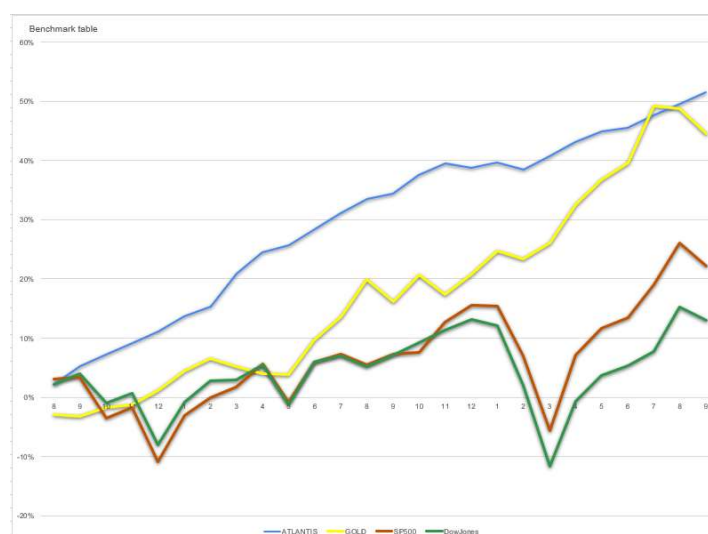


Obchodné portfólio privátneho algoritmického hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou 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	€ 4.15 MM
Mena fondu	EUR
Likvidita	Mesačne
Obdobie blokovania	Žiadne
Odporúčaná doba investovania	6+ mesiacov
High watermark	Áno
Manažment	Atlantis Capital CZ
Regulátor	ČNB, Praha
Broker	LMAX, GAIN
Správčový poplatok	0,1% monthly
Vstupný poplatok	1,75%
Success fee	25%
Výstupný poplatok	0%
Cieľ ročného výnosu	15% - 25% p.a.
Stratégia	Alghos

VÝKONNOSTNÝ GRAF



LIST OBCHODNÝCH INSTRUMENTOV

INDEXI

DAX	↓
Dow Jones	↓
NASDAQ 100	↓
S&P 500	↓
EU STOXX 50	↓
FTSE 100	↓
Russel 2000	↓
Nikkei 225	↑

ENERGIE

Natural Gas	↓
Brent Oil	↓
Crude Oil	↓

KOVY

Platinum	↓
Gold	↓
Palladium	↑
Silver	↓

MENY

Australian dollar	↓
British pound	↓
Japanese yen	↓
Canadian dollar	↑
US dollar Index	↑

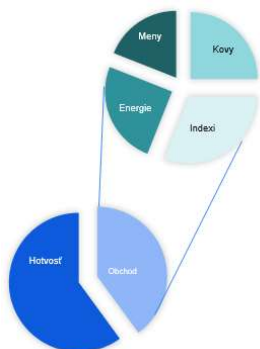
OSTATNÉ

Heating Oil	-
Corn	-

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	+1,97%
Zhodnotenie od založenia fondu	+51,47%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+17,00%
Počet obchodov za posl. mesiac	87
Max. drawdown from peak	-4,53%
Ročná volatilita	4,77%
Sharpe ratio	0,73
Profit factor	2,25
Positive trades	79,93%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac september 2020 rast +1,97%. Práca odiaľkoľvek a mimoriadne nízke úrokové sadzby hypoték viedli k tomu, že Američania kupujú všetky existujúce domy, ktoré sú na predaj, čo spôsobilo, že v priebehu niekoľkých mesiacov sme prešli od žiadnej výstavby a žiadneho predaja k náhle nenásytnému dopytu, ktorý sa zmenil zo „spiacieho“ trhu na „prskajúci“ trh. Jednotná európska mena sa niekoľko týždňov pohybovala vo veľmi úzkom rozmedzí od 1,18 do 1,19. Najväčší zisk za euro v septembri bol proti libru. Aj napriek tomu, že primárnym záujmom zostal COVID-19, vyhladky na tvrdý Brexit začali znova znepokojsvať hráčov na trhu, čo viedlo k prudkému poklesu britskej meny. Ďalším termínom, ktorý je potrebné v tejto chúlостivej situácii pozorne sledovať, je 15. október, májky termín stanovený vládou Spojeného kráľovstva na dosiahnutie predbežnej dohody. Všetky náznaky poukazujú na nepravdepodobnosť, že bude tento termín dodržaný. Napokon, neistota ohľadom ďalších krokov v oblasti menovej politiky Spojeného kráľovstva a váhavé zváženie negatívnych sadzieb zo strany Bank of England neboli upokojujúce. Druhá najhoršia mesačná výkonnosť eura bola v porovnaní s japonským jenom (JPY). Japonská mena je obzvlášť citlivá na akýkoľvek nárast averzie k riziku. Posledné týždne sa vyznačovali akumuláciou rizikových faktorov: Brexit, americké prezidentské voľby, ktoré je možné napadnúť, hospodárske oživenie, ktoré stráca na obrátkach, a predovšetkým druhá vlna Covid-19 v Európe. Pokles švajčiarskeho franku (CHF) bol kompenzovaný intervenciou švajčiarskej centrálnej banky, dá sa očakávať, že bude rásť minimálne do prezidentských volieb v USA. Hodnotu eura voči austrálskemu doláru posilnila perspektíva ďalších opatrení, ktoré má prijať Austrálska rezervná banka (RBA). Pre RBA sú k dispozícii štyri možnosti: negatívne sadzby, priame intervencie do devíz (napríklad v podobnom duchu ako SNB), rozšírenie programu nákupu aktív (označovaný tiež ako QE) alebo kvantitatívne uvoľňovanie) alebo iné kľúčové zníženie sadzby. Nemecká nezamestnanosť klesla v septembri o 108 000, čím sa znížil počet nezamestnaných na 2 847 miliónov - čo je najnižšia úroveň od mája tohto roku. Ide vlastne o najlepší septembrový výkon od roku 2012, čo naznačuje, že negatívny dopad krízy Covid-19 postupne slabne.

VÝSLEDKY OBCHODOVANIA

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%				12,53%