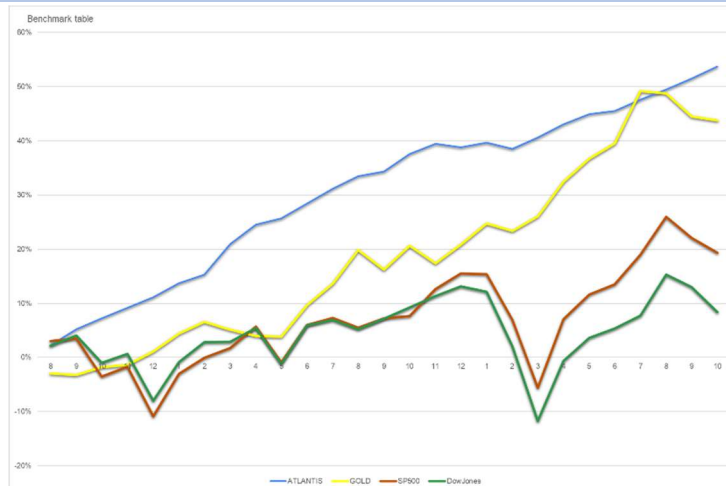


Obchodné portfólio privátneho algoritmickeho hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou 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 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 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	€ 4.24 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	↑

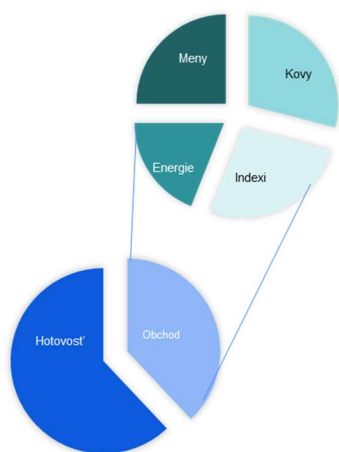
OSTATNÉ

SoyBean	-
MiniDJ	-

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	+2,28%
Zhodnotenie od založenia fondu	+53,63%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+16,05%
Počet obchodov za posl. mesiac	102
Max. drawdown from peak	-4,16%
Sharpe ratio	0,75
Profit factor	2,73
Positive trades	83,23%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmickej hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac október 2020 rast +2,28%. Nárast prípadov COVID-19 a s tým spojené zintenzívnenie opatrení na zabránenie šírenia vírusu predstavuje zjavné zhoršenie krátkodobého výhľadu. Zatiaľ čo sa aktivita vo výrobnom sektore v skutočnosti naďalej zotavovala, v sektore služieb sa viditeľne spomaľovala. Rozhodnutia Federálneho rezervného systému a tlak na fiškálnu pomoc na zmiernenie pandemickej situácie ovplyvnia FX viac ako americké volebné výsledky. Ak sa rýchlo nedosiahne kongresová dohoda o stimulačnom balíku, intervencia centrálnej banky s cieľom podporiť hospodárske oživenie zabezpečením čo najdostupnejších úverových podmienok sa zdá viac ako pravdepodobná. Devízové toky klesli v súlade s riadením pandémie: meny, v ktorých bol vírus obsiahnutý, dosiahli lepšie výsledky ako tendre väčších ľudnatých krajín. Otrasy spôsobené americkými prezidentskými voľbami mali menší vplyv na pár EUR / USD, ako sa predpokladalo. Pokiaľ ide o ceny, devízový trh sa už zohľadnil v prípade sporných volieb. Aj keď výsledná právna bitka medzi republikánmi a demokratmi bude ešte nejaký čas pokračovať, zdá sa, že vývojový scenár, v ktorom je Biden v Bielom dome a v Kongrese rozdelený, priaznivo reagoval na účastníkov trhu, čo vysvetľuje ochotu pozorovať riziká zaznamenané v minulosti. ECB jasne naznačila, že v tom čase sa prijímajú opatrenia a že je možné použiť všetky potenciálne nástroje na zmiernenie hospodárskeho poklesu... Rovnako ako pred mesiacom zostáva otázka kvót jedným z hlavných problémov. V tejto fáze sa zdá byť intervenčná politika ako jediným prostriedkom na prekonanie tohto veľkého kameňa úrazu medzi Londýnom a Parížom. Budeme si musieť počkať do budúceho zasadnutia Európskej rady 19. novembra, aby sme zistili, či nemecká kancelárka Angela Merkelová a francúzsky prezident Emmanuel Macron dokážu zabezpečiť v tejto veci nejaké ústupky. To znamená, že aj keď dôjde k dohode, rok 2021 bude pre ekonomiku Spojeného kráľovstva náročným rokom, čo by mohlo viesť k opätovnej volatilitě páru EUR / GBP. Podľa najnovších predpovedí Bank of England by tohtoročná recesia mala predstavovať zhruba -11%, zatiaľ čo budúcoročný ekonomický rast by mal dosiahnuť približne + 7,25% (oproti pôvodnému odhadu + 9%). Za mesiac október nastala v páre EUR / AUD veľká volatilita, čo sa dá vysvetliť prekvapivým rozhodnutím Reserve Bank of Australia (RBA) znížiť jej úrokovú sadzbu na historicky nízku úroveň. Kým v januári bola sadzba na úrovni 0,75%, v súčasnosti sa znížila na 0,10%. Cieľom tohto poklesu úroveňnej sadzby je stimulovať austrálsku ekonomiku v stagnácii kvôli niektorým prísny opatreniam pred šírením koronavírusu.

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%			14,81%