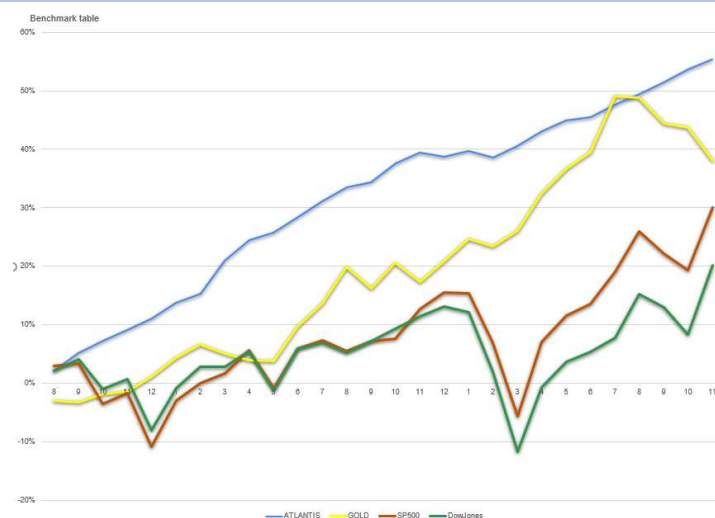


Obchodné portfólio privátneho algoritmickeho hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou automatických obchodných stratégií založených na systematickom a algoritmickej 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	€ 4.31 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	↓

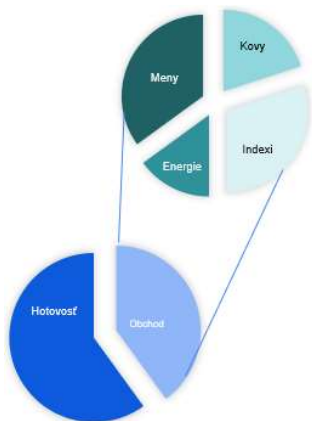
OSTATNÉ

Lean Hogs	-
Corn	-

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	+1,73%
Zhodnotenie od založenia fondu	+55,36%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+15,93%
Počet obchodov za posl. mesiac	94
Max. drawdown from peak	-4,29%
Sharpe ratio	0,70
Profit factor	2,08
Positive trades	79,89%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmickej hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac november 2020 rast +1,73%. Novembrová zvýšená miera ochoty riskovať vysvetľuje rast eura, ktoré sa tento týždeň vyšplhalo na psychologickú hranicu 1,20. Je však potrebné udržiavať opatrnosť, pretože ECB opakovane uviedla, že pozorne sleduje zmeny kurzu EUR / USD. To znamená, že to neumožní nadmerné zvýšenie jednotnej meny, ktoré by mohlo poškodiť oživenie európskeho hospodárstva. Účastníci devízového trhu preukázali značnú nerozhodnosť v dôsledku neistoty súvisiacej s brexitom. Nový kľúčový termín sa posunul na 10. decembra, čo je dátum posledného zasadnutia Európskej rady v roku, ktoré by malo predovšetkým vyvolať otázky týkajúce sa obchodných vzťahov medzi EÚ a Spojeným kráľovstvom po brexite. Aj keď viditeľnosť brexitu zostáva minimálna, už bolo zrejmé, že Spojené kráľovstvo bude jednou z rozvinutých ekonomík, ktoré budú pandémie najviac zasiahnuté. Zároveň v novembri došlo k silným výkyvom aj u menového páru euro-jen (EUR / JPY). Veľkú časť tejto volatility vysvetľujú americké prezidentské voľby, obnovenie opatrení lock down v mnohých krajinách a oznámenia o viacerých vakcínach. Pokiaľ ide o menovú politiku od začiatku pandémie centrálna banka nakúpila 75% všetkého japonského štátneho dlhu, čo je svetový rekord. Ekonomika Japonska zostáva vo fáze oživenia a očakáva sa, že HDP sa v priebehu fiškálneho roka do marca 2021 zníži o 5,5%. Euro sa v novembri opäť dostalo k švajčiarskemu franku, predovšetkým vďaka zlepšenému ekonomickému výhľadu na rok 2021 po podpore Covidu -19 oznámení o vakcínach. Kanadský dolár naďalej podporuje veľmi silné oživenie komodít, najmä pokiaľ ide o energetiku, čo odráža optimistické očakávania investorov, pokiaľ ide o vyhladky na rast v roku 2021. Odhaduje sa, že do konca roka bude Bank of Canada držať takmer 56% celkových štátnych dlhopisov krajiny, čo zabezpečí návrat k rastu v budúcom roku. Euro v novembri voči austrálskemu doláru pokleslo o 2,64%. Rast austrálskej meny možno vysvetliť očakávaniami, že Austrália by mala byť do budúceho roka hlavným príjemcom oživenia čínskej ekonomiky a zároveň austrálska centrálna banka (RBA) veľmi jasne uviedla, že opäť zvýši svoje stimulačné opatrenia pre ekonomiku krajiny. Pokiaľ ide o pár EUR / CNH, mesiac november bol synonymom miernej fázy zhodnocovania v prospech eura (+ 0,86%). Očakáva sa, že Čína bude v tomto roku jedinou významnou ekonomikou, ktorá zažije pozitívny rast.

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%	2,28%	1,73%		16,54%