

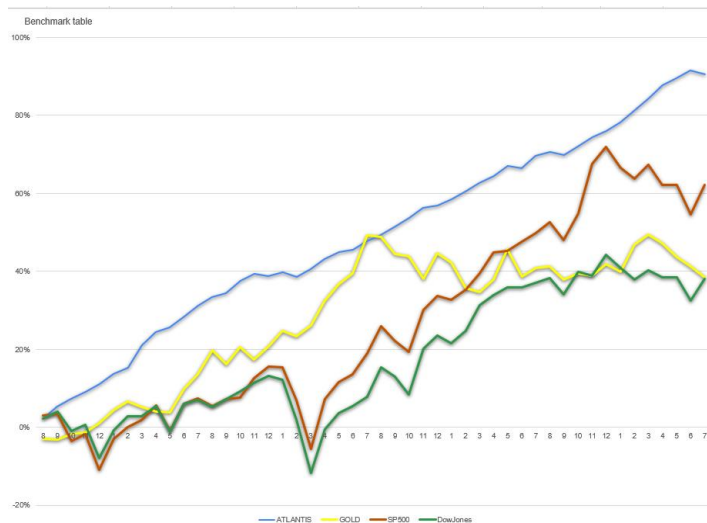


Obchodné portfólio privátneho algoritmického hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou 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 volatilite 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	€ 6,13 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	↑

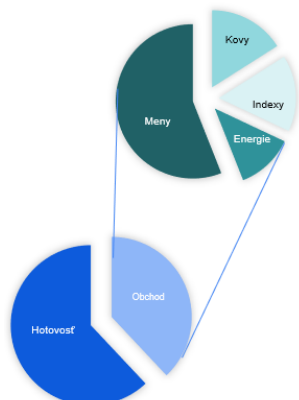
##### OTHERS

Kcw CBT	-
Lean Hogs	-

#### ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	-1,14%
Zhodnotenie od založenia fondu	+90,44%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+20,27%
Počet obchodov za posl. mesiac	169
Max. drawdown from peak	3,91%
Sharpe ratio	0,76
Profit factor	1,53%
Positive trades	71,8%

#### ALOKÁCIA VO FONDE



Naším cieľom je dlhodobou dosahovať výnosy nad trhovým priemerom a pri nízkej volatilite portfólia.

#### KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa  
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac júl 2022 pokles -1,14%. Toky hovoria samé za seba. Investori naďalej držia dlhé pozície v americkom dolári a sú short (predajcovia) v eurách. Rast sa spomaľuje na oboch stranách Atlantiku. Ekonomické spomalenie je však znepokojujúcejšie v eurozóne (energetická kríza, dôvera v priemysle na najnižšej úrovni, talianske politické riziko, pohltené dodávateľské reťazce atď.). Ak sa energetická kríza túto jeseň prehĺbi, eurozóna pravdepodobne vstúpi do recesie. To by zvýšilo tlak na zníženie jednotnej meny. Euro medzimesačne kleslo voči doláru o 2,32 %. Dôvodom je zhoršenie obchodných podmienok v dôsledku energetickej krízy. Úroveň inflácie v Spojenom kráľovstve sa blíži k 10 %. Nárast o 50 základných bodov je už zohľadnený v cenách ponúkaných trhom. To by malo mať tento týždeň malý vplyv na výmenný kurz EUR/GBP, ktorý je stále okolo svojho ťažiska na úrovni 0,85. Euro pokračuje v poklese voči švajčiarskemu franku. To je dobrá správa pre Švajčiarsku národnú banku (SNB), ktorá chce silnú menu, aby obmedzila importovanú infláciu. Táto stratégia je zatiaľ úspešná. Švajčiarsky frank si za posledné tri mesiace oproti jednotnej mene pripísal takmer 5 %. Depreciácia eura stále pokračuje.

#### 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%	-1,14%						14,46%