

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/>

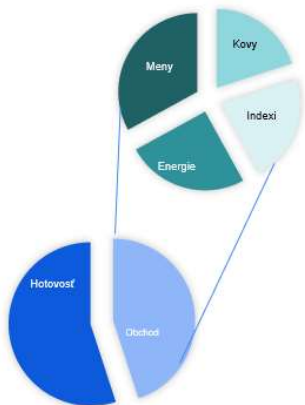
#### FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 4.13 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	+1,57%
Zhodnotenie od založenia fondu	+58,42%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+18,71%
Počet obchodov za posl. mesiac	103
Max. drawdown from peak	-3,58%
Sharpe ratio	0,81
Profit factor	2,17
Positive trades	83,12%

#### 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 algoritmickej hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac január 2021 rast +1,57%. Menový pár EUR / USD zaznamenal tento mesiac pokles, keď sa európska ekonomika snažila vyrovnat s ďalšími prísnymi blokovaniami v dôsledku nového variantu Covid-19. Aj keď ECB na svojom poslednom stretnutí stála za predošlou predikciou rastu na úrovni 3,9% na rok 2021, mnoho analytikov sa teraz domnieva, že toto číslo je na optimistickej strane. Zdá sa čoraz pravdepodobnejšie, že konsenzus bol ku koncu roka 2020 je príliš optimistický, pokiaľ ide o pravdepodobnosť hospodárskeho oživenia v roku 2021. Na druhej strane, aj keď USA v súvislosti s pandemiou stále zápasia so zložitou situáciou, mali by ťažiť z masívneho balíka fiškálnych stimulov vo výške 1,9 bilióna dolárov (USD). Pokiaľ ide o menovú politiku, Bank of England sa má stretnúť 4. februára, avšak trh s výmennými kurzmi neočakáva žiadne zmeny. Inými slovami, očakáva sa, že základná sadzba sa bude udržiavať na 0,10% a ďalšie kvantitatívne uvoľňovanie vo výške 875 miliárd GBP. Za posledný mesiac sme zaznamenali 250-bodovú fluktuáciu v páre EUR / JPY. Berieme na vedomie ostré varovanie zo strany japonskej bankovej lobby, ktorá vyzýva Japonskú banku, aby ďalej neznižovala negatívne úrokové sadzby, pretože sa obáva, že by to nemohlo ohroziť ziskovosť celého odvetvia. Dvojica EUR / CHF sa naďalej pohybuje okolo hranice 1,07-1,08, bez toho, aby centrálna banka musela podniknúť akékoľvek pozoruhodné kroky na menovom trhu. Absencia akýchkoľvek väčších geopolitických rizík, aj napriek poklesu pandémie v celej eurozóne, je jedným z dôvodov stability tejto dvojice. Prudký pokles páru EUR / CAD v posledných týždňoch je spôsobený dvojitým tempom pokračujúceho rastu cien ropy v priebehu januára (+8% pre Brent a WTI v priebehu mesiaca), z ktorého zvyčajne profituje kanadský dolár, plus prekážky týkajúce sa pandémie a európskeho očkovacieho programu. Pokiaľ ide o menovú politiku, Bank of Canada udržiavala svoju základnú sadzbu na 0,25% a pokračovala v kvantitatívnom uvoľňovaní tempom 4 miliardy USD (CAD) týždenne. Veľkým prevkapaním tohto februára je Austrália, ktorej centrálna banka sa rozhodla rozšíriť svoj program kvantitatívneho uvoľňovania, akonáhle sa súčasné kolo v apríli skončí a bude pokračovať, možno až do roku 2024. Nie je pochyb o tom, že eurozóna vstúpila do novej recesie, čínska ekonomika sa naďalej zotavuje, v minulom roku vzrástla o 2,3% a optimisti predpokladajú v tomto roku možných 8%.

#### 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	-
Heating Oil	-

#### 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%
2021	1,57%												1,57%