



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	€ 5,95 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	↓

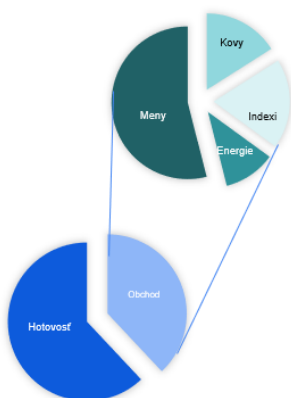
OTHERS

Kcw CBT	-
Lean Hogs	-

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	1,76%
Zhodnotenie od založenia fondu	+89,51%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+22,56%
Počet obchodov za posl. mesiac	171
Max. drawdown from peak	3,93%
Sharpe ratio	0,79
Profit factor	2,17%
Positive trades	79,3%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac máj 2022 rast 1,76%. Mesiac máj sa niesol v znamení dvoch hlavných trendov. Prvým bol rozsiahly pokles amerického dolára voči menám krajín G10 (najväčších svetových ekonomík) od polovice mája. Dôvodom bolo najmä celkové zlepšenie ochoty riskovať a sprísnenie krátkodobých sadziieb na dlhopisovom trhu. Pochybujeme, že pokles dolára bude trvať. Na menovom trhu je v súčasnosti príliš veľa provokujúcich faktorov. Dolár sa v krátkodobom horizonte zotaví. Druhým bol rast eura od polovice mája. Stalo sa tak v dôsledku naliehania Európskej centrálnej banky (ECB), že rýchlo zvýši sadzby, aby čelila inflácii. Ak chceme, aby euro v strednodobom horizonte smerovalo nahor, bude potrebné masívne a trvalé zvýšenie sadziieb. Nepredpokladáme, že sa tak stane. Z dlhodobého hľadiska sme naďalej presvedčení, že sme vstúpili do sveta silného dolára. Je preto nepravdepodobné, že by sa menový pár EUR/USD v najbližších mesiacoch ukotvil nad 1,10. Namiesto toho vidíme pár blízko 1,05-1,07. Rast EUR/CAD začal v polovici mája (podobný scenár pre EUR/USD). Bolo to spôsobené najmä zvýšením ochoty podstupovať riziko (v prospech jednotnej meny) a predovšetkým perspektívou rýchleho sprísnenia menovej politiky v eurozóne (od júla). Vzostupný trend však môže byť krátkodobý. Centrálna banka Kanady tiež výrazne sprísni finančné podmienky. V krátkodobom horizonte určite príde viac, aby sa spomalila inflácia, ktorá vrcholí na 30-ročnom maxime. Čína je v zložitej ekonomickej situácii. Krajina v posledných týždňoch iniciovala politiku podpory ekonomiky (prostredníctvom viacerých menových opatrení), aby vykompenzovala negatívny vplyv Covid politiky. Z krátkodobého hľadiska teda existuje veľká neistota, aký veľký manérovací priestor majú čínske orgány skutočne na to, aby vytiahli hospodárstvo zo súčasného obdobia slabšej aktivity, ak sa zameriame na ukazovatele aktivity služby a výrobné sektory.

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%	1,76%								13,53%