



Obchodné portfólio privátneho algoritmickeho 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 algoritmickej 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/>

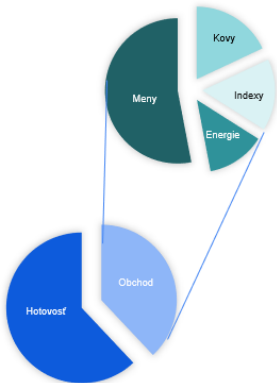
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 10,09MM
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	+0,43%
Zhodnotenie od založenia fondu	127,09%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	18,21%
Počet obchodov za posl. mesiac	104
Max. drawdown from peak	2,85%
Sharpe ratio	0,89
Profit factor	1,12
Positive trades	65,8%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

VÝKONNOSTNÝ GRAF



KOMENTÁR

JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmickej hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac október 2024 rast +0,43%. Kocka je hodená. Začína sa nová éra Trumpa. Nie je prekvapením, že Trumpove obchody sú v móde: 6. novembra zaznamenal dolár svoju najsilnejšiu rally od roku 2020, Euro sa prepadlo a Bitcoin dosiahol nové rekordy. Na obchodných parketoch sa šíria povesti: niektorí sa obávajú, že čínsky jüan bude znehodnotený v dôsledku narastajúceho protekcionizmu v USA, zatiaľ čo iní sa obávajú nárastu úrokových sadzieb z pôžičiek v USA kvôli rastúcemu deficitu, čo môže potenciálne ohroziť dominanciu dolára. Niet pochýb o tom, že Euro v nasledujúcich mesiacoch čaká ťažké obdobie. Jednotná mena už teraz trpí hospodárstvom na pokraji recesie a príliš reštriktívnu menovú politiku. K tomu sa dnes pridáva riziko obchodného sporu medzi USA a Európou, ktorý by s najväčšou pravdepodobnosťou vyústil do porážky Európy. V najbližších mesiacoch predpovedáme kurz EUR/USD na úrovni 1,05.

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

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%	4,07%	0,43%			18,03%