



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 volatilite 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. Pre viac detailov je možné sledovať náš aktuálny výstup: <https://www.atlantiscapital.fund/>

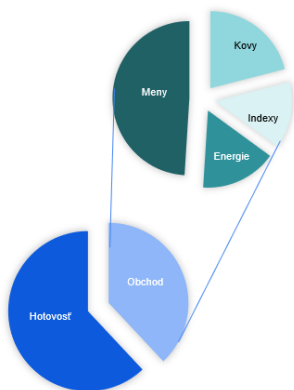
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 6,32MM
Mena fondu	EUR
Likvidita	Mesačne
Obdobie blokovania	Žiadne
Odporúčaná doba investovania	6+ mesiacov
High watermark	Áno
Manažment	Atlantis Capital CZ
Regulátor	ČNB, Praha
Broker	ACY, LCG, GAIN
Správčovský poplatok	0,1% monthly
Vstupný poplatok	1,75%
Success fee	25%
Výstupný poplatok	0%
Cieľ ročného výnosu	15% - 30% p.a.
Stratégia	Alghos

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	-0,70%
Zhodnotenie od založenia fondu	105,77%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	10,48%
Počet obchodov za posl. mesiac	103
Max. drawdown from peak	3,75%
Sharpe ratio	0,76
Profit factor	0,73
Positive trades	65,1%

ALOKÁCIA VO FONDE



Naším cieľom je dlhodobou dosahovať výnosy nad trhovým priemerom a pri nízkej volatilite portfólia.

VÝKONNOSTNÝ GRAF



LIST OBCHODNÝCH INSTRUMENTOV

INDEXES

DAX	↓
Dow Jones	↓
NASDAQ 100	↓
S&P 500	↓
EU STOXX 50	↓
FTSE 100	↑
Russel 2000	↓
Nikkei 225	↓

ENERGY

Natural Gas	↑
Brent Oil	↑
Crude Oil	↑

METALS

Platinum	↑
Gold	↓
Palladium	↑
Silver	↓

CURRENCIES

Australian dollar	↓
British pound	↓
Japanese yen	↑
Canadian dollar	↑
US dollar Index	↑

OTHERS

Mini- NASDAQ	-
SoyBean	-

KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac september 2023 pokles -0,70%. Dvojica mesiacov: EUR/USD, Euro je na pomalejšej klesajúcej špirále. V posledných týždňoch vysvetľuje veľkú časť znehodnotenia eura rozsiahle zhodnocovanie amerického dolára na devízových trhoch. Myslíme si, že minimálne do konca roka má ešte značný potenciál poklesu. EUR/GBP Centrálna banka Anglicka v septembri prekvapila devízový trh, keď sa rozhodla pre pauzu v menovej politike. Posledné zvýšenie sadzieb sa datuje do augusta. Ide o jeden z hlavných párov, ktoré zažívajú najslabšiu volatilitu. Sme vo svete, kde je kráľom dolár. Ak nedôjde k náhlemu a nepravdepodobnému zvráteniu trajektórie svetovej ekonomiky, dlhé pozície v americkom dolári budú pravdepodobne naďalej rásť. Trh je v režime averzie voči riziku. To znamená, že libra bude pokračovať v znehodnocovaní voči americkej mene. Vyhliadka na to, že sa britská ekonomika prepadne do stagflácie, zjavne nepomáha, pretože to povzbudzuje zahraničných investorov, aby opustili Spojené kráľovstvo, čím sa vyvíja tlak nadol na menu. Najväčšie výkyvy na devízovom trhu sa odohrali v Ázii. Reálny efektívny výmenný kurz japonského jenu je na 50-bodovom minime a 22 základných bodov pod skutočným efektívnym výmenným kurzom čínskeho juanu. To vytvára obrovský tlak na Čínsku ľudovú banku, aby znehodnotila juan alebo akceptovala väčšiu domácu defláciu. Podľa nášho názoru možno v krátkodobom horizonte vylúčiť znehodnotenie juanu, pretože to predstavuje riziko zrýchlenia úniku kapitálu z Číny. Krajina tak zrejme nebude mať inú možnosť, ako sa rozhodnúť pre defláciu.

TRADING RESULT

Year	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%