

Newsletter Jún 2024

Jún 2024

▲ +0,38 %

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 prispôbuje trhovým podmienkam.

Zakladáme si na atraktívnom pomere výnosu voči riziku a stabilite.

Hedge fund

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac
+ 0,38 %

Zhodnotenie od založenia fondu
▲ +118,49 %

Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov
▲ +15,55 %

Počet obchodov za posl. mesiac
114

Max. drawdown from peak
2,77 %

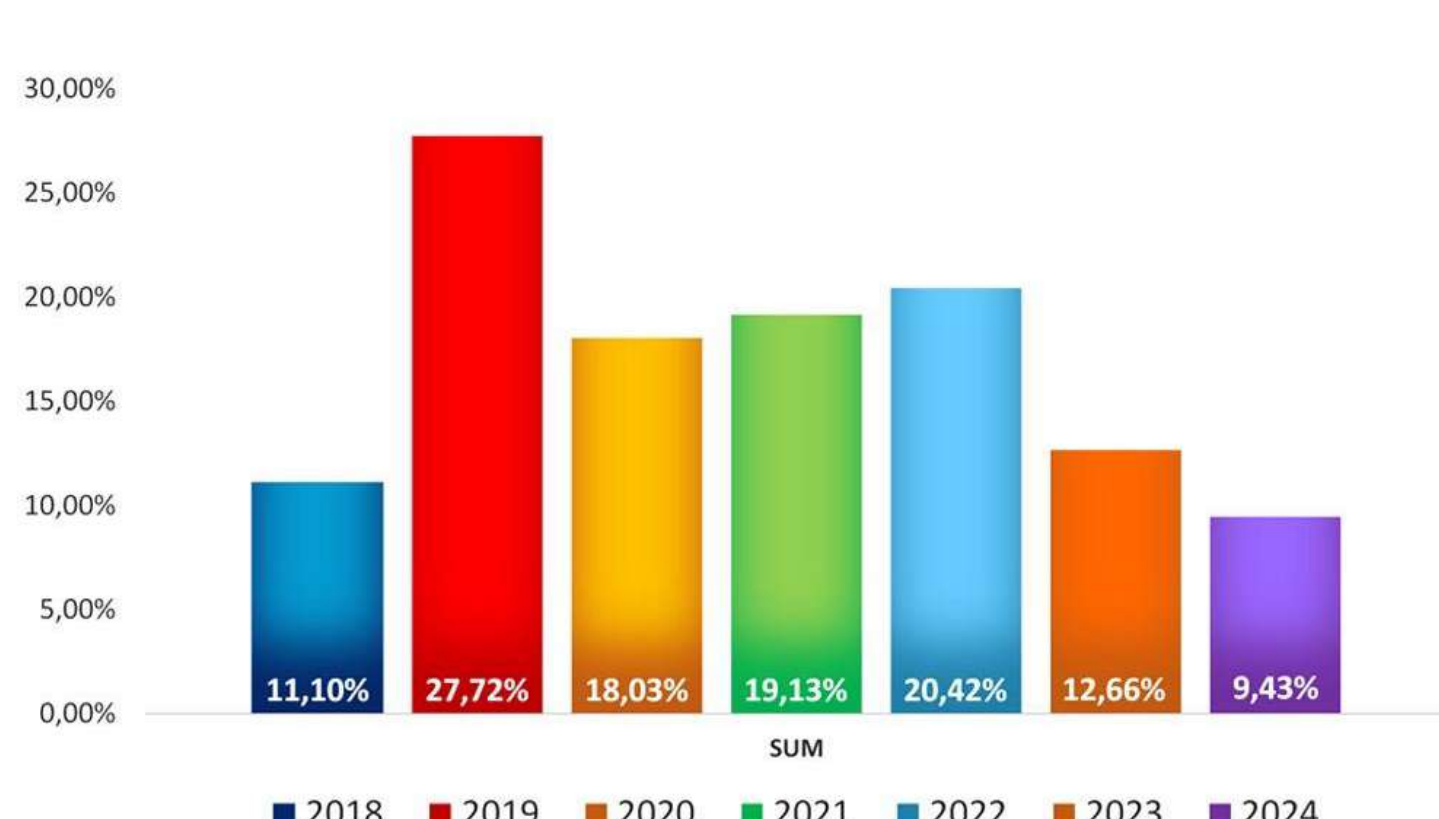
Sharpe ratio
0,86

Profit factor
1,16

Positive trades
64,3 %

HEDGE FUND

JUNE 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 %	1,39 %	3,08 %	2,10 %	1,27 %	0,38 %							9,43 %

Prinášame vám zaujímavosti z trhov na kapitálovom trhu

Jedným z najpozoruhodnejších udalostí je koniec carry trade – stratégie, ktorá spočíva v požičiavaní si v mene s nízkou úrokovou sadzbou a investovaní peňazí do meny s vysokou úrokovou sadzbou. Na to, aby takáto stratégia fungovala, sú však nevyhnutné dve podmienky: veľký rozdiel medzi úrokovými sadzbami a nízka volatilita. Úrokový diferenciál medzi hlavnými ekonomikami sa prudko zmenšil a neistejšie ekonomické a politické pozadie opäť vyvolalo volatilitu. Očakávame, že v nasledujúcich mesiacoch sa bude ďalej zvyšovať, keďže sa blížila americké prezidentské voľby. To je zvyčajne pomerne priaznivé trhovému prostrediu pre americký dolár.

Veríme, že v pozitívnych číslach budeme pokračovať aj naďalej.

