



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.atlanticapital.fund/>

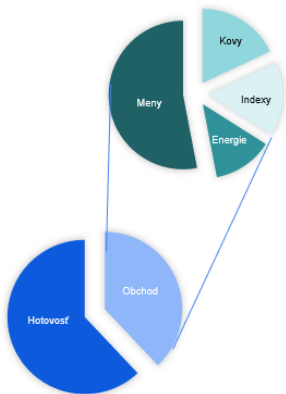
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 10,20MM
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	+1,15%
Zhodnotenie od založenia fondu	128,24%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	19,72%
Počet obchodov za posl. mesiac	94
Max. drawdown from peak	2,29%
Sharpe ratio	0,89
Profit factor	1,38
Positive trades	76,4%

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. Ľuboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac november 2024 rast +1,15%. Menové trhy sú v posledných dňoch veľmi volatilné. Juhokórejský won sa prepadol na dvojročné minimum voči doláru po zavedení stanného práva v Južnej Kórei. Čínsky juan pokračoval v pomalom poklese voči doláru (-5 % v priebehu dvoch mesiacov). Je to znak toho, že obchodná vojna bude mať dôsledky aj na menových trhoch. EUR/USD Finančná atraktivita USA sa zvyšuje v neprospech eurozóny. Na pozadí politického rizika odtekajú finančné prostriedky z európskych aktív, najmä francúzskych a sú presmerované do nákupov amerických aktív. Tento trend môže pokračovať aj v nasledujúcich mesiacoch. Nie je potrebné ďalej hľadať vysvetlenie nedávneho znehodnotenia eura. Myslíme si, že pokles páru na približne 1,0350 je zo strednodobého hľadiska dôveryhodný. EUR/GBP Podľa prognózy Spojené kráľovstvo zaznamená v budúcom roku najsilnejší rast v západnej Európe.

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%	1,15%		19,18%