



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 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 pravidlách dynamicky sa meniaceho portfólia, ktoré sa neustále prispôbuje trhovým podmienkam. Pre viac detailov je možné sledovať náš aktuálny výstup: <https://www.atlantiscapital.fund/>

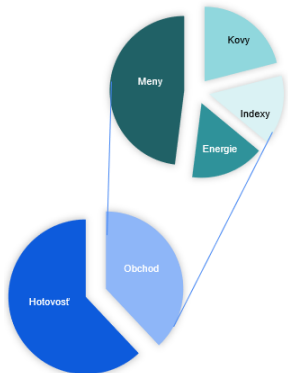
#### FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 10,53MM
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

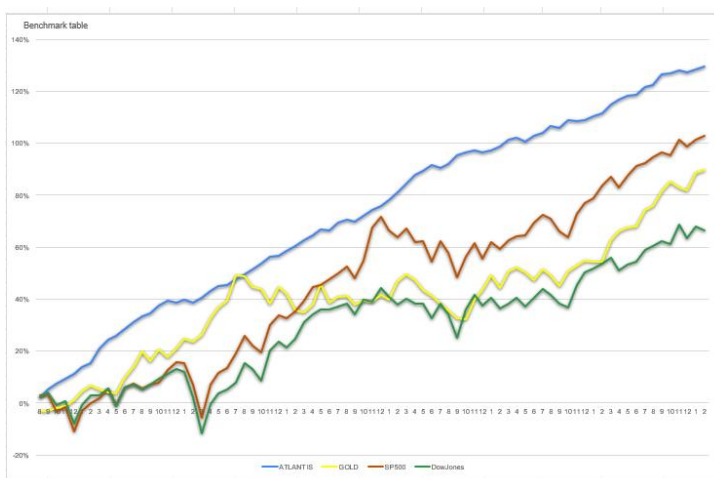
Zhodnotenie za posl. mesiac	+1,28%
Zhodnotenie od založenia fondu	129,66%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	18%
Počet obchodov za posl. mesiac	106
Max. drawdown from peak	2,41%
Sharpe ratio	0,76
Profit factor	1,47
Positive trades	79,1%

#### ALOKÁCIA VO FONDE



Naším cieľom je dlhodobou dosahovať výnosy nad trhovým priemerom a pri nízkej volatilite portfólia.

#### VÝKONNOSTNÝ GRAF



#### KOMENTÁR

JUDr. Luboš Žuffa  
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac február 2025 rast +1,28%. V priebehu mesiaca februára 2025 zažili akciové trhy zvýšenú volatilitu a neistotu. V Spojených štátoch inflácia spomalila menej, než sa očakávalo, čo vyvolalo obavy medzi investormi. Americký prezident Donald Trump zaviedol nové clá na dovoz ocele a hliníka z Kanady, Mexika a Číny, čo prispelo k poklesu akciových indexov. Index Dow Jones klesol o takmer 900 bodov (2,08 %), technologický Nasdaq Composite zaznamenal najhorší deň od septembra 2022 s poklesom o 4% na 17 468,33 bodu. Širší index S&P 500 klesol o 2,69 % na 5614,56 bodu, pričom sa počas obchodovania dostal na najnižšiu úroveň od septembra minulého roka. Tieto udalosti viedli k obavám z novej recesie, čo ešte viac zvýšilo tlak na akciové trhy. Okrem toho, podľa tzv. "pravidla dvadsiatky", ktoré sumarizuje súčet pomeru ceny akcií k ziskom (P/E) a inflácie, sa americké akcie javili ako nadhodnotené. Forward P/E indexu S&P 500 sa pohyboval okolo 22 a medziročná inflácia v januári dosiahla 3%, čo spolu dáva hodnotu 25, teda nad odporúčanou úroveň 20. Celkovo február 2025 priniesol na akciové trhy zvýšenú volatilitu, ovplyvnenú geopolitickými udalosťami a makroekonomickými faktormi, čo viedlo k opatrnosti investorov a poklesu hlavných akciových indexov.

#### 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%	1,15%	-0,96%	18,22%
2025	1,10%	1,28%											2,38%