

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/>

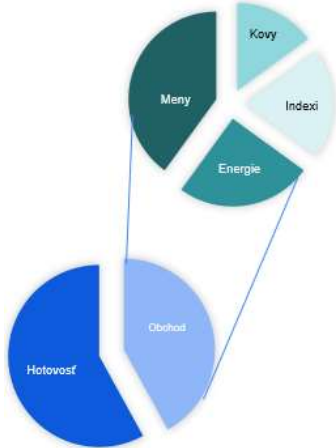
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 3.52 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

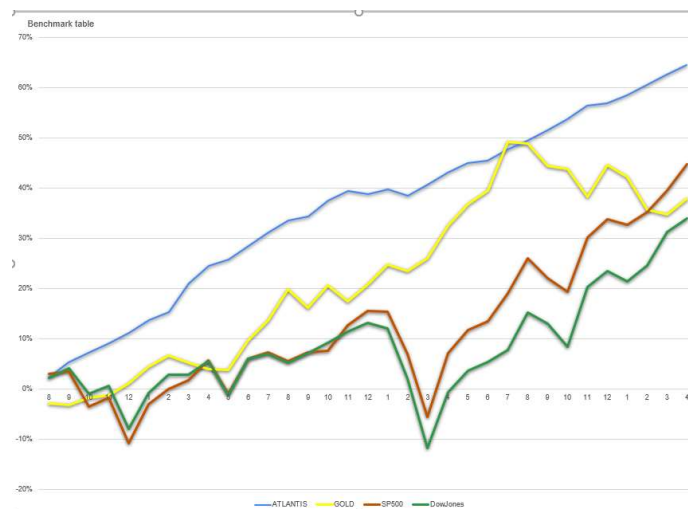
Zhodnotenie za posl. mesiac	+1,91%
Zhodnotenie od založenia fondu	+64,52%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+21,58%
Počet obchodov za posl. mesiac	105
Max. drawdown from peak	-3,61%
Sharpe ratio	0,89
Profit factor	2,19
Positive trades	84,57%

ALOKÁCIA VO FONDE



Naším cieľom je dlhodobu 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 apríl 2021 rast +1,91%. Vďaka výraznému zlepšeniu hospodárskeho vývoja v Európe si euro (EUR) získalo oproti americkému doláru (USD) značnú oporu (mesačná odchýlka +2,51%). Výhľad zostáva veľmi pozitívny vďaka zrýchlenej očkovej kampani. Euro (EUR) vykázalo jeden z najlepších mesačných výkonov voči britskej mene (GBP) (+ 2,23% v apríli). Všetky posledné dobré správy boli zapracované do trhových cien (vrátane opätovného ekonomického otvárania), nádeje ponúkané zrýchlenými očkovacími programami a vplyv škótskych všeobecných volieb naplánovaných na 6. mája. Návrat rizikového apetítu na devízovom trhu, najmä z dôvodu optimizmu ohľadom procesu očkovania a nadchádzajúce opätovné otvorenie hlavných ekonomík zaznamenal skok eura (EUR) oproti japonskému jenu (JPY) (mesačná variácia + 1,17%). Po dosiahnutí maxima k 1. aprílu pár (EUR / CHF) rýchlo klesol na svoje mesačné minimum 1,0974. Je pravdepodobné, že zrušenie blokujúcich opatrení, ktoré sa začne v polovici mája vo viacerých európskych krajinách, povedie k skoku v makroekonomických ukazovateľoch, čo dvojici umožní uniknúť zo zóny 1.10 - 1.11, kde sa pohybovala dlhšie ako mesiac. Pár (EUR / CAD) sa v apríli mierne zvýšil (+0,26%), a to predovšetkým v dôsledku opätovnej ochoty riskovať. Bank of Canada znížila objem spätného nákupu svojich aktív. Výkup štátnych dlhopisov klesol zo 4 miliárd dolárov na 3 miliardy dolárov za týždeň. Podľa posledných údajov o očkovaní sa očakáva, že EÚ dosiahne spoločenskú imunitu (70% zaočkovanej dospeléj populácie) do júla tohto roka. Posledné údaje o inflácii v Austrálii (rast indexu spotrebiteľských cien v prvom štvrťroku len o 0,6%) potvrdili, že menová politika austrálskej rezervnej banky zostane ešte dlho vysoko prijateľná. Zvýšenie sadzieb sa neočakáva skôr ako v roku 2024. Euro (EUR) sa v apríli dosť prudko odrazilo oproti yuan (CNH) (mesačná odchýlka + 2,11%). Tento silný nárast bol spôsobený predovšetkým nebilancovaním portfólií obchodníkov z ich pozícií v eurách.

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

Lean Hogs	-
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%	2,05%	1,91%									7,67%