

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 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/>

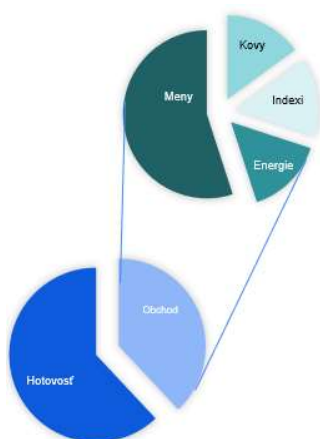
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 3.95 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

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	1,13%
Zhodnotenie od založenia fondu	+70,70%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+21,32%
Počet obchodov za posl. mesiac	98
Max. drawdown from peak	-4,20%
Sharpe ratio	0,77
Profit factor	1,91
Positive trades	74,30%

ALOKÁCIA VO FONDE



Naším cieľom je dlhodobé dosahovať výnosy nad trhovým priemerom a pri nízkej volatilite portfólia.

VÝKONNOSTNÝ GRAF



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

KOMENTÁR

Privátny algoritmickej hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac august 2021 rast 1,13%. Centrálna banka znížila svoje nákupy aktív do konca roka. Medzitým je menová politika Európskej centrálnej banky na autopilote. Euro sa zatiaľ pohybuje v mesačnom pásme medzi 1,17 a 1,19. Anglická centrálna banka taktiež udržiava súčasný stav. Centrálna banka Spojeného kráľovstva očakáva, že inflačné tlaky sa v nasledujúcich mesiacoch zvýšia (pričom index spotrebiteľských cien môže v novembri alebo decembri dosiahnuť 4%), ale v súčasnosti neuvažuje o intervencii. EUR/JPY stále zostáva v dlhodobom „medvedňom“ kanáli, aj keď je pod oblasťou 131,00-131,50. Euro bolo na začiatku augusta penalizované najmä náhlym nárastom averzie k riziku, súvisiacim so situáciou v Afganistane, ale jeho účinok bol krátkodobý. Pár EUR/CHF krátkodobou porušil podporu na úrovni 1,07 - čo niektorí účastníci trhu považujú za hranicu, pri ktorej švajčiarska národná banka zintenzivňuje svoje menové intervencie. Medzi hlavnými menovými pármí bol EUR/CAD v auguste najvolatilnejší. Fluktučné pásmo bolo takmer 450 bodov! V krátkodobom horizonte by mala byť pozorne sledovaná hranica 1,51, ktorá slúži ako odpor a ktorá systematicky vyvoláva prudký pokles páru pri každom porušení. Z politického hľadiska vyhlásil kanadský premiér Justin Trudeau predčasné parlamentné voľby na 20. septembra. Napriek rôznym blokádam v Austrálii a následným ekonomickým turbulenciám sa zdá, že austrálska centrálna banka je naďalej odhodlaná obmedzovať nákupy aktív. Očakáva sa, že nákupy aktív od 1. septembra klesnú na 4 miliardy AUD za týždeň z 5 miliárd AUD v minulosti. Zdá sa, že devízový trh očakáva nadchádzajúce oznámenie opatrení čínskych úradov na podporu ekonomiky. Podľa oficiálnej tlače orgány zvažujú ďalšie zníženie povinných minimálnych rezerv pre banky vo štvrtom štvrťroku (čo zaisťuje dobré podmienky financovania najmä pre spoločnosti) a zachovanie transakcií na voľnom trhu na zabezpečenie likvidity.

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%	1,13%					13,85%

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	-
SoyBean	-