

## ZÁKLADNÍ INFORMACE

**Manažer fondu:** AQA Capital Ltd.

**Doporučený investiční horizont:** 3 roky

**Banka fondu v ČR:** Česká spořitelna a.s.

**Vstupní poplatek:** max. 3 %

**Auditor:** Deloitte Audit Limited

**Výstupní poplatek:** 0 %

**Třída akcií A, B v měně:** EUR

**Manažerský poplatek:** 2 %

**Třída akcií C v měně:** CZK

**Minimální investice:** 1 mil. Kč nebo ekvív. v EUR

**ISIN:** MT7000027181, MT7000033387, MT7000033395

## INVESTIČNÍ STRATEGIE A CÍL FONDU

Algoritmické investování, které používá Rotpirk Algo fond, dává světu investic nový rozměr. Inovativní strategie spojující precizní analýzy s pokročilými algoritmy, které reagují na dynamiku trhu v reálném čase, v kombinaci se sofistikovanými matematickými modely, zaručují efektivitu investování.

Algoritmy sledují velké množství dat a obvyklé vazby mezi nimi. Když objeví odlišnost od rovnovážného stavu, otevřou strategii obchodující návrat k tomuto stavu. Fond tedy může profitovat z růstu i poklesu ceny obchodovaného instrumentu.

Průběh obchodování nevyžaduje aktivní zásah člověka, čímž nevstupují do investičního rozhodování emoce, které by ho mohly negativně ovlivnit.

Cílem fondu je přinášet stabilně dvouciferné roční výnosy s důrazem na minimalizaci volatility. Necílíme však na maximální výnos. Důležitá je pro nás stabilita a konzistentnost, tedy schopnost doručit klientům dvouciferný výnos každý rok bez ohledu na to, co se děje v ekonomice a na trzích.

## VÝVOJ HODNOTY INVESTIČNÍ AKCIE FONDU OD JEHO SPUŠTĚNÍ

### ZÁKLADNÍ STATISTIKA k 31.12.2023

**Hodnota investiční akcie třídy A:** 145,22

**Hodnota investiční akcie třídy B:** 100

**Hodnota investiční akcie třídy C:** 100

### VÝKONNOST TŘÍDY AKCIÍ A

**Rok 2023** 15,49 %

**Od založení** 45,22 %

**Roční průměr** 13,24 % p.a.



## PŘEHLED INSTRUMENTŮ, DO KTERÝCH FOND INVESTUJE

- **Měny:** CAD, AUD, JPY, USD, EUR, GBP, CHF
- **Dluhopisy:** americký 2, 5, 10, 30letý státní dluhopis, evropské dluhopisy
- **Drahé kovy:** zlato, stříbro, platina, paladium
- **Indexy:** S&P 500, Dow Jones, Nikkei, TOPIX, VIX
- **Komodity:** ropa, plyn, měď, pšenice, sója, maso

## KOMENTÁŘ PORTFOLIO MANAŽERA K VÝSLEDKŮM FONDU

V portfoliu využíváme čtyři typy strategií, z nichž dvě jsou trendové a dvě beztrendové (tzn. nezávislé na vývoji hodnoty podkladového instrumentu). Jednotlivé strategie jsou v portfoliu vyváženy tak, aby se navzájem zajišťovaly a v součtu dosahovaly zisku za všech okolností, tedy i v situacích, kdy některé trhy jsou v rostoucím trendu a jiné korigují.

Kombinací čtyř typů strategií s více než 40ti obchodovanými instrumenty v loňském roce vzniklo portfolio více než 70ti aktivních algoritmů. Ty realizovaly během roku 2023 celkem 1.851 investic. V průměru to bylo 154 investic měsíčně, 36 týdně, 7 denně.

V rámci pravidelných revizí a v návaznosti na vývoj nových strategií byly během roku přidávány do portfolia nové algoritmy a upravováno nastavení těch, které negenerovaly očekávané výsledky. Každou takovou revizí docházelo ke zvyšování robustnosti a stability celého portfolia a tím i k lepším dosaženým výsledkům.

K výsledkům fondu v roce 2023 nejvíce přispěly strategie vázané na australský dolar, energie, index volatility VIX nebo měď.

Právě měď je dobrým příkladem nezávislosti Rotpirk algoritmů na růstu trhu. Cena mědi na trzích v 1. pololetí roku klesala a ve 2. pololetí stagnovala. Algoritmus přitom otevřel v obou pololetích prakticky stejný počet obchodů a rovněž ziskovost byla velmi podobná. Vývoj ceny mědi tedy na výsledky fondu a ziskovost strategie neměl vliv. Obdobně si vedly i další beztrendové strategie ve fondu.



Největší silou fondu a hlavním důvodem opakovaně výborných výsledků je robustnost portfolia a široká diverzifikace napříč strategiemi a obchodovanými instrumenty. Zodpovědnost za peníze našich investorů je jednou z nejsilnějších motivací k výsledkům, kterých dosahujeme. Na vývoji algoritmů pracuje tým Rotpirku ve spolupráci se zástupci několika českých univerzit. Dnes už nedílnou součástí vývojového procesu je také zapojení umělé inteligence.

### Prohlášení o odpovědnosti:

Tento materiál slouží výlučně k informačním a propagačním účelům, nepředstavuje žádnou nabídku, doporučení ani výzvu k investování. Rotpirk Algo Fund je fondem kvalifikovaných investorů, které jsou určeny pro fyzické a právnické osoby, které mají zájem investovat finanční prostředky v souladu s investičním cílem a investiční politikou fondu a jsou kvalifikovanými investory v souladu s § 272 zákona č. 240/2013 Sb., tj. mají zkušenost s investováním do investičních nástrojů a jsou si vědomi rizik s tím spojených. Informace uvedené v tomto marketingovém materiálu jsou jen všeobecného charakteru a nezohledňují investiční rizika, která mohou vést k poklesu hodnoty investice a kapitálové ztrátě. Doporučujeme před investicí nastudovat statut fondu, který naleznete na <https://www.aqa-capital.com/asset-management-services/alternative-funds/mdc-rotpirk-algo-fund/> Tiskové chyby vyhrazeny. Zdanění fondu stanovuje zákon, při změně zákona může být zdanění fondu upraveno.