

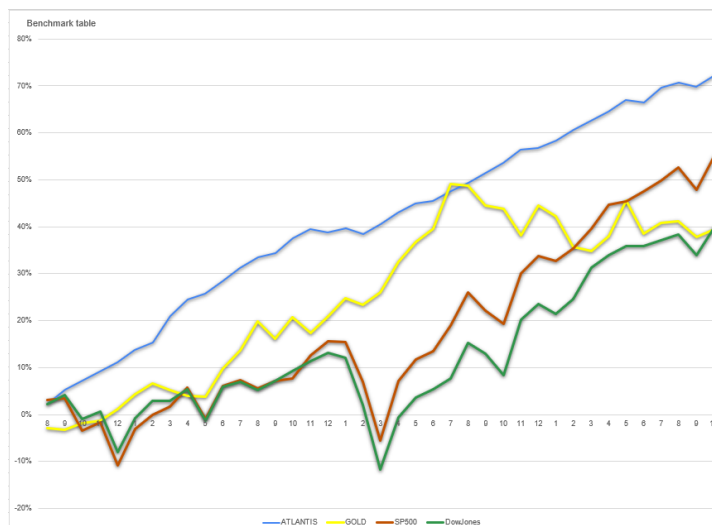


Obchodné portfólio privátneho algoritmického hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou 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	€ 3.98 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	↓

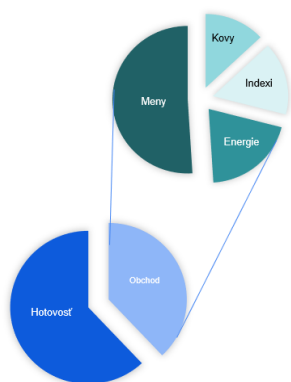
OTHERS

Kcw CBT	-
Lean Hogs	-

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	2,15%
Zhodnotenie od založenia fondu	+72,02%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+18,39%
Počet obchodov za posl. mesiac	106
Max. drawdown from peak	-2,73%
Sharpe ratio	0,69
Profit factor	2,36
Positive trades	83,00%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac október 2021 rast 2,15%. V priebehu mesiaca sme zaznamenali aj zmenu správania sa trhu, kde trhy začali výraznejšie trendovať, z čoho ťažilo hlavne algoritmické portfólio a potiahlo celý výsledok fondu. Pričom diskretný prístup absolvoval stratu.

Ako sa dalo očakávať, zasadnutie Európskej centrálnej banky nebolo mimoriadne dôležité. Dôležitým dátumom pre pár EUR/USD je zasadnutie Federálneho rezervného systému USA 2. – 3. novembra. V rámci centrálnej banky USA existuje konsenzus o potrebe normalizácie menovej politiky znížením nákupov aktív (tapering). Každý mesiac centrálna banka odkúpi na finančných trhoch aktíva v priemere za 120 miliárd dolárov. Od polovice novembra alebo najneskôr začiatkom decembra by sa objem nákupov aktív mal znížiť o 15 miliárd USD mesačne. Pri tejto sadzbe by centrálna banka mala ukončiť svoj program nákupu aktív od júna 2022. Devízový trh predpokladá, že prvé zvýšenie sadzieb by mohlo nastať v septembri 2022, ak inflácia zostane vysoká. EUR/GBP sa definitívne vymenil zo svojho letného pásma 0,85-0,86. Libra v októbri medzimesačne posilnila o 1,56 %. S rastúcimi inflačnými tlakmi, ktoré môžu na začiatku budúceho roka medziročne presiahnuť 5 %, devízový trh očakáva, že centrálna banka by mohla v novembri zvýšiť svoju hlavnú menovú sadzbu o 15 až 25 bodov. Je zriedkavé, aby sa centrálna banka Anglicka rozhodla konať pred americkou centrálnou bankou. EUR/CHF dosiahol koncom októbra na devízovom trhu 11-mesačné minimum. Švajčiarsky frank citeľne posilnil napríklad aj voči americkému doláru. Obavy operátorov devízového trhu z priebehu inflácie podnecujú ich ústup do bezpečných aktív, vrátane švajčiarskeho franku.

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%	2,15%			15,17%