



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 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/>

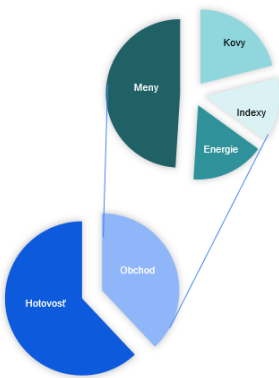
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 6,78MM
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	+1,21%
Zhodnotenie od založenia fondu	110,27%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	12,91%
Počet obchodov za posl. mesiac	103
Max. drawdown from peak	2,24%
Sharpe ratio	0,83
Profit factor	1,93
Positive trades	81,2%

ALOKÁCIA VO FONDE



Naším cieľom je dlhodobou 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 algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac január 2024 rast +1,21%. Sériu volieb má zanechať stopy v roku 2024. Prezidentské voľby v USA 5. novembra budú zjavne vrcholom roka. Ide o vysoko rizikový udalosť pre všetky finančné aktíva, najmä pre dolár. Rok vysokej volatility sa práve začína. Operátori majú dlhé pozície v americkom dolári, čo slúži ako ochrana proti geopolitickému riziku a odráža očakávania, že americká ekonomika bude v roku 2024 naďalej prekonávať eurozónu. Aj za predpokladu nulového rastu vo všetkých štyroch štvrtrokoch roku 2024 (čo je nemožné), prenos rastu z roku 2023 znamená, že rast v USA bude v tomto roku aspoň 1,3%. To isté sa nedá povedať o eurozóne. V dôsledku toho očakávame, že EUR/USD krátkodobou klesne späť do oblasti okolo 1,07. Väčšinu januára sa GBP/USD vyvíjal v rozmedzí. Z dlhodobého hľadiska stále veríme, že USD prekoná GBP (silnejšia ekonomika, menšie škrty, ako očakáva trh a prílev kapitálu smerujúci do USA namiesto Európy). Teraz vidíme konsolidáciu na páre GBP/USD, pričom cena sa blíži ku kľúčovej oblasti okolo 1,27-1,28. Dajte si pozor, aby prelomenie v oboch smeroch mohlo byť po takomto období konsolidácie potenciálne dosť výbušné. Japonská centrálna banka sa tento rok prvýkrát stretla bez toho, aby operátorom čo i len naznačila, či neuvažuje o možnom zvýšení sadzieb. Kľúčová úroková sadzba zostáva nezmenená na úrovni -0,1%, pričom mechanizmus kontroly výnosovej krivky zostal v platnosti. Inflácia prekročila cieľ Japonskej centrálnej banky už takmer minulý rok a neočakáva sa, že sa tento rok vráti na 2%. To naznačuje, že zvýšenie sadzieb je teoreticky možné. Ale načasovanie je otáznave. V krátkodobom horizonte neistota ohľadom budúceho smerovania japonskej menovej politiky naďalej poškodzuje jen.

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%
2024	1,21%												1,21%