

Newsletter September 2023

September 2023

▼ 0,70 %

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 prispôbuje trhovým podmienkam.

Zakladáme si na atraktívnom pomere výnosu voči riziku a stabilite.

Hedge fund

ŠTATISTIKY FONDU

 Zhodnotenie za posl. mesiac
- 0,70 %

 Max. drawdown from peak
3,75 %

 Zhodnotenie od založenia fondu
▲ +105,77 %

 Sharpe ratio
0,76

 Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov
▲ +10,48 %

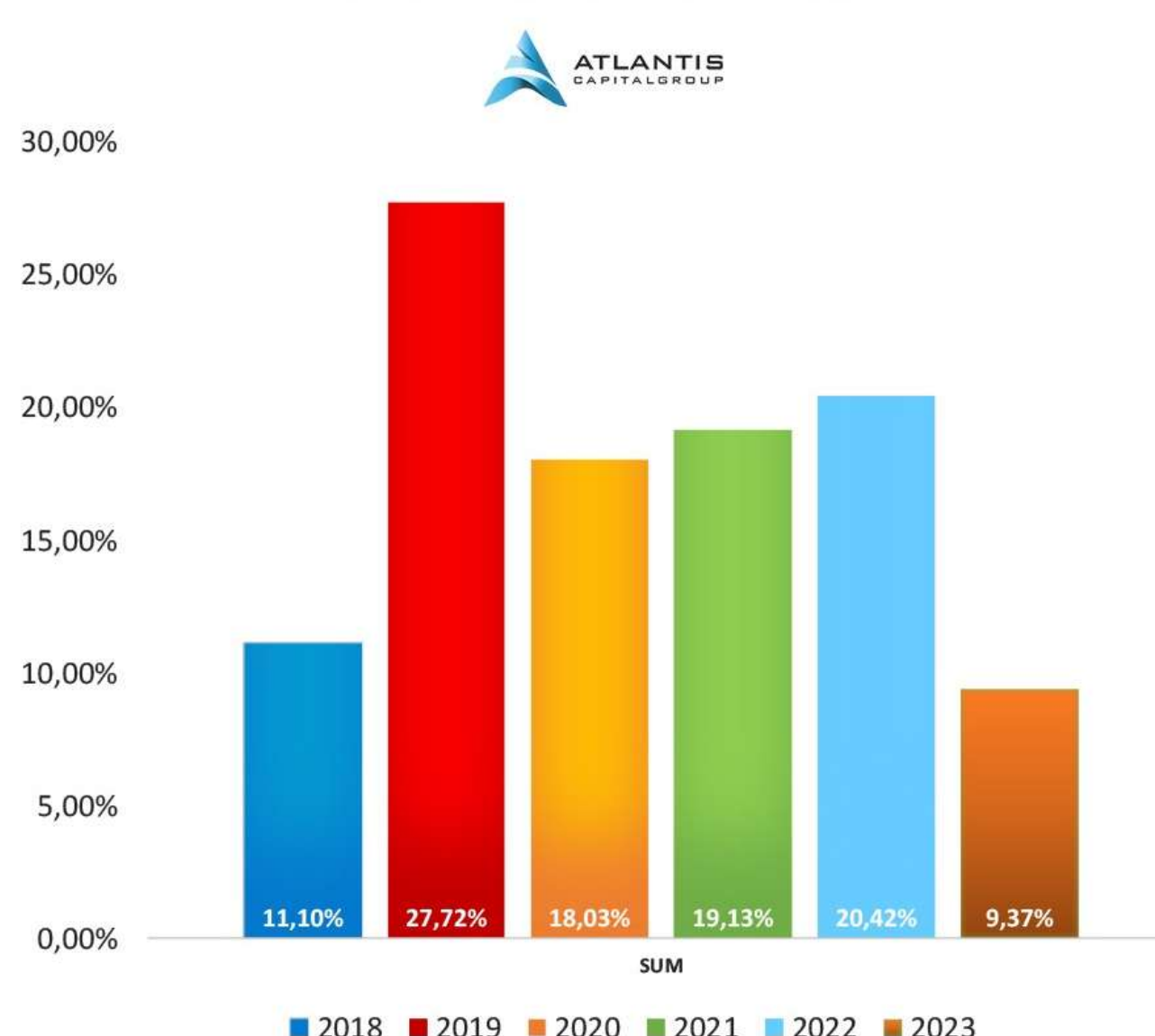
 Profit factor
0,73 %

 Počet obchodov za posl. mesiac
103

 Positive trades
65,1 %

HEDGE FUND

SEPTEMBER 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 %	-0,70 %				9,37 %

Atlantis na CEO Fóre 2023

V utorok 19.9. a v stredu 20.9.2023 sa výkonný riaditeľ Atlantis Capital Group zúčastnil na podujatí CEO Fórum 2023. Ide o kľúčový event pre CEOs, majiteľov a riaditeľov firiem na Slovensku. Fóra sa zúčastnili napr. Štefan Rosina (Matador), Roman Ježo (I.D.C.), Andrej Kiska (Dobrý Anjel), Jozef Kausich (VÚB Banka), Martin Lupták (Chemosvit), Juraj Vojtko (Mibcon), Richard Strapko (VšZP) a mnoho iných zástupcov kľúčových slovenských firiem.

Z podujatia si odnášame množstvo nových kontaktov, upevnené existujúce vzťahy a niekoľko príležitostí na ďalšiu spoluprácu. Tiež sme prezentovali aktivity Atlantis Capital Group ostatným účastníkom.

