



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/>

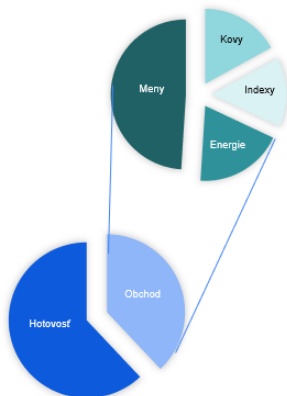
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 7,9MM
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

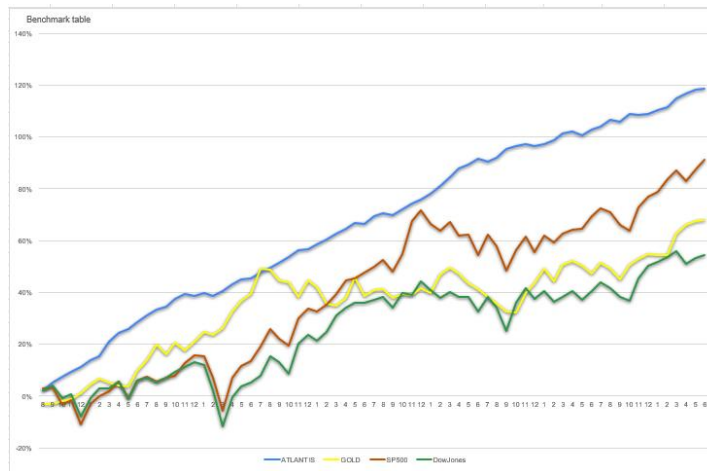
Zhodnotenie za posl. mesiac	+0,38%
Zhodnotenie od založenia fondu	118,49%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	15,55%
Počet obchodov za posl. mesiac	114
Max. drawdown from peak	2,77%
Sharpe ratio	0,86
Profit factor	1,16
Positive trades	64,3%

ALOKÁCIA VO FONDE



Naším cieľom je dlhodobou dosahovať výnosy nad trhovým priemerom a pri nízkej volatilitě portfólia.

VÝKONNOSTNÝ GRAF



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

KOMENTÁR

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac jún 2024 rast +0,38%. Jedným z najpozoruhodnejších udalostí je koniec carry trade – stratégie, ktorá spočíva v požičiavaní si v mene s nízkou úrokovou sadzbou a investovaní peňazí do meny s vysokou úrokovou sadzbou. Na to, aby takáto stratégia fungovala, sú však nevyhnutné dve podmienky: veľký rozdiel medzi úrokovými sadzbami a nízka volatilita. Úrokový diferenciel medzi hlavnými ekonomikami sa prudko zmenšil a neistejšie ekonomické a politické pozadie opäť vyvolalo volatilitu. Očakávame, že v nasledujúcich mesiacoch sa bude ďalej zvyšovať, keďže sa blížila americké prezidentské voľby. To je zvyčajne pomerne priaznivé trhovému prostrediu pre americký dolár. Po dvoch rokoch ekonomickej stagnácie a dobrom prvom štvrťroku 2024 eurozóna opäť sklzne do stagnácie. Zníženie sadzieb ECB to nezmení. Ba čo viac, prílev zahraničného kapitálu pri hľadaní podhodnotených spoločností na európskom trhu, ktorý na istý čas posilnil euro, teraz opúšťa kontinent. Kam majú namierené? Do USA, kde ekonomika naďalej prekonáva. EUR/CAD Neprijemné prekvapenie na fronte inflácie v Kanade. Májový index spotrebiteľských cien opäť zrýchľoval na anualizovaných 2,9 % oproti prognóze 2,6 %. To je veľmi zlá správa a Kanadská centrálna banka sa môže pred opätovným znížením sadzieb dvakrát odraziť. Podľa nášho názoru je to tiež dosť negatívne pre kanadský dolár. V každom prípade to už nemôže byť horšia pripomienka toho, že boj s infláciou nekončí. Kanada nie je jedinou krajinou, ktorá je na tom z hľadiska inflácie zle. Austrália tiež čelila nemilému prekvapeniu do tej miery, že Austrálska rezervná banka môže v auguste zvýšiť svoju úrokovú sadzbu. Ak by sa to potvrdilo, bolo by to pre austrálsky dolár pozitívne. Z dlhodobého hľadiska sme však na páre EUR/AUD stále v pozore.

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	-

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%	0,38%							9,43%