



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/>

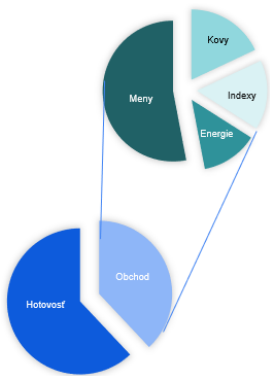
#### FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 6,77MM
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

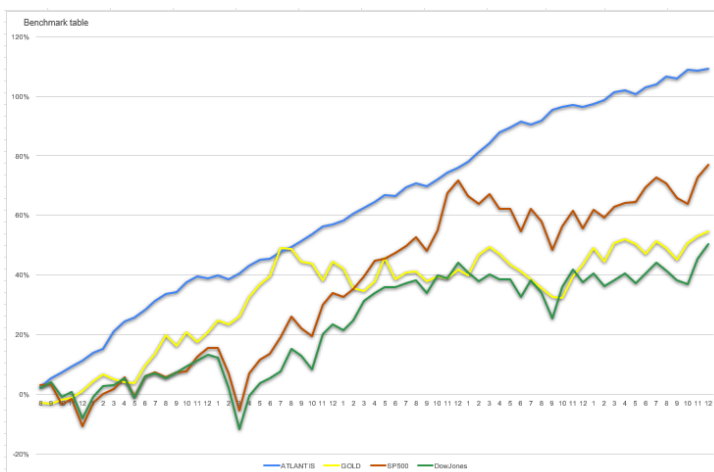
Zhodnotenie za posl. mesiac	+0,54%
Zhodnotenie od založenia fondu	109,06%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	12,66%
Počet obchodov za posl. mesiac	103
Max. drawdown from peak	2,91%
Sharpe ratio	0,81
Profit factor	1,74
Positive trades	76,2%

#### ALOKÁCIA VO FONDE



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

#### VÝKONNOSTNÝ GRAF



#### LIŠT 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

Kcw CBT	-
Lean Hogs	-

#### KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa  
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac december 2023 rast +0,54%. Americký dolár má klesnúť v roku 2024. To je to, čo predpovedajú analytici na strane predaja veľkých bánk. Stavia sa, že európska ekonomika prekoná svoju americkú náprotivok, čo povedie k recyklácii kapitálových tokov v Európe, čo následne podporí euro. Sme skeptickí. Za posledné dva roky bola eurozóna na pokraji recesie, kým ekonomika USA bola úžasne dynamická, z veľkej časti v dôsledku boju verejných výdavkov (rozpočtový deficit je na úrovni 7 % HDP). Snažíme sa zistiť, ako by sa táto situácia mohla zvrátiť v roku 2024. A analytici na strane predaja sú jediní, kto predpovedá štruktúrny pokles dolára. Centrálna banka Anglicka nedokázala presvedčiť menový trh, že nie je pripravený sa v blízkej dobe zmeniť – inými slovami, prijať menovú politiku znižovania sadzieb. Peňažný trh naďalej predpovedá štyri zníženia sadzieb v roku 2024. EUR/CNH Tí, ktorí vsádzajú na masívny čínsky stimul, budú v roku 2024 sklamaní. Konferencia Central Economic Work Conference, ktorá sa konala začiatkom decembra v Pekingu, stanovila dve ekonomické priority: žiadne zvýšenie verejných výdavkov a veľmi mierne zníženie daní obmedzené na špičkové technológie a výrobné sektory. Čína chce zároveň udržať svoju menu stabilnú za každú cenu.

#### 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%	0,54%	12,66%