



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 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	€ 5,66 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	↑

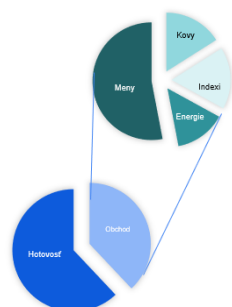
OTHERS

Kcw CBT	-
Lean Hogs	-

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	3,14%
Zhodnotenie od založenia fondu	+84,35%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+10,76%
Počet obchodov za posl. mesiac	178
Max. drawdown from peak	4,27%
Sharpe ratio	0,75
Profit factor	2,55%
Positive trades	80,9%

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 marec 2022 rast 3,14%. Ústrednou témou dvojice EUR/USD zostáva vývoj inflácie a menovej politiky. Zdá sa, že Európska centrálna banka sa zatiaľ zdráha normalizovať svoju menovú politiku rýchlejšie, ako sa očakávalo, napriek oživeniu inflácie (5,8 % vo februári v eurozóne). Naopak, americká centrálna banka pripravuje devízový trh na zvýšenie sadzby o 50 bázických bodov začiatkom mája, po počiatočnom zvýšení o 25 bázických bodov v marci. Inflácia v USA je výrazne vyššia ako v eurozóne, vo februári na úrovni 7,9 %. To určite vysvetľuje zhon americkej centrálnej banky. Euro vykázalo v marci solídny stúpajúci trend voči libre šterlingov. Nedávne zvýšenie sadzieb centrálnej banky Anglicka (o 25 bázických bodov) libre skutočne nepomohlo. Britská centrálna banka čelí komplikovanej makroekonomickej situácii: prudko stúpajúca inflácia (v najbližších mesiacoch sa očakáva okolo 8 %) a jasné známky spomalenia ekonomiky. Ďalšie zvyšovanie sadzieb je pravdepodobné. Euro sa v marci voči švajčiarskemu franku zotavilo. Vysvetľujú to dva faktory: pokles averzie k riziku súvisiaci s vojnou na Ukrajine a zásahy Švajčiarskej národnej banky na obmedzenie zhodnocovania švajčiarskeho franku. Švajčiarska inflácia bola vo februári 2,2 % v porovnaní s 5,8 % v eurozóne za rovnaké obdobie. Pokračujúci pokles eura voči austrálskemu doláru v posledných mesiacoch je dosť pôsobivý. Dôvodom boli očakávania trhu o prvom zvýšení sadzieb Austrálskou centrálnou bankou (pravdepodobne v lete), ako aj rastúce ceny komodít. Očakáva sa, že oba faktory budú v krátkodobom až strednodobom horizonte pokračovať. V marci bol pár EUR/CNH takmer stabilný (-0,07 %). Domnievame sa, že čínske orgány sa zúfalo snažia udržať stabilný výmenný kurz svojej meny a zdá sa, že zatiaľ im pár EUR/CNH okolo 7,00 vyhovuje. Z ekonomického hľadiska sa situácia v Číne rapídne zhoršuje (čo naznačuje aj pokles najnovších ukazovateľov PMI). Vojna na Ukrajine a najmä nákladná nulová politika Covid implementovaná Pekingom (ktorá začína byť interne spochybňovaná) určite zabráni tomu, aby čínska ekonomika tento rok rástla tak, ako sa očakávalo.

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%	3,14%										8,37%