

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 kovy, 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/>

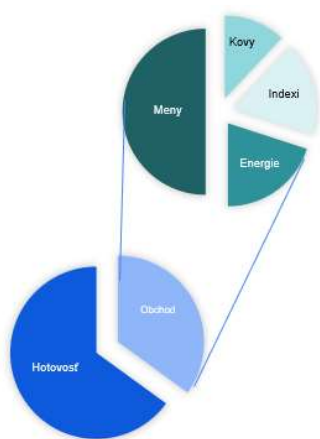
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 3.90 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	-0,83%
Zhodnotenie od založenia fondu	+69,87%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+18,52%
Počet obchodov za posl. mesiac	86
Max. drawdown from peak	-4,48%
Sharpe ratio	0,67
Profit factor	1,09
Positive trades	71,08%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

VÝKONNOSTNÝ GRAF



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

KOMENTÁR

Privátny algoritmickej hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac september 2021 pokles -0,83%. Na oboch stranách Atlantiku v súčasnej dobe funguje menová politika na autopilote. V Eurozóne sa očakáva, že ECB bude viesť ďalšie rozhovory o ultrakomodatívnych opatreniach, najskôr však na zasadnutí v novembri alebo v decembri. V USA Federálny rezervný systém jednoducho potvrdil, že postupné znižovanie nákupov aktív bude čoskoro oznámené. Okrem toho vidíme veľmi prudký nárast cien energií, a to už má vplyv na výrobné a spotrebiteľské ceny. Ak by sme mali tento rok v Európe zažiť krutú zimu, niektorí analytici už predpokladajú energetickú krízu, ktorá v niektorých krajinách priniesie prídely elektriny a tepla. To by samozrejme malo negatívny vplyv na ekonomickú aktivitu a mohlo by to viesť k poklesu jednotnej meny. Medzimesačne pár EUR/GBP vzrástol o 0,43%. Po mesiacoch stability v rozmedzí 0,85 až 0,86 sa dvojica opäť podarilo prelomiť nad 0,86. Pokiaľ ide o menovú politiku, centrálna banka Anglicka ponechala svoj kurz a program nákupu aktív nezmenený. Centrálna banka očakáva, že inflácia v tomto roku prekročí 4%. V nasledujúcich mesiacoch môže dokonca rásť v dôsledku akútnej energetickej krízy v Británii. V septembri sa rozsah obchodovania EUR/JPY od augusta len málo zmenil. Dvojica sa odrazila od zóny podpory 127,98, čo by v krátkodobom horizonte mohlo umožniť prielom okolo oblasti 131,00. Problémy Evergrande v Číne vyvrcholili začiatkom septembra zvýšeným dopytom po JPY. Tento krok však nevydržal. Rovnako ako vo väčšine ostatných centrálnych bánk je centrálna banka Japonska na automatickom pilotnom teste. Švajčiarska národná banka je na autopilote a plánuje udržať svoju politiku záporných úrokových sadzieb (na -0,75%) tak dlho, ako to bude potrebné. Švajčiarska národná banka sa tiež domnieva, že CHF je voči euru nadhodnotený. Kanadská centrálna banka na svojom zasadnutí 8. septembra ponechala sadzby a program nákupu aktív nezmenený. Hlavná úroková sadzba je 0,25%, zatiaľ čo týždenný objem nákupov aktív je 2 miliardy CAD. Na plánovanom zasadnutí 27. októbra očakávame, že Kanadská centrálna banka zníži objem nákupov aktív na 1 miliardu CAD týždenne. V septembri sa euro oproti austrálskemu doláru v mesačnej odchylke prepadlo o 0,85%. Tento pokles však môže byť krátkodobý. Problémy austrálskej ekonomiky sú rozmanité. Centrálna banka poukázala na riziká pre finančnú stabilitu, ktoré predstavuje rastúci dlh domácností a bublina na trhu s bývaním. Okrem toho by austrálska ekonomika, ktorá je hlavným vývozcom surovín do Číny, najmä železnej rudy, mohlo nepriaznivo ovplyvniť spomalenie Číny, ktoré priniesla reštrukturalizácia majetkového giganta Evergrande.

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%	-0,83%				13,02%

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

Kcw CBT	-
Lean Hogs	-