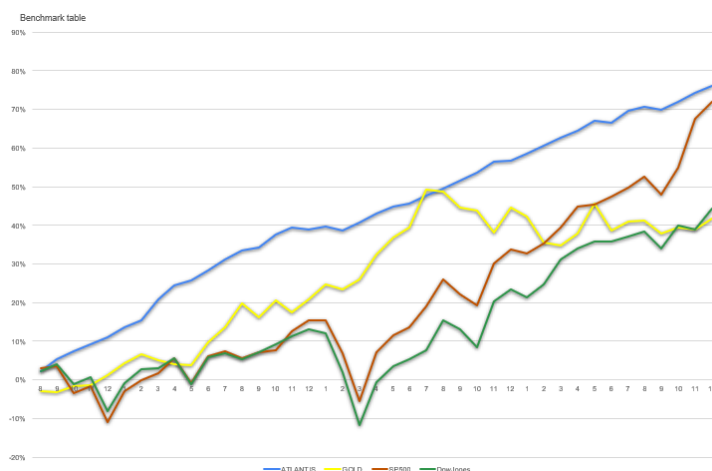


Obchodné portfólio privátneho algoritmického hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou 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 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	€ 4,14 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	↑

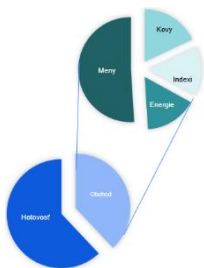
##### OTHERS

Mini-NASDAQ	-
SoyBean	-

#### ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	1,63%
Zhodnotenie od založenia fondu	+75,98%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+19,13%
Počet obchodov za posl. mesiac	97
Max. drawdown from peak	2,87%
Sharpe ratio	0,71
Profit factor	2,07%
Positive trades	76,8%

#### ALOKÁCIA VO FONDE



#### KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa  
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac december 2021 rast 1,63%. Všetky hlavné americké akciové indexy uzavreli v posledný obchodný deň roku 2021 nižšie, zatiaľ čo väčšina trhov APAC a európskych trhov bola zatvorená v rámci oslavy nového roka. Americké vládne dlhopisy v tento deň uzavreli takmer na rovnakej úrovni. CDX-NA a európsky iTraxx uzavreli takmer bez zmeny naprieč IG a vysokým výnosom. Zemný plyn, meď, striebro a zlato uzavreli vyššie, kým americký dolár a ropa boli v tento deň nižšie. Peňažný trh očakáva, že Britská centrálna banka bude musieť v roku 2022 opäť zvýšiť svoju kľúčovú sadzbu aby obmedzila inflačné tlaky. V decembri zvýšila svoju sadzbu na 0,25 % oproti 0,10 %. Inflácia sa v novembri odrazila na 5,1 %. Údaj za december ešte nebol zverejnený, no očakáva sa, že bude katastrofálny. Ceny energií dosiahli rekordné výšky. Centrálna banka očakáva, že inflácia bude pokračovať v raste v apríli až na vrchol 6 %. V októbri Kanadská centrálna banka ukončila svoj výnimočný program nákupu aktív, s cieľom čeliť pandémie (známej aj ako QE). Trh teraz očakáva nadvládajúce zvýšenie sadzieb. Investori veria, že existuje 50% šanca, že prvé zvýšenie sadzieb príde počas januárového stretnutia, pričom všetci veria, že k zvýšeniu sadzieb dôjde v marci. Sprísnenie menovej politiky Kanadskej centrálnej banky by mohlo byť rýchlejšie ako sprísnenie americkej centrálnej banky, čo bude mať dôsledky aj pre pár USD/CAD. Za posledný rok malo euro tendenciu voči CNH znehodnocovať. Ekonomické ciele Pekingu sú na rok 2022 odlišné. Prioritou je podpora ekonomickej aktivity a najjednoduchším spôsobom, ako to dosiahnuť, je stimulovať exportný sektor. Jedným z hlavných prvkov na dosiahnutie tohto cieľa je slabá mena. Očakávame, že EUR/CNH sa v nasledujúcich týždňoch a mesiacoch výrazne zhodnotí. Okrem toho orgány prijali niekoľko nedávnych opatrení na podporu rastu, najmä tým, že požiadali banky, aby opäť požičiavali hráčom v oblasti nehnuteľností. To všetko poukazuje na prílev likvidity do čínskej ekonomiky v roku 2022.

#### 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%	1,63%	19,13%

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