



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/>

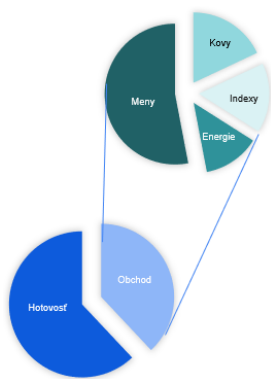
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Velkosť fondu	€ 6,46 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
Správčský poplatok	0,1% monthly
Vstupný poplatok	1,75%
Success fee	25%
Výstupný poplatok	0%
Cieľ ročného výnosu	15% - 30% p.a.
Stratégia	Alghos

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	1,43%
Zhodnotenie od založenia fondu	+91,87%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+21,17%
Počet obchodov za posl. mesiac	177
Max. drawdown from peak	3,43%
Sharpe ratio	0,83
Profit factor	1,65%
Positive trades	73,7%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

VÝKONNOSTNÝ GRAF



KOMENTÁR

JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac august 2022 rast 1,43%. Inflácia si v júli a auguste nevybrala dovolenku. Na oboch stranách Atlantiku naďalej zostáva na abnormálne vysokých úrovniach. To povzbudzuje centrálné banky, aby boli agresívnejšie. Niekoľko z nich tento mesiac čaká zvýšenie bodovej sadzby o 75 báz. bodov. (Federálny rezervný systém USA, Centrálna banka Kanady, Európska centrálna banka). Zostávame vo svete, kde je kráľom americký dolár. Od začiatku roka sa nesie v znamení svojich hlavných náprotivkov: +11,9 % voči euru, +9,4 % voči kanadskému doláru, +7,7 % voči austrálskemu doláru. Na zvrátenie trendu EUR/USD to však podľa nášho názoru stačiť nebude. Dlhohrvajúci pokles zostáva na mieste. Naš koncoročný cieľ zostáva nezmenený na úrovni 0,96. Určite k nemu dôjde, keď sa od jesene (október/november) prehĺbi energetická kríza, ktorá môže eurozónu uvrhnúť do recesie. Americký dolár zostáva podporovaný jednak agresívnejšou menovou politikou v USA (cyklus sprisňovania menovej politiky sa začal skôr ako v eurozóne), averziou voči riziku na trhoch a skutočnosťou, že vrchol inflácie je už určite prekonaný v USA (ktorá v eurozóne to zjavne neplatí). EUR/GBP Toto cenové pásmo bude potrebné v najbližších týždňoch pozorne sledovať. V prípade straty podpory by sme mohli vidieť výrazné znehodnotenie eura voči britskej libe. V tejto fáze to však nie je náš ústredný scenár. Skôr očakávame, že zostaneme v širokom rozsahu tesne nad 150 pips (medzi 0,8340 a 0,8500). V ekonomickom prostredí, ktoré sa bude zhoršovať (energetická kríza v Európe, realitná kríza v Číne, inflácia všade, zvýšené geopolitické riziko), veríme, že je rozumné byť short (predávajúci) EUR/JPY. Pokračuje znehodnocovanie eura voči kanadskému doláru (-9,7 % medziročne). Kanadský dolár je podporovaný stále vysokými cenami energií (napr. od januára vzrástla WTI o +23 %) a agresívnejšou menovou politikou v Kanade ako v eurozóne.

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	-

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%	1,43%					15,89%