



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	€ 4,23 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	↑

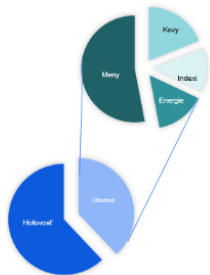
OTHERS

Kcw CBT	-
Lean Hogs	-

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	2,17%
Zhodnotenie od založenia fondu	+78,15%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+16,96%
Počet obchodov za posl. mesiac	157
Max. drawdown from peak	3,63%
Sharpe ratio	0,70
Profit factor	2,23%
Positive trades	78,2%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmickej hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac január 2022 rast 2,17%. EUR/USD zasadenie americkej centrálnej banky vyvolalo značné otrasy. Analytici teraz očakávajú päť zvýšení sadzieb v tomto roku v USA. To podporí americký dolár voči nespočetnému množstvu mien a najmä voči euru. Poznomenala, že inflácia je vyššia, ako sa očakávalo, čo by malo viesť k revízií inflačných prognóz smerom nahor v marci budúceho roka. Nevylúčila prvé zvýšenie sadzieb aj v roku 2022. Volatilita na páre EUR/USD v dôsledku toho vyskočila. Centrálna banka Anglicka podľa očakávania zvýšila kľúčovú úrokovú sadzbu z 0,25 % na 0,50 %. Do konca leta očakávame ešte dve zvýšenia sadzieb: v máji a auguste. Zakaždým očakávame nárast o približne 25 bázických bodov. EUR/CHF v januári takmer stagnoval (+0,80 %). Prudký pokles v páre bol na chvíľu zastavený. Je to pravdepodobne dôsledok zvýšených intervencií švajčiarskej národnej banky na devízovom trhu. Podľa našich odhadov vynaložila centrálna banka v prvý januárový týždeň 1,86 miliardy CHF na obmedzenie rastu CHF. Namiesto toho očakávame, že sa pár v blízkej budúcnosti stabilizuje medzi 1,03 a 1,04. V strednodobom horizonte je CAD naďalej podporovaný prudkým rastom ceny barelu ropy a perspektívou nadchádzajúceho rastu banky kľúčovej sadzby Kanady. Peňažný trh v súčasnosti počíta so zvýšením sadzieb už v marci (okolo 25 bázických bodov). EUR/AUD dvojica sa hojerala veľkú časť januára. Na mesačnej báze však skončil výrazne (+1,39 %). Je pravdepodobné, že v Austrálii (už tento rok) dôjde k zvýšeniu sadzieb rýchlejšie ako v eurozóne. V budúcnosti by to malo uprednostňovať austrálsky dolár voči jednotnej európskej mene. EUR/CNH Po dosiahnutí mesačného maxima 7,2974 prudko klesol, potom sa vďaka zasadeniu Európskej centrálnej banky opäť vzhopil. V strednodobom horizonte stále očakávame pokles výmenného kurzu CNH, čo by Číne umožnilo podporiť svoj exportný priemysel rýchlo a s nižšími nákladmi.

TRADING RESULT

Year	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%
2022	2,17%												2,17%