

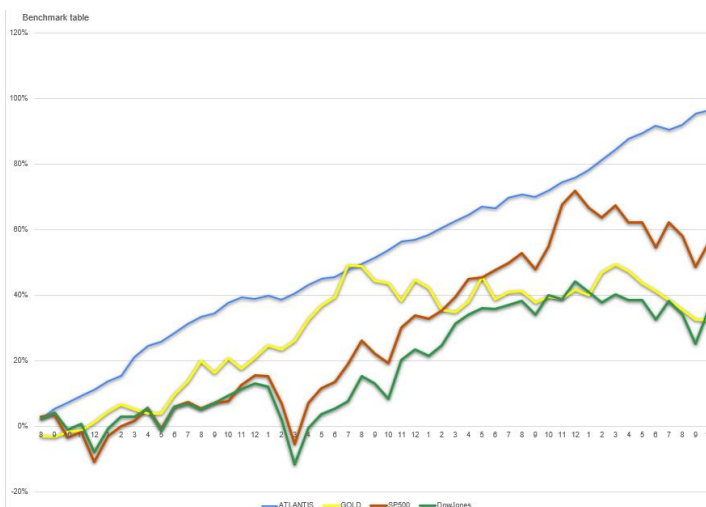


Obchodné portfólio privátneho algoritmického hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou 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
Veľkosť fondu	€ 6,75 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	↑

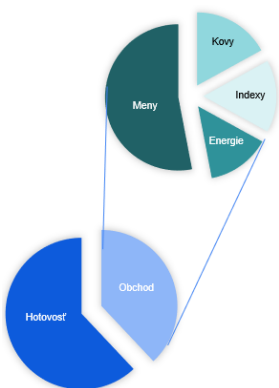
##### OTHERS

Mini- NASDAQ	-
SoyBean	-

#### ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	1,14%
Zhodnotenie od založenia fondu	+96,43%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+24,41%
Počet obchodov za posl. mesiac	156
Max. drawdown from peak	2,92%
Sharpe ratio	0,86
Profit factor	1,98%
Positive trades	76,7%

#### ALOKÁCIA VO FONDE



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

#### KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa  
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac október 2022 rast 1,14%. Eurozónu z krátkodobého hľadiska zaťažuje príliš veľa makroekonomických rizík. Patrí medzi ne recesia v Nemecku, ktorá by mohla byť masívna, riziko postupných výpadkov elektriny vo viacerých krajinách, stúpajúca inflácia, ktorá sa šíri do všetkých oblastí ekonomiky a tu a tam aj prasknutie bublín na trhu s nehnuteľnosťami. V tejto súvislosti Európska centrálna banka nemá inú možnosť, ako zostať v automatickom pilotnom režime a pokračovať v sprisňovaní menovej politiky. V posledných týždňoch Centrálna banka Japonska presadzovala stratégiu priamej intervencie na devízovom trhu, aby podporila japonský jen. Cieľom je posilniť menu krajiny voči americkému doláru (ale má to dopad aj na EUR/JPY). Táto stratégia bola, mierne povedané, žalostným zlyhaním. V priebehu minulého týždňa centrálna banka vložila 30 miliárd dolárov (predajom dolárov a nákupom jenov) bez toho, aby sa jej podarilo spomaliť pokles miestnej meny. Ako už dávno vieme, nekoordinované zásahy centrálnej banky nikdy neuspjú. Preto očakávame, že japonský jen bude v krátkodobom a strednodobom horizonte naďalej oslabovať. Ekonomika Spojeného kráľovstva má všetky znaky rozvíjajúcej sa ekonomiky: prepad svojej meny voči doláru, politickú nestabilitu, bublinu na trhu s nehnuteľnosťami, bezprecedentné účty za energiu, prudko stúpajúci deficit bežného účtu. Naďalej sa vyhýbame aktívam v Spojenom kráľovstve opatrne a odporúčame prijať solídnu stratégiu menového hedgingu, ak ste vystavení britskej mene. EUR/CNH Čínske úrady teraz uprednostňujú pomalé znednodcovanie CNH, aby pomohli stimulovať export. Okamžite však budú obsahovať akúkoľvek volatilitu, ktorú považujú za nadmernú. Na základe dostupných trhových údajov sa zdá, že Čínske komerčné banky (na žiadosť vlády) tento týždeň zasiahli, aby podporili výmenný kurz miestnej meny aby obmedzili tlak nadol. Táto situácia bude pravdepodobne v krátkodobom horizonte pokračovať.

#### 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%	1,14%			20,45%