



Newsletter December 2024

December 2024

▼ -0,96 %

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 stratégii 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 volatilite 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 pravidlach dynamicky sa meniaceho portfólia, ktoré sa neustále prispôsobuje trhovým podmienkam.

Zakladáme si na atraktívnom pomere výnosu voči riziku a stabilité.

Hedge fund

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac

- 0,96 %

Max. drawdown from peak

3,47 %

Zhodnotenie od založenia fondu

▲ +127,28 %

Sharpe ratio

0,81

Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov

▲ +18,22 %

Profit factor

0,55

Počet obchodov za posl. mesiac

108

Positive trades

60,3 %

HEDGE FUND

DECEMBER 2024



Trading result

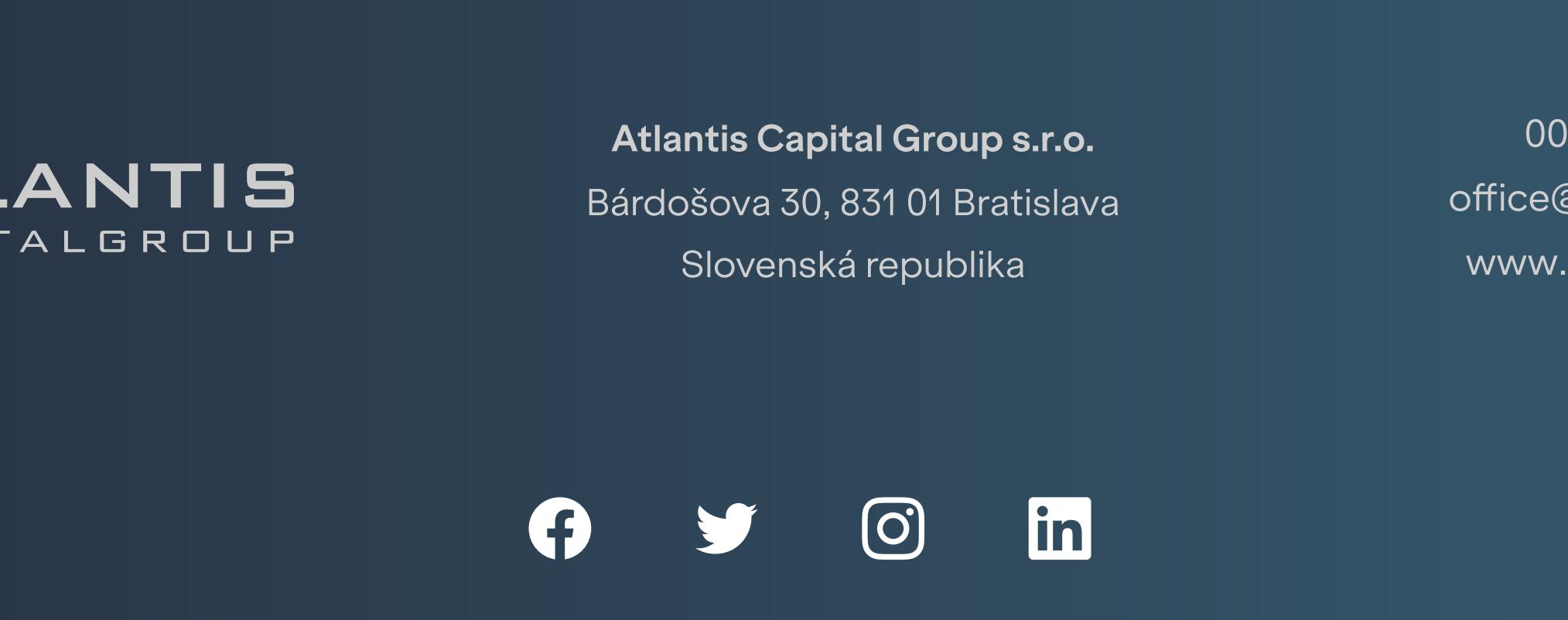
Rok	1.	2.	3.	4.	5.	6.	7.	8.	9.	10.	11.	12.	SUM
2018								2,26 %	2,96 %	2,04 %	1,90 %	1,93 %	11,10 %
2019	2,61 %	1,61 %	5,63 %	3,57 %	1,20 %	2,69 %	2,74 %	2,33 %	0,87 %	3,23 %	1,85 %	-0,61 %	27,72 %
2020	0,89 %	-1,19 %	2,11 %	2,31 %	1,91 %	0,54 %	2,13 %	1,86 %	1,97 %	2,28 %	1,73 %	1,49 %	18,03 %
2021	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 %	-0,96 %	18,22 %

Prinášame vám zaujímavosti z trhov na kapitálovom trhu

Pre americký dolár to bol vynikajúci začiatok roka. Americká mena sa tento rok rozbehla, podporovaná americkou ekonomickou hegemóniou. Čísla hovoria samy za seba. USA predstavujú len 4 % svetovej populácie, ale 25 % svetového HDP, 31 % svetového bohatstva domácností, 46 % celosvetových investícii do rizikového kapitálu, 65 % svetovej kapitalizácie akciového trhu a dokonca 75 % referenčného globálneho indexu: svetový index MSCI (55-ročné maximum). To všetko podporuje atraktivitu amerického dolára.

Zdá sa, že tento rok bude pre eurozónu ťažký. EUR/USD sa na začiatku mesiaca dostal na dvojročné minimum a krátkodobo by mohol ďalej klesať. Pre nikoho to nie je prekvapenie. Depreciácia eura je znakom neúprosného hospodárskeho a finančného dištančovania sa menovej únie od USA. Na druhej strane Atlantiku sa predpokladá, že rast prekročí svoj potenciál na úrovni približne 2 % v roku 2025 po dosiahnutí 2,5 % v roku 2024. Eurozóna tento rok porastie prinajlepšom o 1 %.

Veríme, že v pozitívnych číslach budeme pokračovať aj ďalej.



Atlantis Capital Group s.r.o.

Bárdóšova 30, 831 01 Bratislava

Slovenská republika

00 421 905 137 633

office@atlantiscapital.fund

www.atlantiscapital.fund



Copyright © 2025 ATLANTIS CAPITAL GROUP | All rights reserved