



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/>

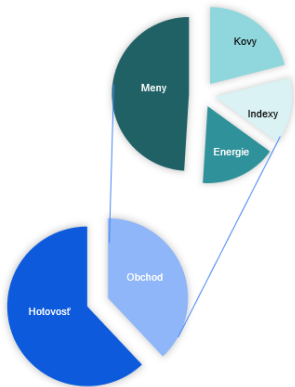
#### FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 9,04MM
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	+1,08%
Zhodnotenie od založenia fondu	122,59%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	16,12%
Počet obchodov za posl. mesiac	78
Max. drawdown from peak	2,27%
Sharpe ratio	0,88
Profit factor	1,48
Positive trades	78,6%

#### ALOKÁCIA VO FONDE



Naším cieľom je dlhodobá 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 august 2024 rast +1,08%. Vstupujeme do jesene, kde nás čaká niekoľko známych aj neznámych udalostí: prezidentské voľby v USA, znižovanie sadzieb centrálnymi bankami a smerovanie dolára. Vieme, že prezidentské voľby v USA budú mať v skutočnosti len málo dlhodobých vplyvov na menový trh. Napriek špekuláciám trhu o 50 bazických bodoch zníženia sadzby zo strany americkej centrálnej banky (Fed) v septembri, predpokladáme zníženie len o 25 bazických bodov. Napokon, aj keď sa dolárový index za posledných štrnásť dní mierne oslabil, stále sa nachádzame vo svete silného dolára. Na rozdiel od toho existujú aj niektoré neznáme udalosti: trajektória čínskeho rastu, abnormálne slabá likvidita vo všetkých segmentoch trhu vrátane menového trhu a geopolitický vývoj na Blízkom východe. Mnohí vďačia za zlepšenie vyhládok eurozóny zhodnocovaním jednotnej meny. Bohužiaľ, v ekonomickom prostredí nenastalo žiadne skutočné zlepšenie. V skutočnosti je za zhodnocovanie eura zodpovedný predovšetkým pokles výnosov amerických dlhopisov spojený s ustupujúcou infláciou a menovým uvoľňovaním zo strany Fedu.

#### 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%	3,02%	1,08%					13,53%