



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/>

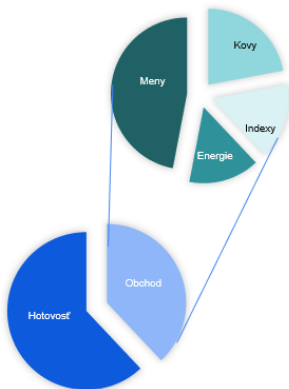
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 6,9MM
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

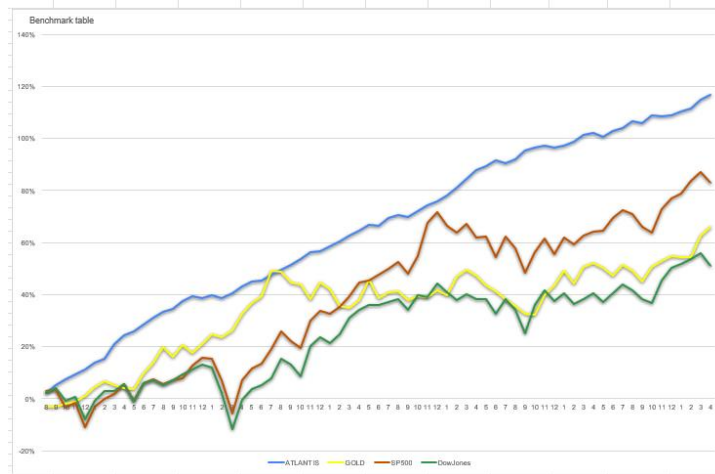
Zhodnotenie za posl. mesiac	+2,10%
Zhodnotenie od založenia fondu	116,84%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	14,86%
Počet obchodov za posl. mesiac	114
Max. drawdown from peak	2,23%
Sharpe ratio	0,86
Profit factor	2,16
Positive trades	82,5%

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

Kcw CBT	-
Lean Hogs	-



KOMENTÁR

JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac apríl 2024 rast +2,10%. Aktuálne zužitkovávame lepšie podmienky ktoré máme, ktoré sa prejavili na výnosoch. Pred niekoľkými mesiacmi menový trh predpovedal šesť až sedem znížení sadzieb zo strany americkej centrálnej banky (Fed). Dnes je na peňažných trhoch oceňovaný iba jeden pokles v novembri. Prečo? Pretože inflácia zostáva tvrdohlavo vysoká, najmä v službách. Hroziace oddelenie úrokových sadzieb medzi dvoma stranami Atlantiku by mohlo znamenať obdobie menového neporiadku. Vidno to už aj v Ázii. Udržiavaním vysokých menových sadzieb Fed vytvára podmienky na štrukturálne zhodnocovanie amerického dolára, a tým aj na znehodnotenie ostatných mien. Niektoré centrálné banky sú nútené zaviesť mimoriadne zvýšenie sadzieb. Iné, ako napríklad Centrálna banka Japonska, volia priame intervencie na menovom trhu. Mnoho trhovcov operátorov naďalej predpovedá agresívne znehodnotenie júanu. To sa nám vzhľadom na zmenu v menových rezervách čínskej centrálnej banky nezdá dôveryhodné. Naopak, zdá sa, že Peking chce obmedziť znehodnotenie meny nákupom júanu na trhu. Cieľom je posilniť menovú stabilitu, a tým zabrániť podnecovaniu úniku kapitálu. EUR/AUD túto dvojicu treba v nasledujúcich mesiacoch pozorne sledovať. Navzdory všetkým očakávaniam by Austrálska rezervná banka mohla opäť zvýšiť svoje úrokové sadzby, aby zabránila pretrvávajúcej inflácii. Ak sa tak stane, austrálsky dolár sa pravdepodobne zhodnotí voči svojim hlavným protistranám.

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%	2,10%									7,78%