

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/>

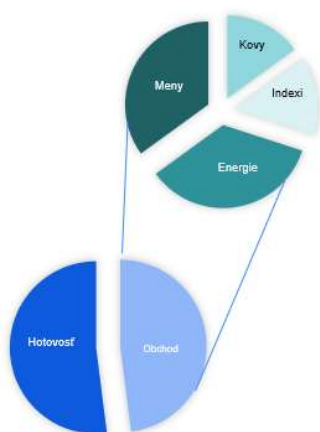
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 4.01 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

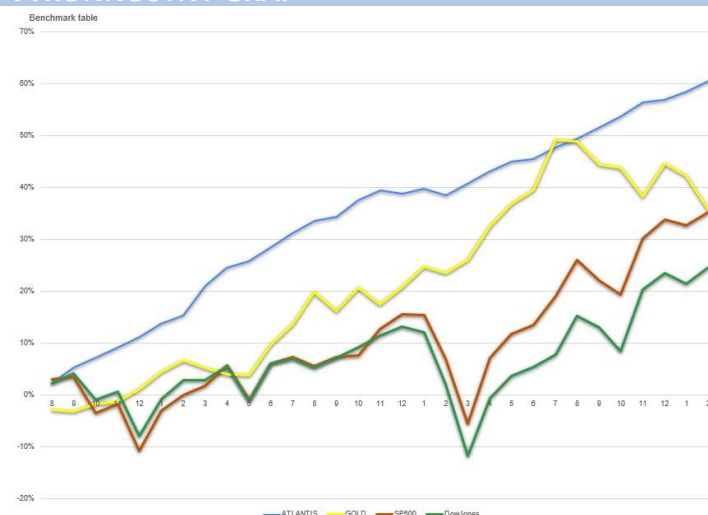
Zhodnotenie za posl. mesiac	+2,14%
Zhodnotenie od založenia fondu	+60,56%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+22,04%
Počet obchodov za posl. mesiac	106
Max. drawdown from peak	-3,79%
Sharpe ratio	0,89
Profit factor	2,23
Positive trades	85,35%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

VÝKONNOSTNÝ GRAF



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

KOMENTÁR

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac február 2021 rast +2,14%. Euro (EUR) zostalo oproti americkému doláru (USD) medzimesačne pomerne stabilné, v rozmedzí od 1,1957 do 1,2240.

Obavy investorov o prudký rast inflácie súvisiace s oživením dopytu a stimulačným plánom Bidenovej administratívy, ktorý by mohol viesť k posunu v menovej politike, zatiaľ nemali žiadny vplyv na výmenný kurz. Libra (GBP) naďalej kapitalizuje z nádeje na návrat k normálu vo Veľkej Británii, rýchlejšie ako v eurozóne. Na konci februára vláda Spojeného kráľovstva oznámila plán na zrušenie výluky, ktorá sa má predĺžiť od začiatku marca do konca júna. Nások Spojeného kráľovstva v očakovaní by mal krajine umožniť tento rok ekonomicky prekonať eurozónu, čo by malo jednoznačne podporiť libru. Naďalej veríme, že návrat dvojice EUR/JPY na 0,83 v strednodobom horizonte nemožno vôbec vylúčiť. Napriek obavám z vývoja inflácie a určitým turbulenciám na trhu dlhopisov sa euro (EUR) počas celého februára naďalej veľmi dobre držalo oproti japonskému jenu (JPY). V skutočnosti sa očakáva, že centrálna banka v marci zverejní svoje strategické hodnotenie by to malo otvoriť dvere znižovaniu sadzieb na negatívnejšie územie, ak to ekonomika potrebuje. Nevýhodou je, že takéto opatrenie by mohlo ešte viac oslabiť japonský bankový sektor, ktorý už teraz trpí skutočným problémom ziskovosti. Dvojica euro / švajčiarsky frank (EUR / CHF) sa vrátila na svoje maximá z roku 2019 bez zásahu Švajčiarskej národnej banky. Skok eura nad zónu 1,10 bol veľmi rýchly a z krátkodobého hľadiska sa otvára možnosť konsolidácie. Z dlhodobého hľadiska však opakujeme náš cieľ EUR / CHF na úrovni 1,15. Faktory poháňajúce pár smerom hore zahŕňajú vyhladky na hospodárske oživenie, oživenie svetového obchodu a očakávaný nárast dopytu, keď začnú reštriktívne opatrenia ustupovať. Euro zaznamenalo medzimesačne negatívny výkon voči kanadskému doláru (CAD), ale nemôžeme vylúčiť zvrátenie trendu, ak budú pretrvávajúť obavy z návratu inflácie. Austrálska mena najviac profitovala z rastu cien komodít v spojení s oživením čínskeho dopytu. Euro (EUR) sa oproti juanu (CNH) od polovice februára zhodnocovalo, hlavne v dôsledku poklesu CNH v dôsledku nižšej ochoty obchodníkov s devízami po rizikách pre rozvíjajúce sa meny v súvislosti s obavami z vývoja výnosov dlhopisov.

LIST OBCHODNÝCH INSTRUMENTOV

INDEXES

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

ENERGY

Natural Gas	↑
Brent Oil	↑
Crude Oil	↑

METALS

Platinum	↑
Gold	↓
Palladium	↑
Silver	↓

CURRENCIES

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

OTHERS

Mini-NASDAQ	-
SoyBean	-

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%	2,14%											3,71%