



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/>

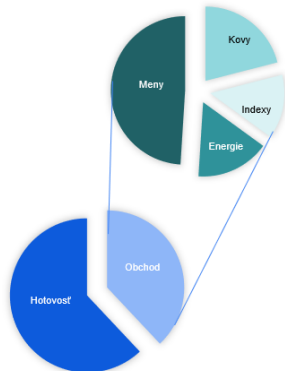
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 7,3MM
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	+1,27%
Zhodnotenie od založenia fondu	118,11%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	17,31%
Počet obchodov za posl. mesiac	108
Max. drawdown from peak	2,31%
Sharpe ratio	0,87
Profit factor	1,86
Positive trades	78,9%

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

Mini- NASDAQ	-
SoyBean	-

KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac máj 2024 rast +1,27%. Cyklus menového uvoľňovania sa má začať tento mesiac. Očakáva sa, že Európska centrálna banka a Centrálna banka Kanady znížia svoje sadzby už na budúci týždeň. Ďalšie budú nasledovať v najbližších mesiacoch: Centrálna banka Anglicka v auguste a Švajčiarska národná banka v septembri. Naopak, znižovanie sadzieb zo strany Federálneho rezervného systému (Fed) zostáva neisté. Toto je kľúčový problém. Ak Fed pomaly uvoľňuje svoju menovú politiku, vytvorí to priepastný úrokový diferenciál voči zvyšku sveta, čo je historicky synonymum menových turbulencií. Štyri hlavné faktory vysvetľujú zhodnotenie eura voči doláru: vyberanie zisku z dolára po vynikajúcom prvom štvrťroku; viditeľnosť menovej politiky eurozóny v krátkodobom horizonte; prílev kapitálu, ktorý sa bude recyklovať na európskom akciovom trhu pri hľadaní podhodnotených spoločností; a trochu dobrých správ o výrobnom fronte eurozóny. Ale nič z toho nebude trvať, pretože to všetko sú krátkodobé faktory. Ekonomická história nás predovšetkým učí, že veľký diferenciál úrokových sadzieb bol vždy hlavným faktorom menových posunov. Keďže ECB je nastavená na zníženie sadzieb ešte pred Fedom, všetko nasvedčuje tomu, že euro musí oslabiť. EUR/GBP Inflatcia v službách prekvapila v apríli v Spojenom kráľovstve smerom nahor. To nespochybňuje dezinflačný trend, ale môže to viesť BoE k určitej opatrnosti. Myslíme si, že prvé zníženie sadzieb v auguste je rozumnejšou možnosťou ako v júni. V každom prípade je dopad na dvojicu slabý. Vyhlásenie predčasných všeobecných volieb 4. júla môže spôsobiť miernu volatilitu libry bez toho, aby zmenilo jej základný trend. Austrálsky dolár je jedinou menou G10, v ktorej sa krátke pozície minulý týždeň zvýšili. Základný trend na AUD je podľa nášho názoru stále klesajúci. Neistota ohľadom smerovania austrálskej menovej politiky nepomáha. Zasadnutie centrálnej banky 18. júna bude potrebné pozorne sledovať, aby ste získali lepšiu predstavu o tom, kam sa budú úrokové sadzby uberať v nasledujúcich mesiacoch. Trh je hlboko rozdelený, pričom niektorí analytici dokonca predpovedajú zvýšenie sadzieb.

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%	1,27%								9,05%