

Newsletter August 2023

August 2023

▲ 2,38 %

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
2,38 %

Max. drawdown from peak
2,09 %

Zhodnotenie od založenia fondu
▲ +106,47 %

Sharpe ratio
0,79

Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov
▲ +14,06 %

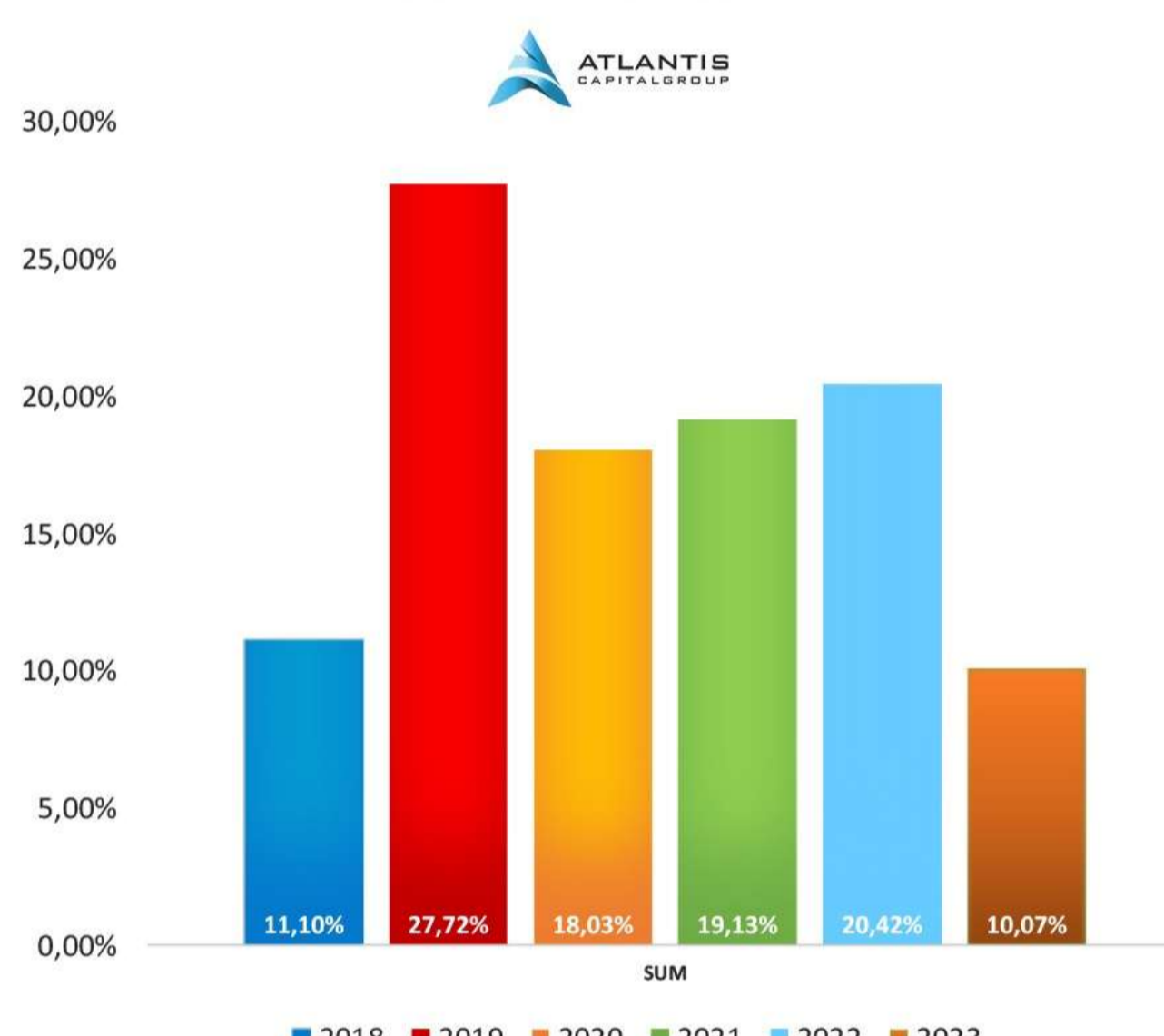
Profit factor
2,09 %

Počet obchodov za posl. mesiac
135

Positive trades
84,8 %

HEDGE FUND

AUGUST 2023



Trading result

| 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 % | 1,61 % | 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 % |
| 2023 | 0,96 % | 1,25 % | 2,81 % | 0,56 % | -1,18 % | 2,14 % | 1,15 % | 2,38 % | | | | | 10,07 % |

V ta3 o podvodoch, etike pri investovaní a aktuálnych trendoch

V pondelok 28. 8. 2023 bol hosťom relácie Investujeme v televízii ta3 JUDr. Ľuboš Žuffa, CEO spoločnosti Atlantis Capital Group. S moderátorkou Lenkou Buchlákovou primárne preberali viac ako aktuálnu tému - podvodov pri investovaní, etiku a v neposlednom rade sa dotkli aj aktuálnych trendov v oblasti tradičných aj alternatívnych investícií.

Ak ste nestihli vysielať relácie v priamom prenose, záznam nájdete na [TOMTO LINKU](#).

