

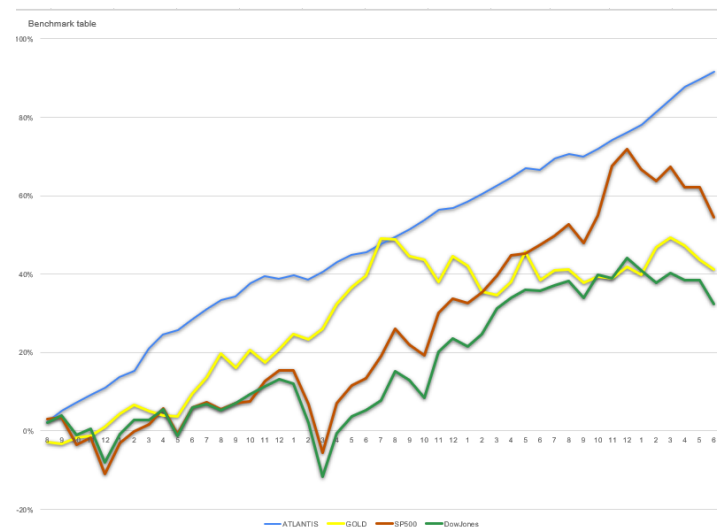


Obchodné portfólio privátneho algoritmického hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou 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	€ 6,07 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



KOMENTÁR

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac jún 2022 rast 2,07%. Index amerického dolára (DXY) naďalej tlačí vyššie – viac ako 1 %. Dolár naďalej nachádza dopyt ako bezpečný prístav pre investorov, ktorí hľadajú útočisko uprostred rastúcich obáv z recesie. Futures na amerických akciových indexoch klesajú medzi 0,8 % a 1 % a DXY sa obchoduje na najvyššej úrovni za takmer dve desaťročia nad 108,00. Výnos 10-ročných amerických štátnych dlhopisov klesol o viac ako 2 %, čo poukazuje na trhové prostredie averzie voči riziku. Na potlačenie nových infekcií variantov Omicron BA4 a BA5 čelí Čína lockdownu v Šanghaji. Európa medzitým čelí vysokým rizikám, že sa dostane do energetickej krízy. Mesačný prieskum spotrebiteľských očakávaní Federálnej rezervnej banky v New Yorku ukázal, že jednoročné inflačné očakávania amerických spotrebiteľov vzrástli v júni na 6,8 % zo 6,6 % v máji.

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	↓

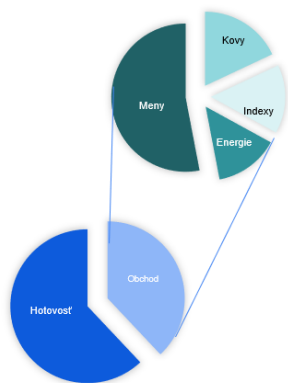
OTHERS

Mini- NASDAQ	-
SoyBean	-

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	2,07%
Zhodnotenie od založenia fondu	+91,58%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+25,05%
Počet obchodov za posl. mesiac	185
Max. drawdown from peak	3,84%
Sharpe ratio	0,81
Profit factor	2,20%
Positive trades	81,2%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

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%	2,07%							15,60%