



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/>

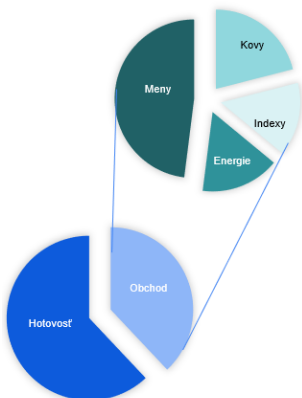
#### FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 8,5MM
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

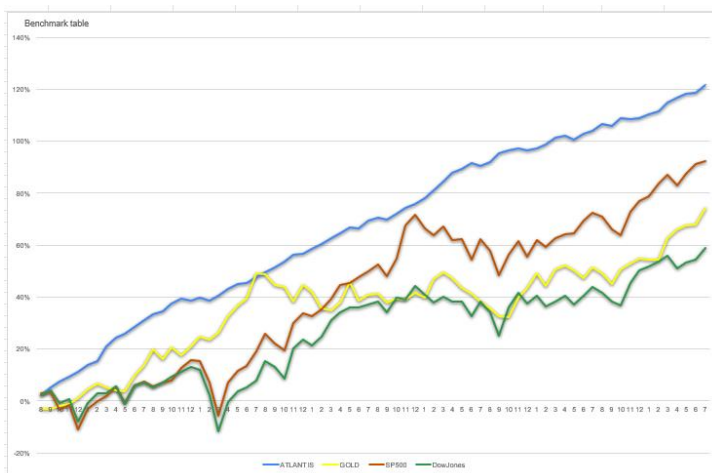
Zhodnotenie za posl. mesiac	+3,02%
Zhodnotenie od založenia fondu	121,51%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	17,60%
Počet obchodov za posl. mesiac	123
Max. drawdown from peak	2,42%
Sharpe ratio	0,88
Profit factor	2,21
Positive trades	85,7%

#### ALOKÁCIA VO FONDE



Naším cieľom je dlhodobou dosahovať výnosy nad trhovým priemerom a pri nízkej volatilitě 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 júl 2024 rast +3,02%. Letné turbulencie. Leto často vedie k finančnej panike. Tento rok nebol výnimkou. Ekonomická dynamika slabne a niektorí sa obávajú recesie v USA. Výsledky uvádzané poprednými kótovanými spoločnosťami boli slabé, čo odrážalo pokles globálnej spotreby. Centrálné banky vyvolávajú niekoľko nepokojov, ktoré čiastočne vysvetľujú paniku na akciových trhoch. Našťastie je menový trh o niečo pokojnejší, okrem párov JPY. EUR/USD v súčasnosti sa všeobecne uznáva, že americká centrálna banka (Fed) v septembri zníži svoju sadzbu. Jediným problémom je, že každá predtým zverejnená neuspokojivá štatistika by mohla vyvolať negatívnu reakciu trhu. Investori budú nevyhnutne opakovať večnú mantru, že Fedu trvalo príliš dlho, kým uvoľnil svoju menovú politiku. Reakciu tohto typu sme videli minulý piatok na základe údajov o zamestnanosti v USA. V júli sa miera nezamestnanosti prudko zvýšila. Pri bližšom pohľade sme si však všimli, že toto číslo bolo ovplyvnené vplyvom hurikánu Beryl, ktorý zasiahol Texas začiatkom júla. V skutočnosti nárast miery nezamestnanosti odráža dočasné prepúšťanie súvisiace s touto klimatickou udalosťou. Na vysoko febrilnom trhu je preto potrebné postupovať opatrne a analyzovať štatistiky s trochou nadhľadom. V Spojenom kráľovstve odštartovala Centrálna banka Anglicka cyklus znižovania sadzieb podľa očakávania. Je nepravdepodobné, že by sa na každom menovopolitickom zasadnutí rozhodlo o znížení sadzieb, keďže existuje značné riziko, že inflačné tlaky do konca roka zosilnú a stlačia infláciu tesne nad 2 %. Problémom zostáva aj inflácia v službách, podobne ako v mnohých vyspelých krajinách. Medziročne predstavuje viac ako 5%.

#### 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%	3,20%						12,63%