



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/>

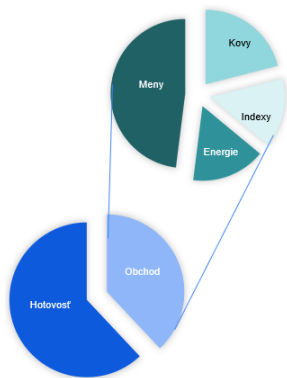
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 6,47MM
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	+1,39%
Zhodnotenie od založenia fondu	111,66%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	13,05%
Počet obchodov za posl. mesiac	117
Max. drawdown from peak	2,34%
Sharpe ratio	0,83
Profit factor	2,11
Positive trades	83,8%

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	-



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

KOMENTÁR

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac február 2024 rast +1,39%. Čo sa stalo s volatilitou? Implikovaná volatilita hlavných menových párov na devízovom trhu zostáva nízka. Je tomu tak už niekoľko mesiacov a neočakávame, že sa to v najbližšom období zmení. V hlavných pároch nie je možné zaznamenať žiadnu zmenu trendu. EUR/USD pokračuje v poklese. Na rozdiel od toho je EUR/JPY pevne ukotvený na vzostupnom trende vzhľadom na štrukturálnu slabosť japonského jenu. Sme neutrálni voči EUR/GBP, ktoré sa v posledných mesiacoch pohybovali v rámci obchodného rozpätia. Ale s blížiacimi sa prezidentskými voľbami v USA a vysokým geopolitickým rizikom, najmä v Európe, nemožno v nasledujúcich mesiacoch vylúčiť náhly nárast volatility. Neexistujú žiadne skutočné dôvody na optimizmus ohľadom páru EUR/USD. Americká ekonomika pravdepodobne prekoná výkon svojho kolegu v eurozóne. Prieskum ISM v americkom výrobnom sektore ilustruje silné oživenie aktivity a Fed v Atlante prudko zvýšil svoju prognózu rastu v USA v prvom štvrtroku na 3,2 % z 2,9 % v polovici februára. Aj keď je táto prognóza veľmi volatilná, vysiela pozitívny signál. Rast v USA sa výrazne drží, a to aj napriek vyčerpaniu takmer všetkých úspor z obdobia Covid. V eurozóne je situácia veľmi odlišná. Nemecko je v recesii, rast sa zastavil a spotrebiteľské výdavky pravdepodobne nezostanú odolné oveľa dlhšie. To všetko poukazuje na zhodnocovanie dolára. Niekoľko mesiacov sa pár EUR/GBP pohyboval v obchodnom rozmedzí – niekedy veľmi úzkom. Je pravdepodobné, že to tak zostane aj v nasledujúcich mesiacoch. Peňažný trh teraz predpokladá, že Centrálna banka Anglicka tento rok zníži sadzby len o 60 bázických bodov. Z dlhodobého hľadiska to pravdepodobne poskytne minimálnu marginálnu podporu. Ako ste pochopili, EUR/GBP pravdepodobne nebude najvolatilnejším párom v marci.

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%	1,39%											2,60%