

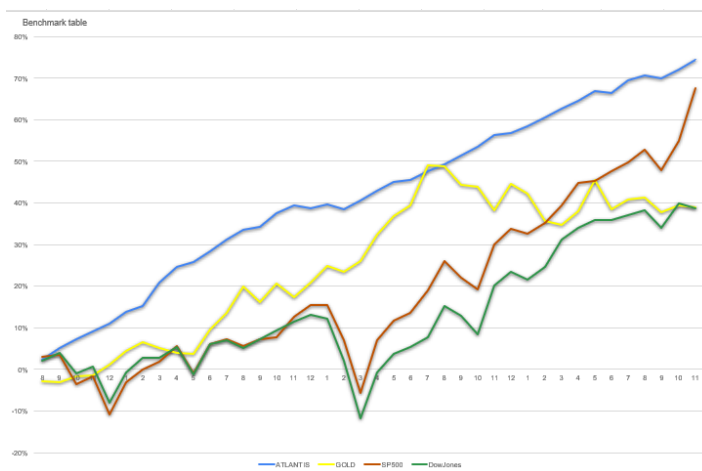


Obchodné portfólio privátneho algoritmickeho hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou 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 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
Velkosť fondu	€ 4,07 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
Správčský 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	↑

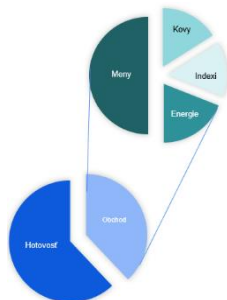
OTHERS

Corn	-
Heating Oil	-

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	2,33%
Zhodnotenie od založenia fondu	+74,35%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+18,99%
Počet obchodov za posl. mesiac	114
Max. drawdown from peak	-2,58%
Sharpe ratio	0,70
Profit factor	2,53
Positive trades	84,60%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmickej hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac november 2021 rast 2,33%. Ekonomický horizont v eurozóne tmavne. Rakúsko sa môže dostať do recesie. Nemecko čelí prudkému spomaleniu aktivity. Nedostatok a rastúce ceny energií naďalej vyvolávajú obavy. K tomu treba pripočítať aj snahu Európskej centrálnej banky udržiavať stabilnú menovú politiku, čo má určitý negatívny vplyv na kurz eura. Aby bol odraz udržateľný a mohol byť nazývaný zvrátením trendu, EUR/USD by musel prelomiť rezistenciu na 1,1375. EUR/GBP v novembri podliehala volatilitě a obchodovalo sa v širokom rozmedzí 200 bodov. Centrálna banka Spojeného kráľovstva na svojom novembrovom zasadnutí prekvapila devízový trh tým, že ponechala svoju menovú politiku nezmenenú, pričom naznačila, že je pripravená zvýšiť svoju hlavnú menovú sadzbu. Obavy z variantu Omicron tiež viedli k mierne väčšej volatilitě, ako sa očakávalo. Jedinou istotou, ktorú máme v tomto bode, je, že centrálna banka Spojeného kráľovstva, plánuje v priebehu budúceho roka zvýšiť základnú sadzbu aspoň o 0,5 %, aby znížila infláciu. Riziká spojené s novým variantom Omicron, narušenie výrobných reťazcov a nekontrolovaná inflácia vyvolávajú obavy z vážnych ekonomických dôsledkov pre eurozónu vo štvrtom štvrtroku. EUR/CHF v novembri výrazne klesol. Pár je späť na úrovni z roku 2015 kvôli zvýšenej averzii k riziku na devízovom trhu. EUR/CAD sa na konci novembra výrazne odrazil, aj keď ide podľa nášho názoru o technický pohyb. Trh predpokladá, že prvé zvýšenie úrokových sadzieb príde začiatkom jari 2022. Čínska vláda chce silnú menu, aby obmedzila ekonomický dopad nárastu dovážaných energetických produktov. To vysvetľuje medzimesačný pokles eura voči CNH. Ale vzhľadom na zvýšené riziká stagflácie (klesajúci rast a vysoká inflácia) by nás neprekvapilo, keby úrady budúci rok tolerovali vyšší kurz EUR/CNH.

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%	2,33%		17,50%