



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/>

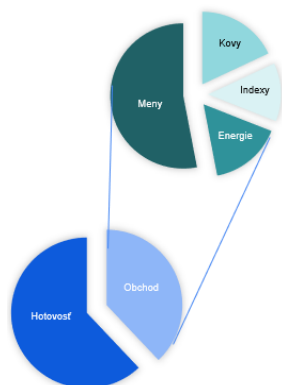
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 6,79 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

ŠTATISTIKY FONDU

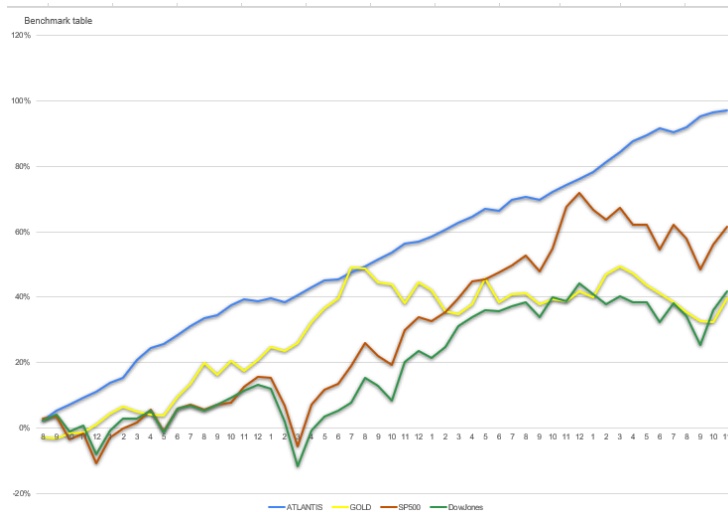
Zhodnotenie za posl. mesiac	0,64%
Zhodnotenie od založenia fondu	+97,07%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	+22,72%
Počet obchodov za posl. mesiac	137
Max. drawdown from peak	2,76%
Sharpe ratio	0,82
Profit factor	1,82%
Positive trades	75,4%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

VÝKONNOSTNÝ GRAF



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

KOMENTÁR

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac november 2022 rast 0,64%. Za jeden mesiac sa dolárový index (ktorý predstavuje kolísanie amerického dolára voči menám hlavných obchodných partnerov Spojených štátov amerických) prepadol o pozoruhodných 4,19 %. Hlavným vysvetlením je, že mnohí prevádzkovatelia trhu predpovedajú spomalenie tempa zvyšovania sadzieb v USA teraz, keď inflácia dosiahla vrchol. Medzitým euro vykazuje pomerne pozoruhodnú odolnosť voči niekoľkým menám. Ale boj proti americkému doláru ešte nie je vyhratý. EUR/GBP Finančné trhy trochu upokojilo predstavenie rozpočtu Spojeného kráľovstva na rok 2023 (po neúspechu septembrového minirozpočtu, ktorý spôsobil mini finančnú paniku). Napriek tomu sa snažíme zistiť, ako by britská libra mohla v nasledujúcich mesiacoch silne fungovať. Ekonomika Spojeného kráľovstva má obrovské problémy s dvojcifernou infláciou, hlbokou a trvalou recesiou, dramatickým poklesom kúpnej sily a energetickou krízou. To podnieti investorov, aby zaujali krátke (predajné) pozície na britskú menu (ako je tomu už od februára 2022). EUR/JPY Inflácia sa v Japonsku začína stávať vážnym problémom (index spotrebiteľských cien bol v novembri medziročne vyšší o 3,6 %). Boj zatiaľ zostáva optimistický a tvrdí, že inflácia sa začne na jar budúceho roka znižovať. EUR/CNH Hrozí, že znehodnotenie čínskej meny sa v krátkodobom horizonte zrychlí, keďže úrady sa snažia podporiť ekonomiku, ktorá sa na konci tohto roka zmieta v opätovnom náraste prípadov Covid a uvalení prísnych blokad.

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	-

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%		21,09%