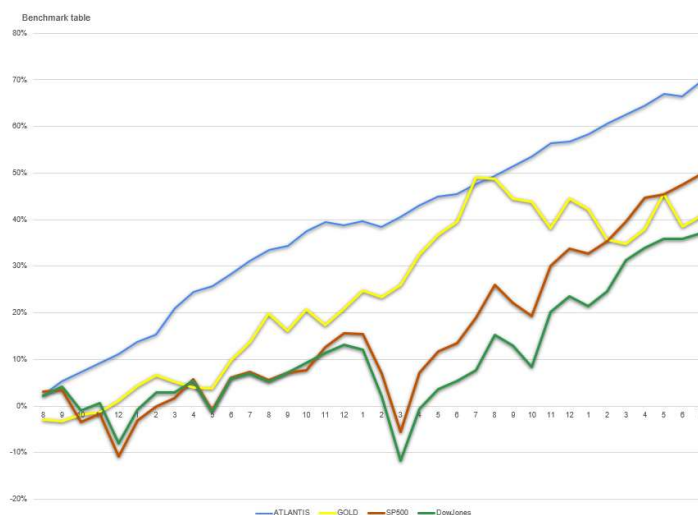


Obchodné portfólio privátneho algoritmického hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou 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	€ 3.61 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% - 30% 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	↓

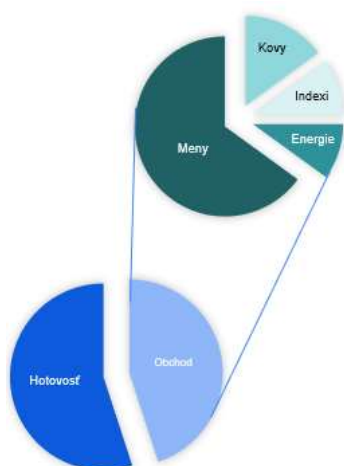
OTHERS

Heating Oil	-
MiniDJ	-

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	3,04%
Zhodnotenie od založenia fondu	+69,57%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+22,05%
Počet obchodov za posl. mesiac	143
Max. drawdown from peak	-3,90%
Sharpe ratio	0,78
Profit factor	2,07
Positive trades	80,20%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žufra
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac júl 2021 rast 3,04%. Účastníci trhu Forex sa vrátili späť do nákupných pozícií po tom, čo FED naznačil, že sa bude držať svojej ultramoderner menovej politiky o niečo dlhšie v snahe dostať trh práce do lepšieho stavu. V strednodobom horizonte očakávame, že EUR/USD sa bude pohybovať v intervale 1,16-1,20. Dvojica EUR/GBP je stále ukotvená vo svojom trojmesačnom rozmedzí od 0,85 do 0,87. Z ekonomického hľadiska by táto nová epizóda COVID-19 nemala brániť obnoveniu činnosti, súdiac podľa vysokofrekvenčných ukazovateľov, ktoré ekonómovia od marca 2020 hojne používajú na presný odhad možného vývoja rastu. V júli dopyt po JPY prudko vzrástol, najmä v prvej časti mesiaca, čím sa EUR/JPY dostal na mesačné minimum 128,88. Účastníci trhu s Forexom boli k JPY a iným obranným aktívam upútaní kvôli obavám z variantnej delty a potenciálneho negatívneho ekonomického pádu, ktorý by mohol vyplývať z jej rozšírenia. EUR/CHF stratil v júli výraznú pozíciu (medzimesačne -2,02%) predovšetkým kvôli obavám z rýchleho rozšírenia variantnej delty, ktorá je už prítomná vo viac ako 98 krajinách. Účastníci trhu Forex sa radšej rozhodli pre bezpečné útočisko, ktoré automaticky uprednostňovalo CHF. V posledných týždňoch bolo vidno najmä mnohých inštitucionálnych investorov (ako sú veľké banky a investičné fondy) nakupovať CHF. Júlové rozhodnutie Bank of Canada bolo plne v súlade s očakávaniami. Hlavná sadzba bola zachovaná na 0,25%, zatiaľ čo program nákupu aktív bol opäť upravený smerom nadol na 2 miliardy CAD týždenne. Odráža to ekonomické zlepšenie v krajine v kontexte zdravotnej situácie, ktorá je pod kontrolou, a skutočnosť, že podmienky financovania sú stále veľmi dobré. Vzhľadom na nedávne obmedzenia, ktoré boli oznámené vo viacerých veľkých austrálskych mestách, bude mať hospodárska aktivita v treťom štvrtroku silný vplyv. Za týchto podmienok je veľmi pravdepodobné, že RBA zvráti svoje rozhodnutie znížiť týždenné tempo nákupov aktív. V júli bola na páre EUR/CNH veľká volatilita, ale mesiac sa skončil blízko svojej počiatkovej úrovne. Nedávne nepokoje na čínskom trhu (priamo súvisiace s prevzatím niekoľkých sektorov činností vládou v oblasti nových technológií a vzdelávania vládou) by mohli spôsobiť riziko silného znehodnotenia CNH, ak bude pokračovať.

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	3,04%						12,72%