

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 kovy, 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/>

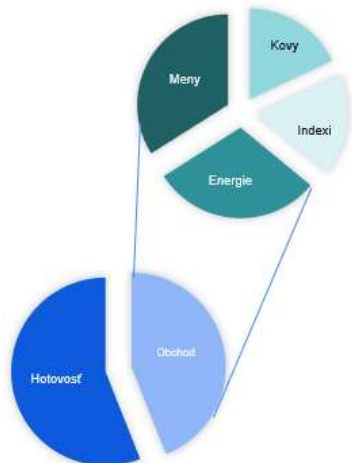
### FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 3.81 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	+2,05%
Zhodnotenie od založenia fondu	+62,61%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+21,98%
Počet obchodov za posl. mesiac	111
Max. drawdown from peak	-3,65%
Sharpe ratio	0,91
Profit factor	2,28
Positive trades	86,48%

### ALOKÁCIA VO FONDE



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

### VÝKONNOSTNÝ GRAF



JUDr. Luboš Žufva  
CEO company

### KOMENTÁR

Privátny algoritmickej hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac marec 2021 rast +2,05%. Euro bolo voči americkému doláru vo „voľnom páde“. S najväčšou pravdepodobnosťou sa pokles ešte neskončí a pár euro / dolár by sa mohol pohybovať na hranici okolo 1,16. Z tohto dôvodu rýchlejšie a silnejšie hospodárske oživenie v USA, ktoré vyplývalo z účinného očkovacieho programu a veľkého balíka fiškálnych stimulov, viedlo k masívnej recyklácii prílevu zahraničného kapitálu na americký trh. V marci sa opäť potvrdil klesajúci trend eura voči britskej libe. Usporiadany brexit a predovšetkým schválené riadenie očkovacieho programu vo Veľkej Británii (čo umožňuje rýchlejšie otvorenie britskej ekonomiky) sú hlavnými faktormi prispievajúcimi k nárastu libry. Na základe súčasnej miery očkovania v Spojenom kráľovstve, sa skutočne očakáva, že takmer 75% populácie dostane prvú dávku vakcíny do polovice júna, čo je cieľ, ktorý sa má v eurozóne dosiahnuť až o niekoľko mesiacov neskôr. Dvojica euro / japonský jen (EUR / JPY) počas celého marca výrazne kolísala a vyvíjala sa v súlade s oznámeniami o rozpočte USA a správami o vývoji pandémie v Európe. Mena je naďalej ovplyvňovaná hlavne zmenou rizikového apetítu / averzie, ktorá zostáva kľúčovým barometrom pre pochopenie EUR / JPY. Celý marec pár euro / švajčiarsky frank (EUR / CHF) kolísala šachovnicovým spôsobom a pohyboval sa vo veľmi úzkom pásme iba 150 pipov. Táto situácia potvrdila, že priame intervencie v cudzej mene budú pokračovať v strednodobom horizonte v snahe obmedziť zhodnocovanie švajčiarskych frankov. Kanadský dolár (CAD) v marci podporili dva hlavné faktory. Po prvé, rast cien energetických komodít pokračoval ďalej a po druhé, Bank of Canada má zväziť okamžité zníženie ekonomickej podpory, ktorá je hnacou silou zhodnocovania miestnej meny. Vysoká volatilita párov euro / austrálsky dolár (EUR / AUD) v marci v rozmedzí takmer 350 pipov je spôsobená predovšetkým zhoršením krátkodobých ekonomickej výhľadov eurozóny v dôsledku rozšírenia Covid-19 po celej Európe. Jednoznačný nesúlad v ekonomickej výhľade medzi eurozónou a Čínou v krátkodobom horizonte naďalej zostáva jedným z motorov oslabovania jednotnej meny. V marci pár eur / jenov (EUR / CNH) medzičasom poklesol o takmer 1,22%.

### 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

MiniDJ	-
Corn	-

### 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%	2,05%										5,76%