

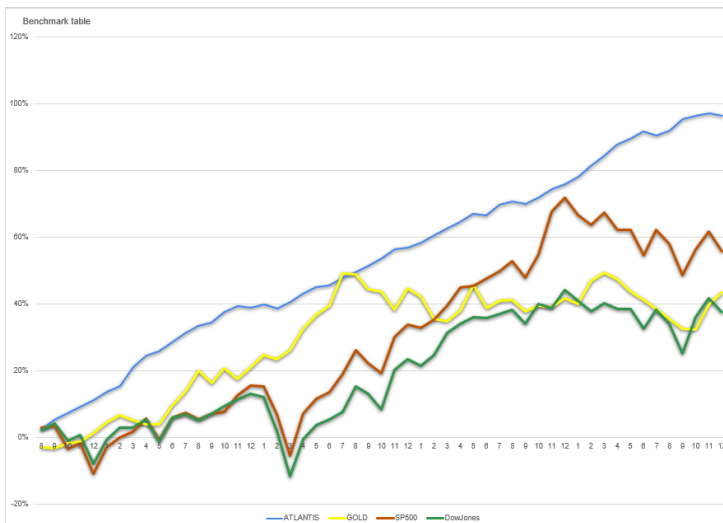


Obchodné portfólio privátneho algoritmického hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou 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	€ 6,83 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	↓

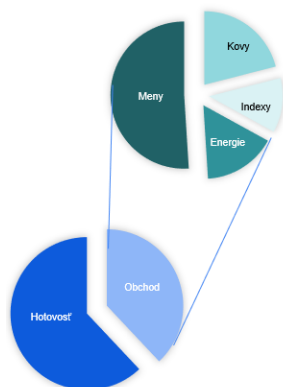
##### OTHERS

Kcw CBT	-
Lean Hogs	-

#### ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	-0,67%
Zhodnotenie od založenia fondu	+96,40%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+20,42%
Počet obchodov za posl. mesiac	108
Max. drawdown from peak	2,93%
Sharpe ratio	0,76
Profit factor	1,42%
Positive trades	69,1%

#### ALOKÁCIA VO FONDE



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

#### KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa  
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac december 2022 pokles -0,67%. Analytici predpovedali prepád eura. To sa nakoniec neuskutočnilo. Európska mena uzavrela rok pozitívnejšie, ako sa očakávalo. EUR/AUD a EUR/CAD dokonca skončili v kladnom pásme s medziročným nárastom o 1,2 %, resp. 0,39 %. Kurz EUR/USD bol v priebehu roka stále nižší o 6,66 %, no v priebehu troch mesiacov tento pár zaznamenal pôsobivý obrat. Konsenzus Bloomberg teraz očakáva, že kurz EUR/USD skončí v roku 2023 okolo 1,08 (vs. 1,06 dnes). Toto je určite nereálne. Musíme pokorne uznať, že prognózy menového trhu na obdobie po 3-6 mesiacoch sú nespoľahlivé. Oživenie kurzu EUR/GBP v decembri odráža zmenu nálady na trhu voči euru. Očakávame, že libra bude v roku 2023 naďalej odpisovať, aj keď v obmedzenom rozsahu. Závažnejšia hospodárska kríza v Spojenom kráľovstve a skutočnosť, že Bank of England je bližšie ku koncu cyklu sprísňovania sadzieb ako Európska centrálna banka, poukazujú na ďalší pokles britskej meny. Centrálna banka Japonska pár dní pred Vianocami zaskočila investorov oznámením úpravy menovej politiky. Jej rozhodnutie uvoľniť kontrolu nad výnosmi japonských vládnych dlhopisov analytici interpretovali ako znamenie, že centrálna banka Japonska postupne ukončí svoju ultra-akomodatívnu menovú politiku, aby sa vysporiadala s infláciou (na 41-ročnom maxime). Peňažný trh si myslí, že centrálna banka môže v marci zvýšiť svoju menovú sadzbu o 10 bázických bodov. Išlo by o prvé takéto zvýšenie za posledných desaťročia a mohlo by poskytnúť silnú podporu japonskému jenu voči jeho hlavným protistranám. Myslíme si, že Švajčiarska národná banka bude v tomto roku patriť medzi centrálny banky, ktoré výrazne sprísnia svoju menovú politiku. Toto bude kľúčový podporný faktor pre švajčiarsku menu.

#### 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%	0,64%	-0,67%	20,42%