

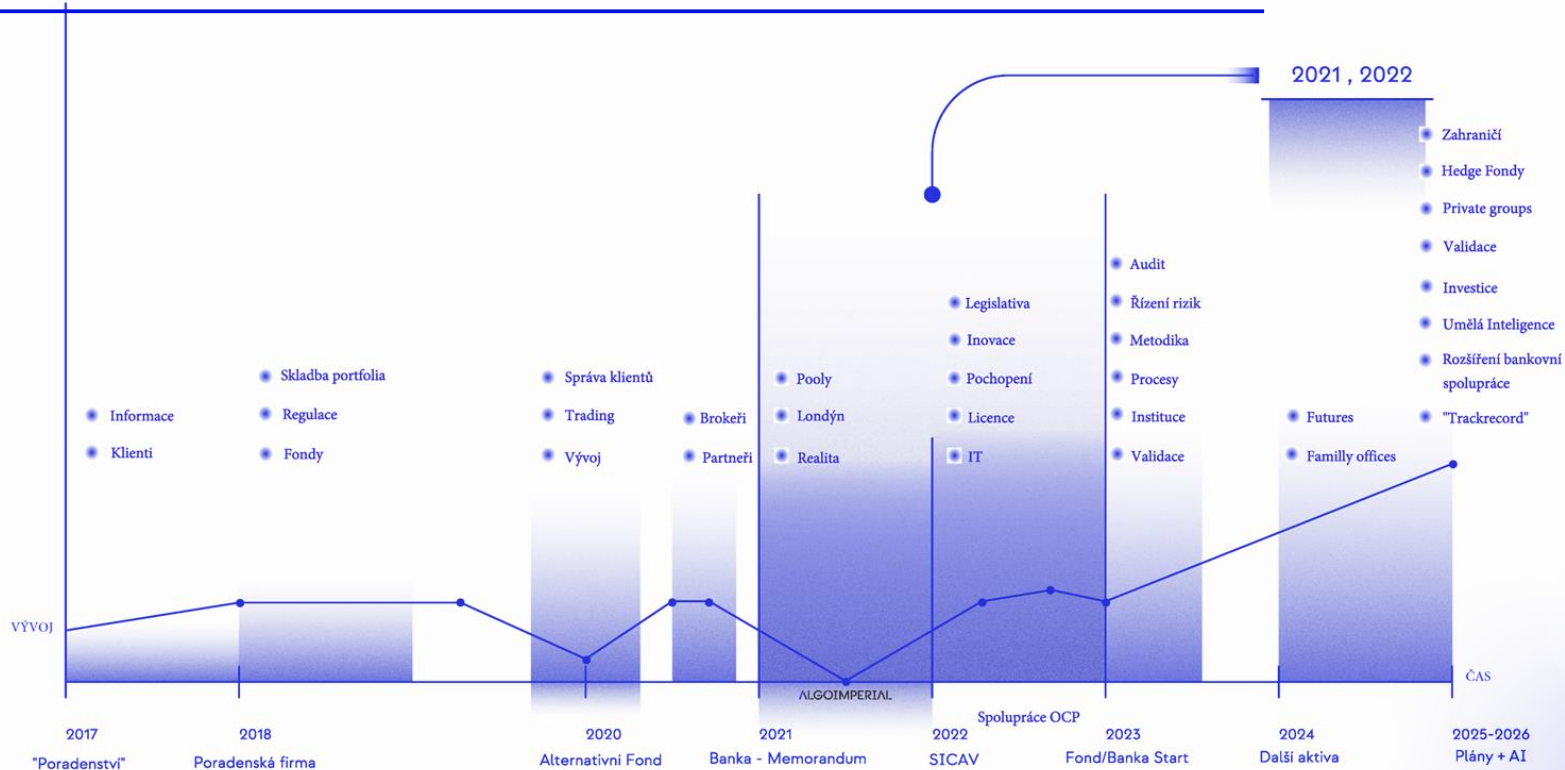
---

## Algotrading private securities fund

May 2023

A decorative blue abstract shape, resembling a stylized wave or a series of overlapping circles, is located in the bottom right corner of the slide.

## Představení



## Filosofie

---

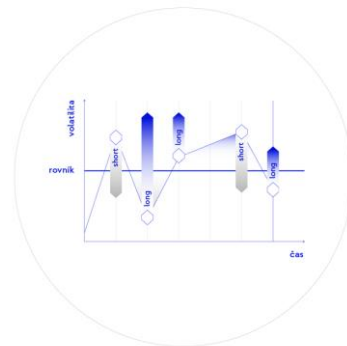
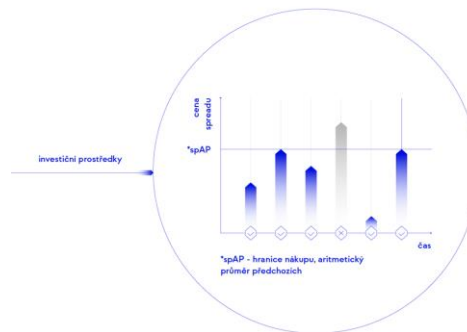


Nezáleží na tom, zda je trh nahore  
či dole. Vše co obchodníci potřebují,  
je volatilita.

- Automatizace
  - Rychlost, přesnost
  - Minimalizace chyb
  - Bezpečná správa kapitálu
- Myšlenka přítomného okamžiku
  - Odolnost vůči nepředvídatelným událostem
  - „Nepredikuji ale počítám“

## Základní funkce

- Důsledná práce s plovoucí ztrátou
  - Řízená expozice investovaného kapitálu
- Řízení nákladů- „Spready“
  - „Nenakupuji za draho“
- Pravidla kooperativnosti
  - Koordinace a vyhodnocení všech obchodů navzájem



---

Rizika

A decorative blue abstract shape, resembling a stylized wave or a series of overlapping circles, is located in the bottom right corner of the slide.

## Rizika a Mitigace

---

- Data a jejich rozličnost
  - Kvalita dat z reálného trhu
  - Rychlost přesnost obchodů
- Technické zázemí
  - Interní a externí infrastruktura
- Rizika „tady a teď“
  - Externí vlivy – platforma, servery, trh
- Kontinuita
  - Automatizace procesů
  - Aktualizace, Integrace data, ochrana dat
- Zpracování dat
  - Výběr správného partner: liquidity pools – SAXO Bank A/S, Londýn
  - Používaný software, hardware a jeho umístění
- Zabezpečení „mezi židlí a počítačem“
  - Interní zabezpečení
  - Datacentrum
  - Cyber security/ZKB
  - ISO27001
- Algoritmus – kód
  - Testování
  - Validace
  - schválení

---

## Cenné papíry a jejich parametrizace



# Distribuce výnosů pro klienty – cenné papíry

- High Water Mark
- Hedge Funds

---

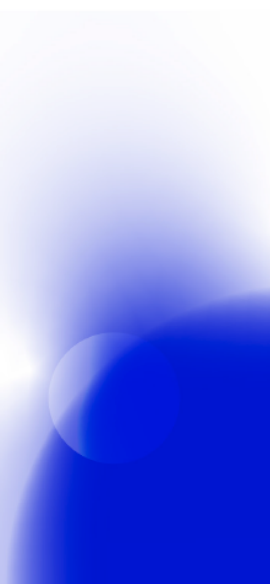
## High Water Mark

Tento mechanismus zabezpečuje, že pokud by klesla hodnota PIA, Výnos se v tento okamžik distribuuje ze 100% pouze do kategorií PIA. Jinými slovy společnost nemá nárok na podíl ze zisku a distribuci tohoto výnosu do ZIA, pokud by hodnota investice klienta klesla pod poslední maximum.

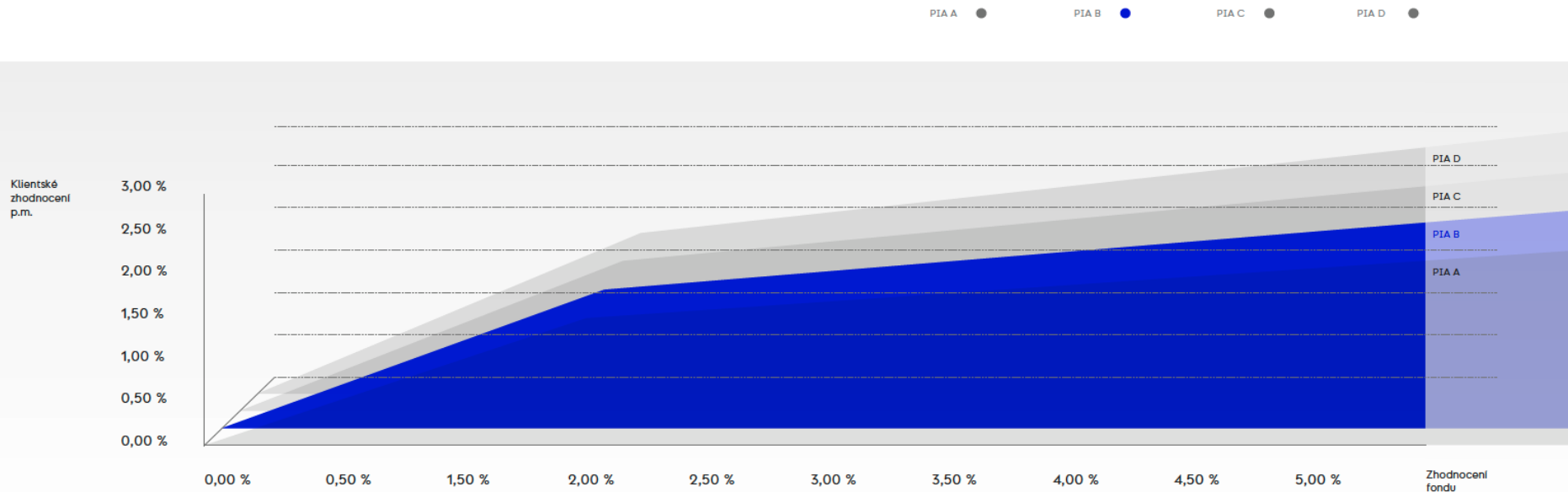
---

## Hedge Funds

Fond se s klienty dělí dle předem definovaných podmínek o zisk, čímž si nárokuje pouze performance fee. Žádná další fee si fond neúčtuje.



Graf: Příklad podílu klienta na zisku při různém měsíčním % čistém zhodnocení fondu.



---

## Náš Tým



**David Jedlička**

Head of Corporate sales

Vyhledávání a strategické jednání s korporacemi a institucemi.



**Michal Motl**

Head of retail sales

Vytváření, vzdělávání a řízení obchodních skupin za účelem stabilní a pravidelné akvizice do společnosti.



**Richard Holánek** Founder,

Head of Algo

Vývoj a řízení unifikovaných obchodních automatických strategií pro obchodování na finančních trzích.



**Ondřej Trčka**

Founder, CFO, Head of Risks

Řízení finančních zdrojů, předvídání a minimalizování rizika, zajišťování souladu s právními a compliance požadavky.



**Daniel Ismail**

Co-Founder, CEO

Plánování funkce společnosti v souladu se záměry a vizemi zadanými vlastníky organizace.



**Libor Stoklásek**

Head of Analytics

Vyhodnocování a sledování makroekonomické situace a fundamentů (globální rizika).



**Marek Pšenica**

Business relationships manager

Akvizice externích privátních obchodních partnerů a jejich dlouhodobá správa.

---

## Partneři



ALGOIMPERIAL



ALGOIMPERIAL



„Úspěch by měl být založen na partnerství,  
nikoliv partnerství na úspěchu“

ALGOIMPERIAL

Těšíme se na spolupráci.