

Newsletter Január 2024

Január 2024

▲ +1,21 %

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

+ 1,21 %

Zhodnotenie od založenia fondu

▲ **+110,27 %**

Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov

▲ **+12,91 %**

Počet obchodov za posl. mesiac

103

Max. drawdown from peak

2,24 %

Sharpe ratio

0,83

Profit factor

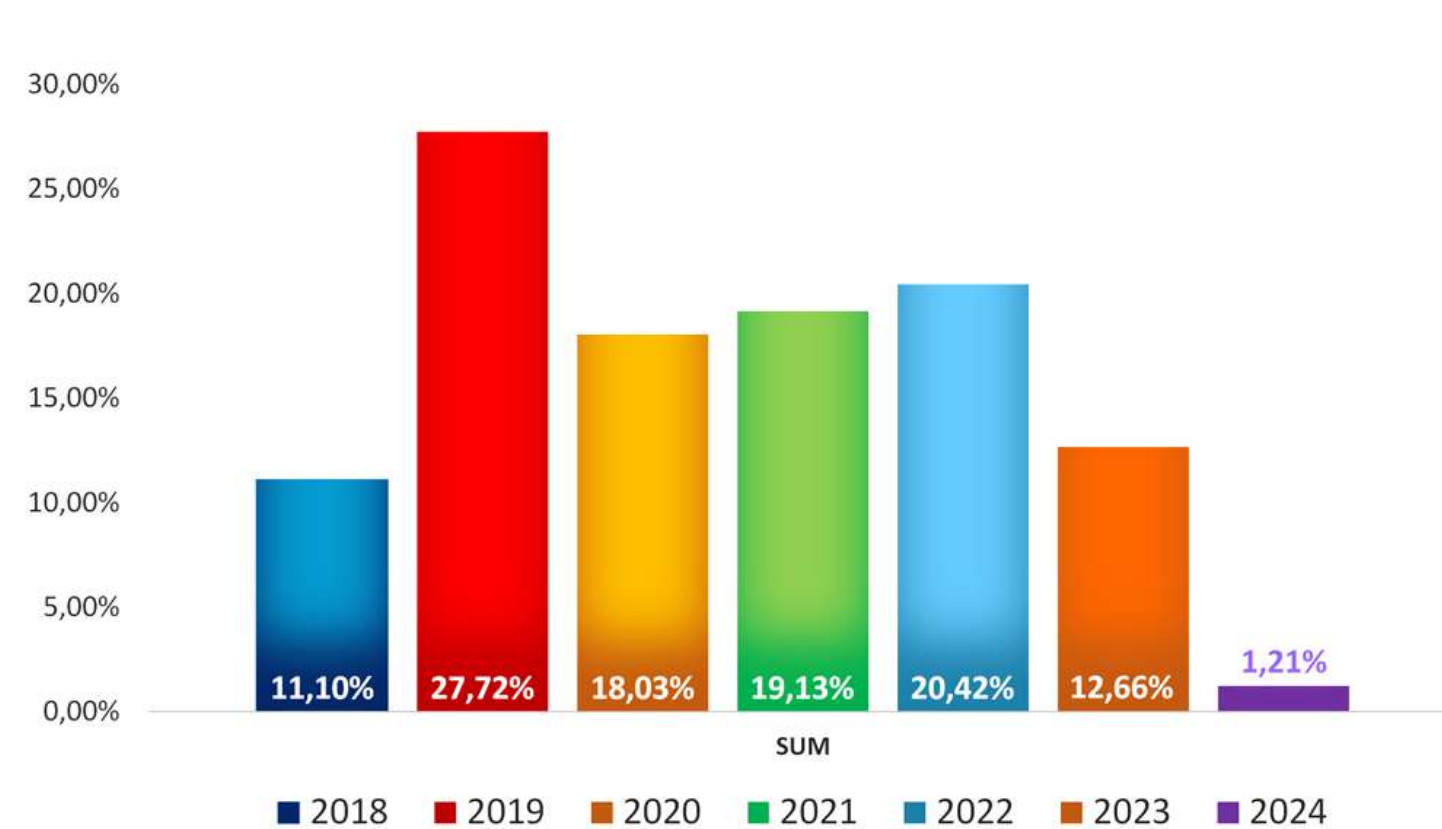
1,93

Positive trades

81,2 %

HEDGE FUND

JANUARY 2024



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 % | 3,11 % | -0,36 % | 0,54 % | 12,66 % |
| 2024 | 1,21 % | | | | | | | | | | | | 1,21 % |

Rok 2024 sme začali pozitívne, v januári sme dosiahli zhodnotenie +1,21%.

Potvrdila sa najmä naša predikcia z konca roka a to, že znižovania úrokových sadzieb hlavnými svetovými centrálnymi bankami nebude také rýchle ako sa všeobecne predpokladalo. To malo vplyv na odraz dlhopisových výnosov. Posilňoval tiež dolár a to voči hlavným svetovým menám na čele s eurom. Keďže európske ekonomické perspektívy nie sú veľmi pozitívne, predpokladáme, že Fed bude pomalšie znižovať úrokové sadzby ako ECB. Ropa rástla z dôvodu bezpečnostnej situácie na Červenom mori a zlato bolo naopak v defenzíve.

Veríme, že v pozitívnych číslach budeme ďalej pokračovať v nasledujúcich mesiacoch.

