

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 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/>

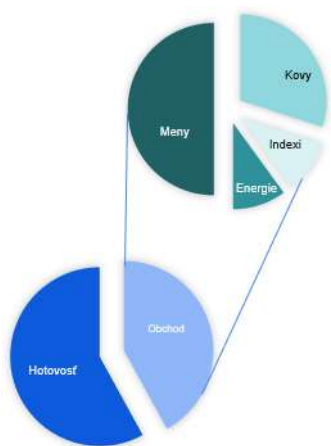
#### FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 3.50 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

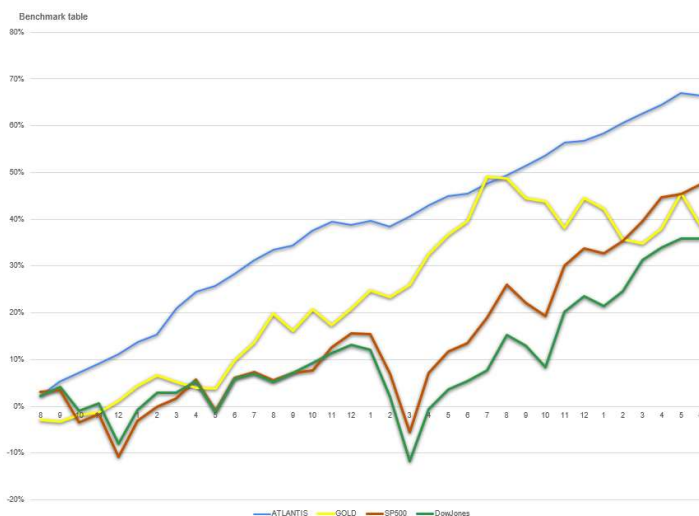
Zhodnotenie za posl. mesiac	-0,42%
Zhodnotenie od založenia fondu	+66,53%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+21,14%
Počet obchodov za posl. mesiac	108
Max. drawdown from peak	-3,62%
Sharpe ratio	0,44
Profit factor	1,95
Positive trades	78,80%

#### ALOKÁCIA VO FONDE



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

#### VÝKONNOSTNÝ GRAF



JUDr. Luboš Žufra  
CEO company

#### KOMENTÁR

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac jún 2021 stratu -0,42. Dôvodom tejto straty bol vysoký pohyb počas správ FOMC, kde algoritmy zaznamenali straty, avšak vďaka diskretnému obchodovaniu sme túto stratu znížili na -0,42. Dvojica EUR / USD uviazla medzi dvoma hlavnými úrovňami: podpora na hodnote 1,1804 a rezistencia na hodnote 1,2160. Vzhľadom na nejasnosť v menovej politike USA by sa EUR / USD mohlo po väčšinu leta naďalej obchodovať v tomto širokom rozmedzí. Trh očakáva, že centrálna banka prijme politické oznámenia v Jackson Hole koncom augusta. Z krátkodobého hľadiska všetky ukazovatele ukazujú, že pár EUR / GBP bude kvôli nedostatku katalyzátorov naďalej kolísať okolo 0,85–0,86. Na svojom poslednom zasadnutí Bank of England potvrdila svoj menový status quo (hlavná sadzba sa drží na 0,1% a zásoby nakupovaných aktív sa udržiavali). V posledných týždňoch sa EUR / JPY opakovane pokúšali vymaniť z rozsahu 133 - 134. Bezvýsledne. Dvojica preto začala proces konsolidácie, čo vysvetľuje pokles mesačnej odchýlky o 1,92%. Nie je prekvapením, že volatilita v EUR / CHF zostala v júni veľmi nízka a pohybovala sa v úzkom obchodnom pásme 130 bodov, čo je na také dlhé obdobie málo. Nedostatok volatility je spôsobený skutočným zmiznutím averzie k riziku z forexových trhov, pretože ekonomiky sa znovu otvárajú na celom svete. Pár EUR / CAD počas celého júna kolísal. Euro stratilo pozíciu voči kanadskému doláru, ktorý bol oživený silným nárastom cien energie (Brent v júni vzrástol o 9,8% a WTI o 13,4%). Vzhľadom na prebiehajúci proces opätovného otvárania ekonomiky existujú všetky dôvody domnievať sa, že ceny komodít budú v nasledujúcich troch až šiestich mesiacoch naďalej rásť. Hlavným krátkodobým zameraním bude stretnutie austrálskej centrálnej banky 6. júla, po ktorom sa niektorí analytici domnievajú, že by bolo možné upraviť existujúce programy. Potom môžeme vidieť vyššiu volatilitu v páre EUR / AUD, a preto je potrebná vhodná stratégia zaistenia meny. Pokles EUR / CNH je do veľkej miery spôsobený ekonomickou dynamikou v Číne. Krajina je v pokročilejšom štádiu hospodárskeho cyklu ako eurozóna. Mali by sme však zostať ostražití, pokiaľ ide o tento menový pár, pretože volatilita sa v lete zvykne oživiť.

#### 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	-
Lean Hogs	-

#### 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%	-0,42							9,68%