

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 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/>

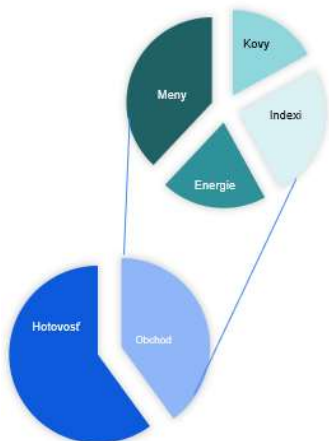
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 4.37 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	ACY, LCG, 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

ŠTATISTIKY FONDU

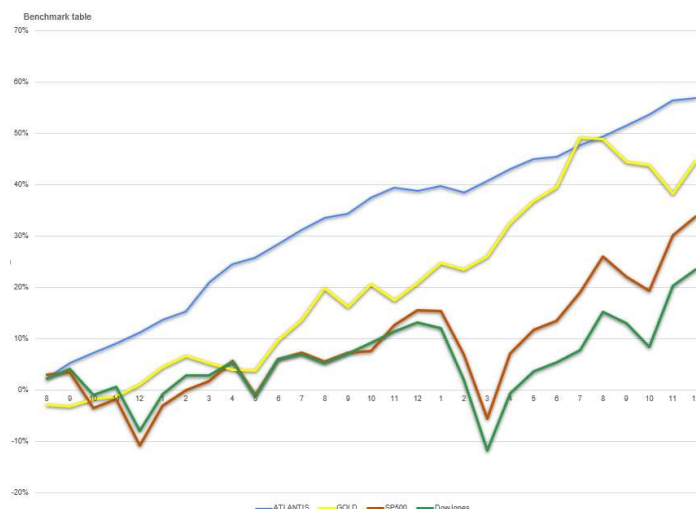
Zhodnotenie za posl. mesiac	+1,49%
Zhodnotenie od založenia fondu	+56,85%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+18,03%
Počet obchodov za posl. mesiac	72
Max. drawdown from peak	-3,70%
Sharpe ratio	0,79
Profit factor	2,15
Positive trades	82,03%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

VÝKONNOSTNÝ GRAF



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

KOMENTÁR

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac december 2020 rast +1,49%. Na devízovom trhu je pre Euro priaznivý poklesový pohyb amerického dolára, ktorý sa začal pred niekoľkými mesiacmi. Jednotná mena zaznamenala v decembri solídnu výkonnosť v mesačných obmenách. Je to spôsobené aj hromadením dobrých správ na strane centrálnych bánk a fiškálnymi stimulmi na podporu nezamestnaných ľudí a tiež prostredkom vo výške 48 miliárd dolárov, ktoré sa majú použiť na nákup nových vakcín. Vývoj páru EUR / GBP väčšinu decembra bol založený na základe zvrátov v rokovaniach medzi EÚ a Spojeným kráľovstvom. Rokovaniami nakoniec došlo k dohode na poslednú chvíľu. Budú však naďalej pokračovať rokovania medzi oboma stranami, najmä o zložke finančných služieb, ktorá predstavuje takmer 7% britskej ekonomiky. Ochota podstupovať riziko pokračovala aj v decembri v prospech EUR / JPY. Pokiaľ ide o centrálnu banku, je potrebné poznamenať, že Bank of Japan sa minulý mesiac rozhodla predĺžiť svoj program podpory podnikových financií zo šiestich mesiacov do konca septembra 2021. Malú odchýlku v decembri zaznamenal pár EUR / CHF (-0,41%). Napriek rozhodnutiu štátnej pokladnice USA zaradiť krajinu do zoznamu, ktorá manipuluje so svojou menou, Švajčiarska národná banka potvrdila svoj úmysel pokračovať v intervenciách do výmenných kurzov s cieľom obmedziť ocenenie Švajčiarskeho franku (CHF) a pokračovať v ultrakomodáčnej menovej politike s cieľom podpory ekonomiky. Rast kanadského dolára na devízovom trhu, oveľa väčší oproti americkému doláru (USD) ako voči jednotnej európskej mene, je podľa národnej centrálnej banky (BoC) pre kanadskú ekonomiku teraz problémom. BoC varovala pred niekoľkými týždňami pred rizikami kolapsu ekonomickej aktivity v Kanade v prvom štvrtroku 2021 v dôsledku rozmachu prípadov COVID a sily kanadského dolára (CAD). K tomu sa pridáva skutočnosť, že oživenie ekonomiky je v súčasnosti poháňané iba domácou spotrebou, zatiaľ čo vývoz a obchodné investície prebiehajú len na polovicu. Zároveň sme zaznamenali veľmi vysokú volatilitu párov EUR / AUD v decembri, v rozmedzí fluktuácií takmer 400 bodov. Austrálsky dolár (AUD) ťažil z pokračujúceho rastu cien železnej rudy, jedného z hlavných austrálskych vývozov, a z hospodárskeho oživenia v Číne, ktoré sa tiež šíri po celej krajine. Malo by sa pamätať na to, že Čína je hlavným obchodným partnerom Austrálie a predstavuje 39,4% vývozu tovaru a 17,6% vývozu služieb. Dosiahnuté zhodnotenie eura (EUR) voči zahraničnému júanu (CNH) v decembri bolo spôsobené najmä verejnými investíciami a návratom súkromných investícií, najmä do telekomunikačných, finančných služieb a dopravy.

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%	1,49%	18,03%

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

MiniDJ	-
SoyBean	-