



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/>

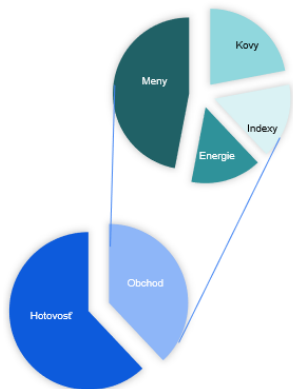
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 6,66MM
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

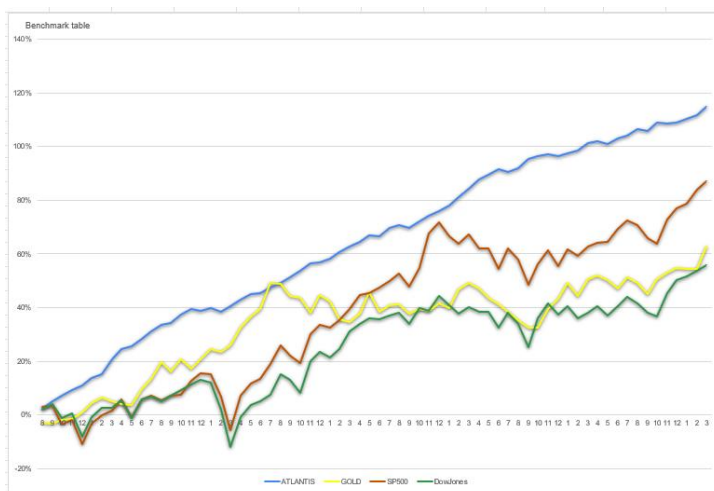
Zhodnotenie za posl. mesiac	+3,08%
Zhodnotenie od založenia fondu	114,74%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	13,32%
Počet obchodov za posl. mesiac	127
Max. drawdown from peak	2,44%
Sharpe ratio	0,85
Profit factor	2,23
Positive trades	85,1%

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 marec 2024 rast +3,08%. Prinášame vám prehľad o najnovšom vývoji na menovom trhu. Ak nedôjde k prevkapaniu na poslednú chvíľu, meny veľkých západných ekonomík budú v krátkodobom horizonte sledovať jasnú trajektóriu. Očakáva sa, že Európska centrálna banka (ECB), Centrálna banka Kanady, Federálny rezervný systém (Fed) a Švajčiarska národná banka (SNB) znížia svoje úrokové sadzby budúci rok v júni. Znamená to návrat koordinácie menovej politiky. V Ázii je situácia komplikovanejšia. V Japonsku úrady otvárajú dvere možnému zásahu na spomalenie znehodnocovania jenu. V Číne vláda vysiela protichodné signály o svojich zámeroch s jenom - znehodnotenie alebo zhodnotenie, kto vie? Pozor na opätovný nárast volatilitě. Peňažný trh si myslí, že existuje 56% pravdepodobnosť, že Centrálna banka Anglicka v júni zníži svoju základnú sadzbu o 25 bázických bodov. Z pohľadu menového páru to nič nemení. Je ťažké pochopiť, čo sa Čína snaží urobiť so svojou menou. V posledných mesiacoch mal jüan tendenciu oslabovať. To dáva zmysel, pretože to poskytuje stimul pre export – hlavný hnací motor ekonomiky. Preto je potrebná opatnosť. Nestabilita čínskej meny, a to aj voči euru, v minulosti systematicky vyvolávala ekonomické a finančné otrasy po celom svete. Japonský jen minulý týždeň dosiahol voči americkému doláru najnižšiu úroveň od roku 1990. História nám pripomína, že kurzové intervencie sú účinné len vtedy, ak sú koordinované. Ako také by museli zasiahnuť aj USA, čo je nepravdepodobné. Preto si naďalej myslíme, že jen zostane relatívne slabý po väčšinu roka.

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%	3,08%										5,68%