



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/>

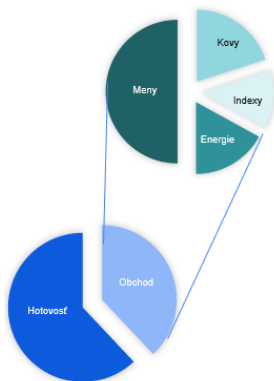
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 9,75MM
Mena fondu	EUR
Likvidita	Mesačne
Obdobie blokovania	Žiadne
Odporúčaná doba investovania	6+ mesiacov
High watermark	Áno
Manažment	Atlantis Capital CZ
Regulátor	ČNB, Praha
Broker	Vantage, I.B., Lmax
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

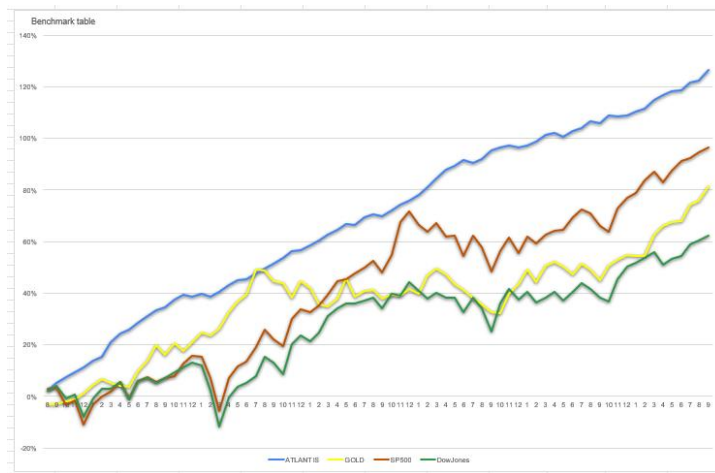
Zhodnotenie za posl. mesiac	+4,07%
Zhodnotenie od založenia fondu	126,66%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	20,89%
Počet obchodov za posl. mesiac	143
Max. drawdown from peak	2,39%
Sharpe ratio	0,89
Profit factor	2,44
Positive trades	87,7%

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

Mini- NASDAQ	-
SoyBean	-

KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac september 2024 rast +4,07%. Fond profitoval hlavne zo zavedenia nových modelov, ktoré mu pomohli lepším spôsobom vyhodnotiť správanie trhu. Tým pádom môžeme očakávať veľmi zaujímavé zhodnotenia v najbližšej budúcnosti. Volatilita na devízovom trhu zostáva obmedzená aj napriek blížiacim sa prezidentským voľbám v USA, obavám z recesie a veľmi slabým európskym údajom. Napriek tomu na trhu dochádza k určitým výkyvom. To bol prípad v septembri pre čínsky jún. Ešte vážnejšie a neočakávanejšie to bolo v prípade japonského jenu začiatkom augusta na pozadí anemických objemov. To ale nemusí platiť pre švajčiarsky frank, ktorý voči euru naďalej posilňuje. Nevylučujeme, že švajčiarska centrálna banka by mohla bez varovania zasiahnuť na trhu. Toto je veľké riziko, ktoré sa, žiaľ, úplne prehliada. Nemecký výrobný sektor je na najnižšej úrovni od globálnej blokády v marci 2020. Vo Francúzsku nie je situácia o nič lepšia. Efekt olympijských hier úplne zmizol. Čo teda spôsobilo zhodnotenie EUR/USD? Po septembrovom znížení sadzieb Fedu, investori teraz hľadajú lepšie výnosy ako tie, ktoré ponúka americký dlhopisový trh, a to najmä v prospech aktív v eurách. GBP/USD V dôsledku status quo menovej politiky, o ktorom rozhodla Centrálna Banka Anglicka v septembri, libra dosiahla svoju najvyššiu úroveň voči americkému doláru od marca 2022. Ako sa často stáva, rozdiel v menovej politike je silným motorom výmenného kurzu. To jednoznačne podporuje trvalé zhodnocovanie páru GBP/USD, ktoré bude pravdepodobne pokračovať počas veľkej časti budúceho roka.

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%	4,07%				17,60%