



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

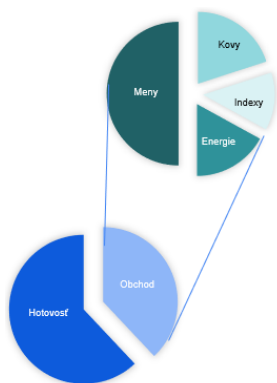
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 6,51MM
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

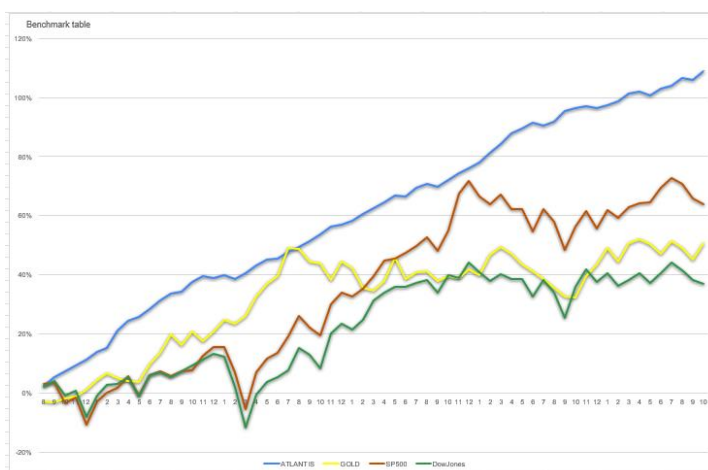
Zhodnotenie za posl. mesiac	3,11%
Zhodnotenie od založenia fondu	108,88%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	12,45%
Počet obchodov za posl. mesiac	137
Max. drawdown from peak	2,93%
Sharpe ratio	0,81
Profit factor	2,46
Positive trades	83,7%

ALOKÁCIA VO FONDE



Naším cieľom je dlhodobá dosahovať výnosy nad trhovým priemerom a pri nízkej volatilitě portfólia.

VÝKONNOSTNÝ GRAF



KOMENTÁR

JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac október 2023 rast 3,11%. EUR/USD, Menová politika a diferenciály úrokových sadzieb už pravdepodobne nebudú tými najdôležitejšími ukazovateľmi pre pár. Vnímame, že eurozóna je vystavená vysokému fiškálnemu riziku, naopak mohlo prispieť k znehodnoteniu eura. Štyri z hlavných ekonomík EÚ sú v zložitej fiškálnej situácii, samozrejme s výnimkou Nemecka. Hlavným stredobodom pozornosti je opäť Taliansko s veľkým objemom dlhu, ktorý bude čoskoro splatný a bude potrebovať refinancovanie v zlých podmienkach, vysokých verejných výdavkoch a špirálovitým deficite. GBP/USD Trend bude klesajúci, pokiaľ pár zostane pod 1,2390. Pre britskú ekonomiku sa hromadia zlé správy. Aktivita v sektore služieb zaznamenala najväčší pokles od januára, zatiaľ čo pokles výrobných aktivít je najdlhší od roku 2008-2009. Za týchto podmienok centrálna banka Anglicka 2. novembra očividne nezvyší svoje úrokové sadzby. Európska centrálna banka a centrálna banka Kanady sú v režime pozastavenia menovej politiky. Je nepravdepodobné, že by rozdiel úrokových sadzieb bol pre tento pár veľmi dôležitým ukazovateľom. CAD príliš neťažil z prudkého nárastu cien ropy. Dvojica je v istom zmysle v režime autopilota. To znamená, že vzostupný trend bude pravdepodobne vo veľmi krátkom čase pokračovať.

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

Kcw CBT	-
Lean Hogs	-

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%	3,11%			12,48%