



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 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/>

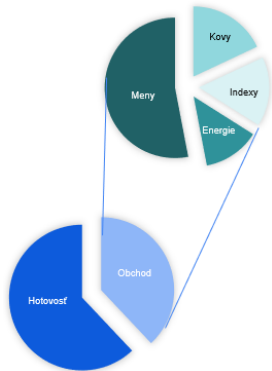
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 6,74MM
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
Správčový 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

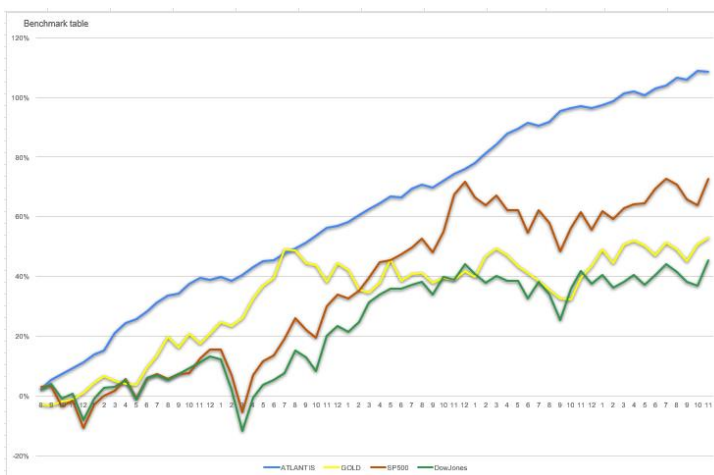
Zhodnotenie za posl. mesiac	-0,36%
Zhodnotenie od založenia fondu	108,52%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	11,45%
Počet obchodov za posl. mesiac	114
Max. drawdown from peak	3,62%
Sharpe ratio	0,80
Profit factor	0,75
Positive trades	67,2%

ALOKÁCIA VO FONDE



Naším cieľom je dlhodobé dosahovať výnosy nad trhovým priemerom a pri nízkej volatilitě 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 Index99	↓

OTHERS

Mini- NASDAQ	-
SoyBean	-

KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmickej hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac november 2023 pokles -0,36%. V tomto mesiaci sme zaznamenali abnormálny rast na akciových tituloch, či už európskych alebo amerických, kde trhy sú príliš namotivované kvôli škrtom v rámci úrokových sadzieb, čo si nemyslíme, že úplne nastane, každopádne treba byť obozretní, čo sa na trhu bude v najbližších dňoch a týždňoch ku koncu roku diať. Taktiež sme zaznamenali obrovský rast na zlate, z dôvodu geopolitického rizika, ako poistka voči napätiu a záležitostiam celosvetovej ekonomike, s tým, že očakávame možné korekcie na všetkých inštrumentoch, z dôvodu realizovania ziskov ku koncu roka. Minus nastal z dôvodu toho, že nám nevyšli niektoré predikcie ako mali, ale pokryli sme to ziskami z iných obchodov, necháme sa prekvapiť aký bude december. Súčasnú silu eura voči americkému doláru považujeme za anomáliu. Skutočnosť, že euro je tak vysoko, nie je dôsledkom obnovennej dôvery v európsku ekonomiku, ale rozsiahleho znehodnotenia dolára v dôsledku očakávaní zníženia sadzieb zo strany Federálneho rezervného systému USA (Fed). Podľa nášho názoru, prinajmenšom tri faktory vyžadujú opatnosť v súvislosti so súčasnou úrovňou jednotnej európskej meny: 1) euro je v porovnaní s ekonomickými základmi EÚ nadhodnotené; 2) trh predpokladá prvé zníženie sadzieb americkou centrálnou bankou v druhom štvrtroku 2024, no nie je to ani zďaleka isté a 3) rozšírenie rozdielov vo výnosoch na európskom dlhopisovom trhu, najmä medzi Nemeckom a Talianskom, si vyžaduje opatnosť. Preto si myslíme, že euro nemusí uniknúť novej korekcie v najbližších dňoch alebo týždňoch, keďže veľká časť jeho zhodnocovania v posledných týždňoch nemá pevný základ.

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%	-0,36%		12,12%