

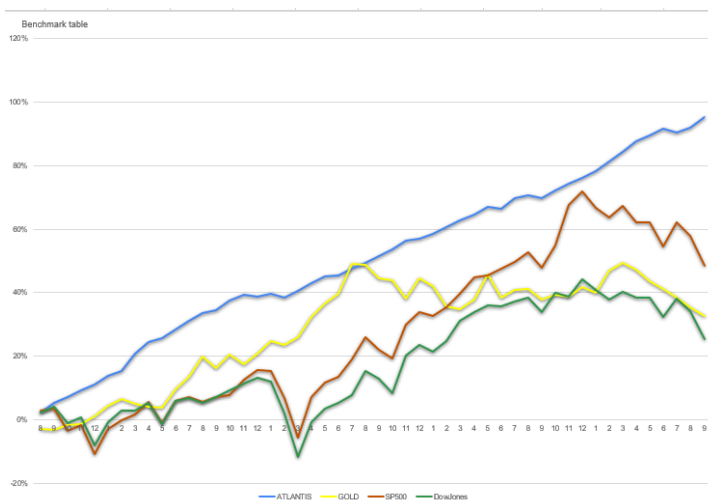


Obchodné portfólio privátneho algoritmického hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou 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
Veľkosť fondu	€ 6,68 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	↑

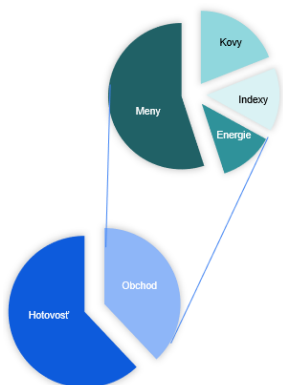
OTHERS

Kcw CBT	-
Lean Hogs	-

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	3,42%
Zhodnotenie od založenia fondu	+95,29%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+25,42%
Počet obchodov za posl. mesiac	185
Max. drawdown from peak	3,38%
Sharpe ratio	0,85
Profit factor	2,31%
Positive trades	81,6%

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 september 2022 rast 3,42%. Euro je voči americkému doláru podhodnotené. Je tiež jasné, že za normálnych okolností by to mohlo vyvolať silný technický odraz. Ale ako sme od júla niekoľkokrát videli, každý pokus o odraz sa skončil neúspechom. Tak tomu bolo opäť aj minulý týždeň. Dlhotrvalo znehodnocovanie eura je nevyhnutné. Libra je v zlej pozícii. Spolu s japonským jenom je to jedna z dvoch hlavných mien, voči ktorým sme v poslednej dobe zaznamenali silné špekulácie. Dva faktory, ktoré poháňajú libru nadol, sú ekonomický kolaps Spojeného kráľovstva (recesia sa očakáva na päť štvrtkov) a útek zahraničných investorov (nevyhnutný pre zabezpečenie životnej úrovne krajiny). Zhodnocovanie eura voči austrálskemu doláru odráža dva faktory: 1) vnímanie, že austrálska centrálna banka sa blíži ku koncu cyklu sprísňovania menovej politiky (hlavný podporný faktor pre austrálsky dolár v posledných mesiacoch); 2) pokles cien komodít (ktorý možno vysvetliť celkom logickým poklesom dopytu v čase recesie); a 3) premiestnenie obchodníkov s menami na euro (mnohí sú dávno po výraznom období znehodnotenia eura). Pochybujeme však, že tento vzostupný pohyb vydrží. Euro čaká ťažká zima. Čínska centrálna banka bola ďalším významným finančníkom, ktorý minulý týždeň intervenoval na devízovom trhu (pravdepodobne prostredníctvom čínskych štátnych bánk). To pomohlo obmedziť prudký a neočakávaný kolaps CNY voči USD.

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%	3,42%				19,31%