



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
Velkosť fondu	€ 5,49 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	↑

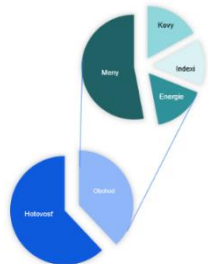
OTHERS

Mini- NASDAQ	-
SoyBean	-

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	3,06%
Zhodnotenie od založenia fondu	+81,21%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+13,90%
Počet obchodov za posl. mesiac	171
Max. drawdown from peak	4,23%
Sharpe ratio	0,73
Profit factor	2,51%
Positive trades	80,3%

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 február 2022 rast 3,06%. Nárast geopolitického rizika spojeného s vojnou na Ukrajine viedol v posledných týždňoch k takmer plošnému znehodnoteniu eura. Zatiaľ čo situácia na mieste zostáva zložitá, pokles eura by mal pokračovať. Napriek silnému oživeniu inflácie v eurozóne v posledných mesiacoch sa očakáva, že Európska centrálna banka si v krátkodobom horizonte zachová akomodatívnu menovú politiku. Budúci týždeň by sa mala zamerať najmä na vplyv vojny na infláciu a rast a dôsledky pre finančnú stabilitu. Pokles eura voči švajčiarskemu franku bol masívny: pokles o takmer 400 bodov v priebehu mesiaca. Depreciácia eura sa na posledných zasadnutiach zrýchlila v dôsledku ohlásenia významných ekonomických a finančných sankcií voči Rusku po invázii na Ukrajinu. Vojna na Ukrajine viedla k prudkému nárastu cien energetických komodít: +24 % pre ceny Brent a WTI počas jedného mesiaca. Hranica 100 dolárov bola pre ropu v posledných seansách bezstarostne prekročená. Analytici predpokladajú, že nárast by mohol byť aspoň 125 USD. K tomu sa pridáva skutočnosť, že centrálna banka Kanady normalizuje svoju menovú politiku oveľa rýchlejšie ako Európska centrálna banka. V tejto súvislosti pokračuje stúpajúci trend CAD voči EUR. V priebehu mesiaca sa euro voči austrálskemu doláru znehodnotilo o 3,43 %. Toto je určite len začiatok. AUD plne ťaží z nárastu cien komodít od začiatku konfliktu. V porovnaní s eurozónou, ktorá je priamo vystavená Rusku (okrem iného kvôli dovozu uhľovodíkov), je austrálska ekonomika pomerne odolná. Euro klesá takmer voči všetkým ostatným menám. Kým sa situácia na ukrajinskom fronte neupokojí, euro bude pravdepodobne ďalej klesať. Potvrzuje to aj technická analýza.

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%	3,06%											5,23%