



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 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	€ 5,85 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	↑

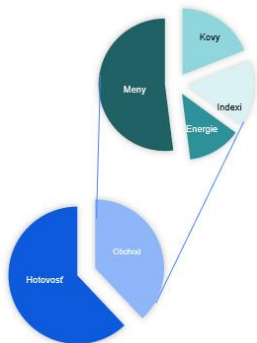
OTHERS

Mini- NASDAQ	-
SoyBean	-

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	3,40%
Zhodnotenie od založenia fondu	+87,75%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+23,23%
Počet obchodov za posl. mesiac	191
Max. drawdown from peak	4,86%
Sharpe ratio	0,77
Profit factor	2,61%
Positive trades	81,1%

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 apríl 2022 rast 3,40%. Aktuálne sme svedkami kolapsu eura voči americkému doláru. Prevádzkovatelia devízového trhu sa domnievajú, že inflačný problém a vojna na Ukrajine zasiahne eurozónu z ekonomického hľadiska viac ako Spojené štáty. Z krátkodobého hľadiska všetko nasvedčuje tomu, že pokles eura bude pokračovať. Z dlhodobšieho hľadiska by čínske oživenie mohlo mať pozitívny vplyv na výmenný kurz eura. Kým sa to však premietne do cien, určite potrvá niekoľko mesiacov. Operátori devízového trhu už niekoľko mesiacov očakávali, že euro sa v strednodobom horizonte bude voči britskej mene znehodnocovať. Výmenný kurz kanadského dolára je naďalej podporovaný kombináciou centrálnych banky v Kanade, ktorá sa jednoznačne rozhodla pre stratégiu zvyšovania sadzieb, a pokračujúcich vysokých cien komodít. Treba poznamenať, že v posledných dňoch ceny komodít mierne klesli v dôsledku poklesu čínskeho dopytu (40 % čínskej ekonomiky je v blokovaní). Vidíme proces všeobecného oslabovania japonského jenu (pozorovateľné napríklad aj voči americkému doláru a austrálskemu doláru). Diferenciál menovej politiky (centrálna banka Japonska zostáva ústretová, na rozdiel od všetkých ostatných centrálnych bánk) do značnej miery vysvetľuje znehodnotenie japonského jenu. Niet pochýb o tom, že centrálna banka Japonska ponechá svoju menovú politiku nezmenenú počas väčšiny tohto roka.

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%	3,40%									11,77%