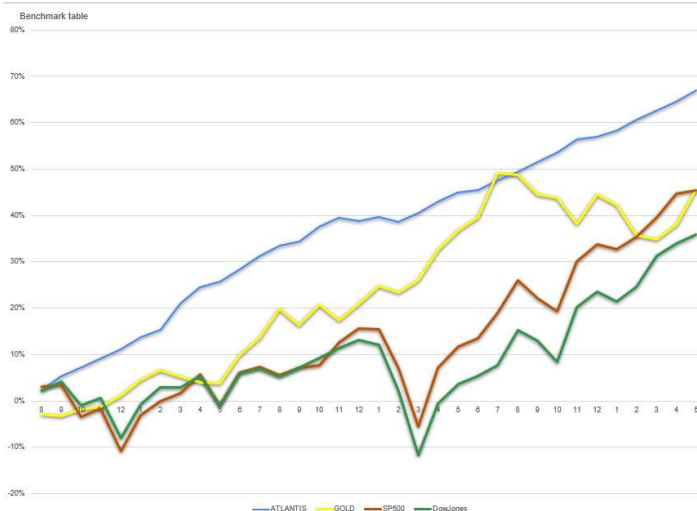


Obchodné portfólio privátneho algoritmickeho hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou 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	€ 3.48 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

VÝKONNOSTNÝ GRAF



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	↓

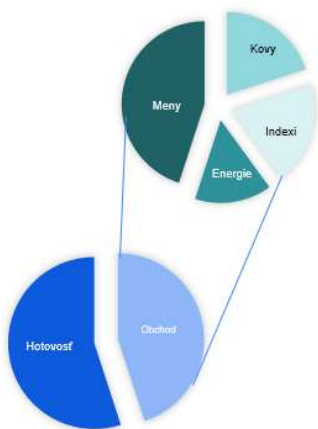
OTHERS

MiniDJ	-
Corn	-

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	+2,43%
Zhodnotenie od založenia fondu	+66,95%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+22,10%
Počet obchodov za posl. mesiac	112
Max. drawdown from peak	-3,58%
Sharpe ratio	0,85
Profit factor	2,13
Positive trades	85,05%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmickej hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac máj 2021 rast +2,43. Napriek obavám z inflácie zostáva na devízovom trhu dominantný apetít po riziku, s pozitívnym vývojom v prípade eura (EUR). Správa je jasná. Nepredpokladá sa, že inflácia vydrží, takže v blízkej budúcnosti nie sú pripravené žiadne plány na prispôbienie menovej politiky. Ako sa predpokladalo, libra (GBP) pokračovala v zhodnocovaní voči euru (EUR). Ekonomika Spojeného kráľovstva sa znovu otvorila rýchlejšie ako ekonomika eurozóny. Toto urobilo obchodníkov optimistickými napriek miestnym obavám z indického variantu vírusu, z čoho profituje libra. Bank of England predpovedá zvýšenie miery nezamestnanosti zo 4,8% v prvom štvrtroku 2021 na 5,8% do konca roka. Najlepším dôkazom toho, že v máji na devízovom trhu prevládala apetít po riziku, bol silný rast eura (EUR) oproti japonskému jenu (JPY), ktorý sa zvyčajne považuje za bezpečný prístav. Euro-švajčiarsky frankový pár (EUR / CHF) sa v máji pohyboval v extrémne tesnom rozmedzí (okolo 100 pipov). Očakáva sa, že dvojica zostane v krátkodobom až strednodobom horizonte stabilná. Súčasná úroveň reflácie našťastie obmedzuje tlak na švajčiarsky frank, čo centrálnej banke v krajine výrazne uľahčuje. Rizikový apetít ako vždy uprednostňuje komoditné meny. To vysvetľuje prudký rast kanadského dolára (CAD) voči euru (EUR) v máji. Odzrkadľuje to aj pokračujúci rast cien komodít. Za súčasného stavu sa očakáva, že súčasný proces opätovného otvárania ekonomiky a vyhlídky na návrat hospodárskej aktivity do normálu budú aj naďalej podporovať komoditný trh a zase meny, ktoré sú na nich veľmi závislé, napríklad CAD. V máji bol pozorovaný veľmi široký rozsah fluktuácie pre pár euro-austrálsky dolár (EUR / AUD) (takmer 400 pipov). Je to ukázkový príklad toho, prečo je potrebná správna stratégia zaistenia meny. V máji sa pár euro-jüan (EUR / CNH) pohyboval vo veľmi úzkom rozmedzí okolo 10 pipov. CNH pokračuje v stúpajúcom strednodobom trende, ktorý priamo odráža nádej na silné hospodárske oživenie v Číne.

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%	2,43%								10,10%