

Newsletter Február 2025

Február 2025

▲ +1,28 %

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 prispôsobuje trhovým podmienkam.

Zakladáme si na atraktívnom pomere výnosu voči riziku a stabilite.

Hedge fund

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac

+ 1,28 %

Zhodnotenie od založenia fondu

▲ + 129,66 %

Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov

▲ + 18,00 %

Počet obchodov za posl. mesiac

106

Max. drawdown from peak

2,41 %

Sharpe ratio

0,76

Profit factor

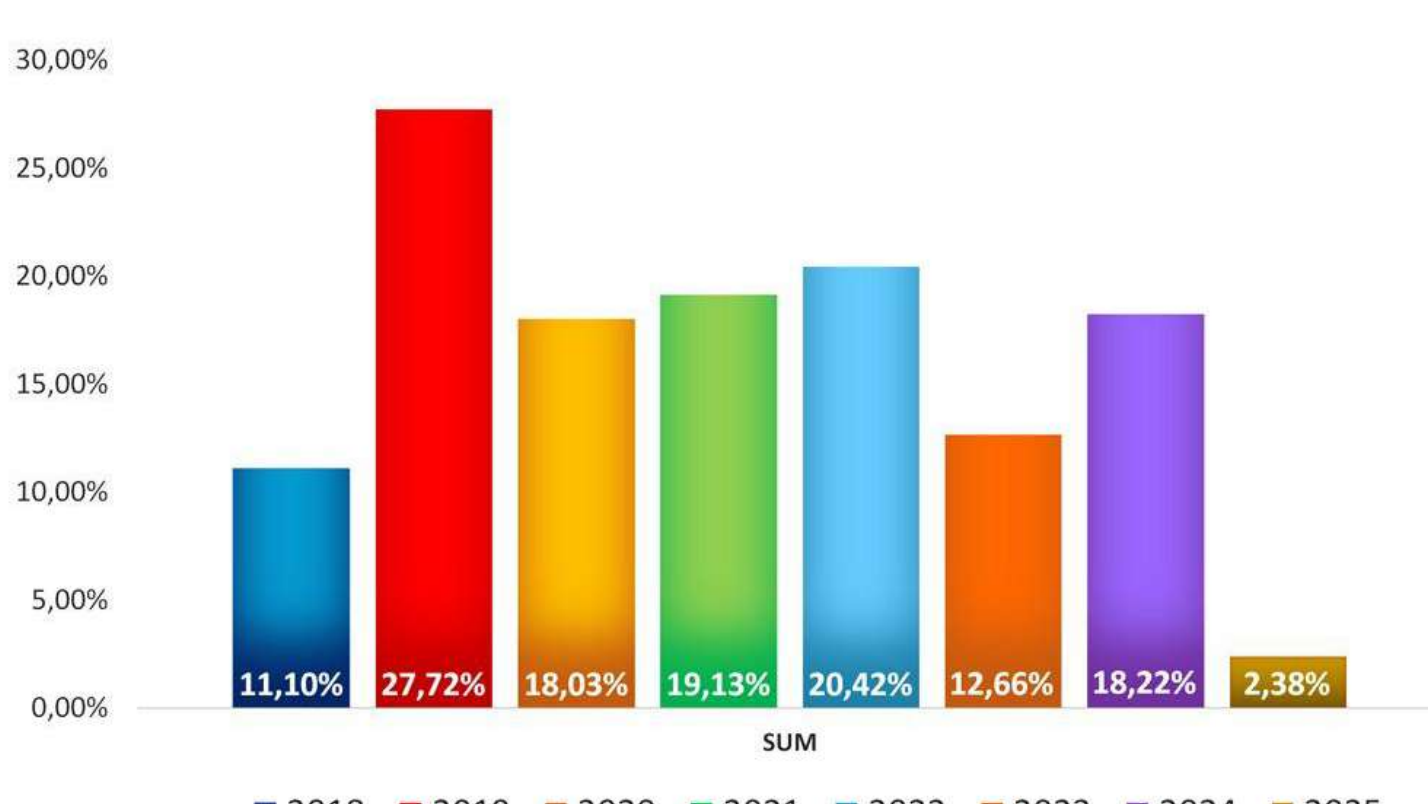
1,47

Positive trades

79,1 %

HEDGE FUND

FEBRUARY 2025



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 %
2025	1,10 %	1,28 %											2,38 %

Prinášame vám zaujímavosti z trhov na kapitálovom trhu

V posledných týždňoch akciové trhy zaznamenali zvýšenú volatilitu a poklesy, čo vyvoláva obavy medzi investormi. Americké akciové indexy, ako napríklad Dow Jones a S&P 500, oslabili v dôsledku zavedenia nových cieľ administratívou prezidenta Donalda Trumpa, čo zvýšilo obchodné napätie a neistotu na trhoch. Technologické spoločnosti, vrátane gigantov ako Alphabet, Microsoft a Amazon, zaznamenali poklesy cien akcií po zverejnení kvartálnych výsledkov, ktoré naznačili, že investície do umelej inteligencie sa zatiaľ neprejavili v očakávaných tržbách a ziskoch.

Na druhej strane, európske akciové trhy vykazujú relatívnu stabilitu a dokonca rast. Index EURO STOXX 50 prekonáva americký S&P 500 o 12 % v tomto roku. Tento trend môže byť spôsobený očakávaniami týkajúcimi sa podpory európskeho hospodárstva zo strany EÚ a jednotlivých členských štátov, ako aj možnou povojnovou obnovou Ukrajiny a poklesom cien energií, čo zlepšuje konkurencieschopnosť európskych podnikov. Napriek súčasnej volatilitě je dôležité uvedomiť si, že takéto výkyvy sú prirodzenou súčasťou finančných trhov. Z dlhodobého hľadiska sa akciové trhy zvyčajne zotavia a pokračujú v raste. Preto je odporúčané nepanikáriť a držať sa svojho investičného plánu.



Konateľ spoločnosti Atlantis Capital Group JUDr. Ľuboš Žuffa opäť vystúpi v relácii ta3 Investujeme už tento utorok 25.3.2025. Rozhovor s JUDr. Ľubošom Žuffom a záznam z relácie Vám prinesieme už v budúcom vydaní.

