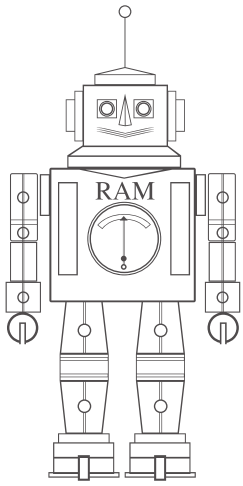
ROBOT ASSET MANAGEMENT SICAV

QUANT



Nejvýkonnější český algoritmický akciový fond na Wall Street založený předními ekonomy Pavlem Kohoutem a Alešem Michlem.

QUANT je fond od společnosti Robot Asset Management, jehož dlouhodobým cílem je dosažení kladné výkonnosti při jakémkoli vývoji trhů.

Fond je řízen portfolio manažerem, který se rozhoduje za pomoci algoritmu se zaměřením na kombinaci amerických akcií a jistého bankovního vkladu.

HLAVNÍ VÝHODY

- Vynikáme – řídíme se doporučeními algoritmu, který vyvinul Pavel Kohout.
- Algoritmus Quant se neunaví a dokáže vydělávat peníze.
- Podléháme přísnému dohledu ČNB.
- Cílem je dosažení kladné výkonnosti při jakémkoli vývoji trhů. Dle zpětných simulací provedených 1000x od roku 1959 do současnosti. Dlouhodobý průměrný výnos 5 % p.a.
- Investujeme do ETF na americké akciové indexy S&P 500 a DJIA a do bankovních vkladů.
- Nesnažíme se vyhledávat jednotlivé akcie, investujeme do trhu jako celku.
- Držíme dlouhodobé pozice.
- O fond se staráme na 100 % a investujeme také vlastní peníze.
- Investice zajištěny do české koruny.
- Výnos osvobozen od daně po třetím roce.
- Fond je otevřený. Lze kdykoli vstoupit, vystoupit.

INVESTIČNÍ FILOSOFIE

Investujeme bez lidských emocí. Řídíme se doporučeními algoritmu, který je odolný vůči stresu. Výhodou kvantitativního modelu je disciplína, jasná strategie i lepší úsudek.

Správné časování a dobře rozložené portfolio bude na trzích vždy zhodnocovat a chránit kapitál klienta i v obtížných časech. Algoritmus se tohoto doporučení drží. Je schopen včas identifikovat bubliny a ve správnou dobu doporučit opuštění investičních pozic v ETF na akciové indexy z důvodu reálného rizika poklesu trhu a ztrát.

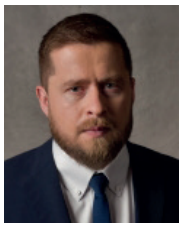
Celý matematický model je založen na porovnávání množství peněz v americké ekonomice s cenami akcií v USA. Podle těchto údajů algoritmus určí míru nadhodnocení nebo podhodnocení akcií. Pak, s přihlédnutím ke dvěma potvrzujícím indikátorům, rozhodne o tom, kolik procent portfolia mají tvořit ETF na americké akciové indexy. Když jsou akcie výrazně nadhodnocené, bude jejich podíl nízký a většina portfolia bude zainvestována v konzervativním bankovním vkladu. Naopak pokud budou akcie levné, algoritmus doporučí investovat do nich většinu portfolia.

PARAMETRY

- **Investiční společnost:** ROBOT ASSET MANAGEMENT SICAV a.s.
- **Podfond:** QUANT
- **Třída aktiv:** Fondy kvalif. investorů
- **ISIN:** CZ0008042199
- **Investiční horizont:** minimálně 3 roky
- **Měna cenného papíru:** CZK
- **Pravidelnost hodnocení:** měsíčně
- **Vstupní poplatek:** 0 až 3%
- **Výstupní poplatek:** 0%
- **Dohled:** Česká národní banka
- **Depozitář:** Česká spořitelna
- **Auditor:** KPMG
- **Správce:** AMISTA
- **Nákladovost:** 1,3%
- **Vstupní investice:** od 1 milionu Kč

ZAKLADATELÉ

Pavel Kohout
Autor klíčového algoritmu pro řízení fondu Quant. V oblasti financí pracuje od roku 1991, kdy začal vyvíjet simulační program pro trénink obchodování na burze. Pro společnost PPF napsal optimalizační program pro druhou vlnu kuponové privatizace. Působil jako poradce českých ministrů financí a v letech 2009 až 2011 byl členem Národní ekonomické rady vlády ČR (NERV). Napsal několik knih o investování.



Aleš Michl
Mezi lety 2006 a 2015 pracoval jako investiční stratég Raiffeisenbank. V investiční společnosti této banky se spolupodílel na správě aktiv v hodnotě 12 miliard korun. Působil rovněž jako externí poradce ministra financí. Třikrát po sobě získal ocenění Hospodářských novin pro analytika/ekonoma roku. V prosinci 2018 se stal členem bankovní rady České národní banky.

ROBOT ASSET MANAGEMENT SICAV a.s., podfond QUANT, IČ: 051 88 521, Budova Amazon Court, Pobřežní 661/4, 186 00 Praha 8, Česká republika
e-mail: info@fondquant.cz, web: www.fondquant.cz