

Newsletter December 2022

December 2022

▼ **-0,67 %**

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

-0,67 %

Zhodnotenie od založenia fondu

▲ +96,40 %

Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov

▲ +20,42 %

Počet obchodov za posl. mesiac

108

Max. drawdown from peak

2,93 %

Sharpe ratio

0,76

Profit factor

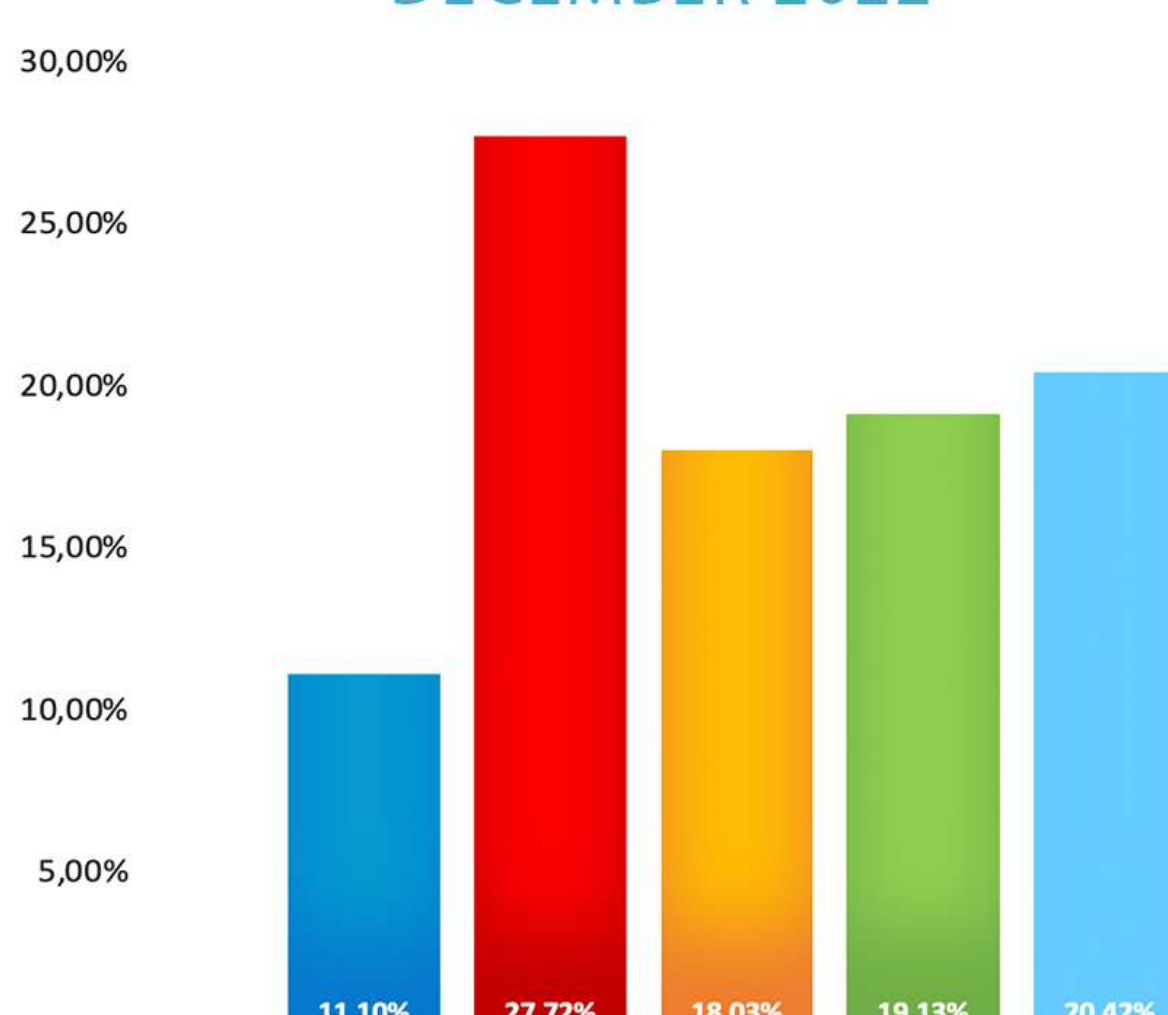
1,42 %

Positive trades

69,1 %

HEDGE FUND

DECEMBER 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 %	-0,67 %	20,42 %

Zhrnutie roka 2022 a čo nás čaká v roku 2023 slovami nášho CEO Ľuboša Žuffu

"Po tom, ako sme definitívne uzavreli rok 2022, môžem spokojne konštatovať, že sme ho ukončili nadmieru úspešne. A to aj napriek tomu, že minulý rok nebol vôbec jednoduchý. Zažili sme množstvo turbulentných situácií, s ktorými sme sa však zručne vysporiadali. Je fakt, že trh bol veľakrát veľmi nečitateľný a museli sme často meniť nastavenia našich nástrojov a prispôbovať sa trhu. V rámci nášho obchodovania robíme veľké množstvo operácií, pričom sa nám darilo aj v roku 2022 úspešne negovať niektoré stratové operácie.

Musím však formulovať aj môj predpoklad, že rok 2022 bol predohrou pred rokom 2023, ktorý bude v znamení globálnej recesie a možnom prepade v rôznych triedach aktív. V našom fonde sa preto budeme správať defenzívne s triezvym pohľadom na jednotlivé situácie. V praxi to znamená vždy veľmi dôkladnú analýzu, opatrnosť a rozvážnosť. Zlatým pravidlom u nás ostáva zodpovedný prístup k financiám. Obchody v žiadnom prípade nerobíme "horúcou hlavou", ale analytickou, systematickou a poctivou prácou chceme dosahovať výborné výsledky aj v celom roku 2023. Tešíme sa na spoločné úspechy!"

Ďakujeme Vám za prejavenu dôveru a spoluprácu v uplynulom roku. Prajeme Vám v novom roku pevné zdravie a veľa pracovných úspechov.

