrieznenie z kvantitatívneho uvoľňovania, narušené dodávateľské reťazce či ceny energií, ktoré vyskočili do astronomických výšok. Samostatnou témou je, samozrejme, vojnový konflikt na Ukrajine. Všetky tieto veci ukázali, aký je finančný systém krehký.

Jednoduchý vstup na trh

Pre investorov súčasná situácia znamená zvýšenie nervozity. Ľuďom, ktorí aktívne neriadili svoje financie, to prinieslo veľké zníženie hodnoty investícií. Ľuboš Žuffa, CEO spoločnosti Atlantis Capital Group, však toto obdobie považuje za veľmi dobré na investície, ktoré sa vyskytnú len zriedka. Prináša totiž veľké možnosti. „Ľudia by sa mali zveriť do rúk odborníkom, ktorí vedia aktívne spravovať ich investície,“ podotýka s tým, že sa nemusia obávať ani legislatívnych zmien.

Len sa sprísniť Antí Leoude, ktorý systém, na čo sa niektorí pozerajú cez prsty. „Ja to však považujem za dobré riešenie. Pre ľudí, ktorí nemajú čo skrývať, žiadny problém nevznikol,“ zdôrazňuje s tým, že za ostatných niekoľko rokov sa tiež veľmi zmenila informatizácia. Priniesla zjednodušenie prístupu na finančné trhy takmer pre kohokoľvek. „Veľmi chválím prijatie nových pravidiel ESMA, ktoré znížili finančnú páku neprofesionálnym investorom, čo ich chráni pred nimi samými. Finančná páka je totiž dobrý sluha, ale zlý pán.“

Aktuálne zákony neobmedzujú možnosti občana investovať svoje financie. Práve naopak, podľa Žuffu v ostatnom období sú možnosti investícií väčšie a sú veľmi otvorené. „Už aj človek s 50 eurami vie vstupovať do rôznych typov moderných investičných nástrojov cez ťaž, akými sú aj takzvané exchange-traded fund, skrátene ETF, ktoré sú na to určené. Možnosti investovania sú v súčasnosti obrovské,“ vysvetľuje odborník.

Rôzne investičné nástroje kapitálového trhu vytvárajú a spravujú špecializované finančné inštitúcie a napríklad na americkej burze sa obchodujú už od roku 1993. Sú to spoločnosti založené buď ako investičné trusty, alebo investičné fondy. Indexové fondy ETF ponúkajú množstvo výhod oproti iným formám investovania, napríklad sú najvhodnejším investičným nástrojom pre menších investorov. Okrem toho sú ideálnym nástrojom aj pasívneho investovania, ktorého by sa mali držať podľa maklérov všetci drobní investori.

Chýba efektívna burza

Hoci zákony neobmedzujú obchodovanie a chuť investovať, určite je veľkou otázkou daňové zaťaženie. Ako dodáva Žuffa, okrem toho určite u nás chýba efektívna burza. „Pre daňové zaťaženie nám môže byť vzorom Česká republika, ktorá má zvládnuté oveľa lepšie. Burza, ktorá je k nám najbližšie a je relatívne schopná, je vo Varšave. Praha niečo robí, ale tiež nie je veľkou atraktívnou. A Bratislava je jednoducho maličká,“ konštatuje odborník.

Potenciálnym investorom chýba na Slovensku jednoznačne možnosť investovať aj do lokálnych firiem, ktoré oveľa lepšie poznajú. Pomohlo by to navyše aj v udržaní kapitálu na Slovensku v slovenských firmách. „Druhá vec je však tá, že u nás nie je rozvinutá ani kultúra investovania. Nakoniec podporujeme zahraničné firmy, ktoré majú gigantické rozpočty a vedia si kupovať aj naše trhy,“ poznamenáva Žuffa, pričom poukazuje na možnosti investovania do zlata.

Investícia zlato s istými parametrami totiž môže byť oslobodená od DPH. Investície do zlata tiež nie sú podľa neho finančným produktom, ktorý by bol regulovaný. „Je prirodzené, že len malé percento majetku sa dá držať vo fyzickom zlate. Odporúčam tiež obchodovanie len s overenými obchodníkmi. Treba upozorniť, že zlato nie je vhodné na obchodovanie a zarabanie peňazí,“ upozorňuje Žuffa, podľa ktorého je zlato ideálne na držanie hodnoty.

Napríklad pre prípad, že by náhodou padol finančný systém. „V takomto prípade mám niečo v rukách, za čo viem meniť tovar. Rôzne typy derivátov a finančných inštrumentov oproti zlatu nepovažujem za atraktívny inštrument na investície. V dlhodobom horizonte totiž neponúkajú zaujímavé zhodnotenie.“