

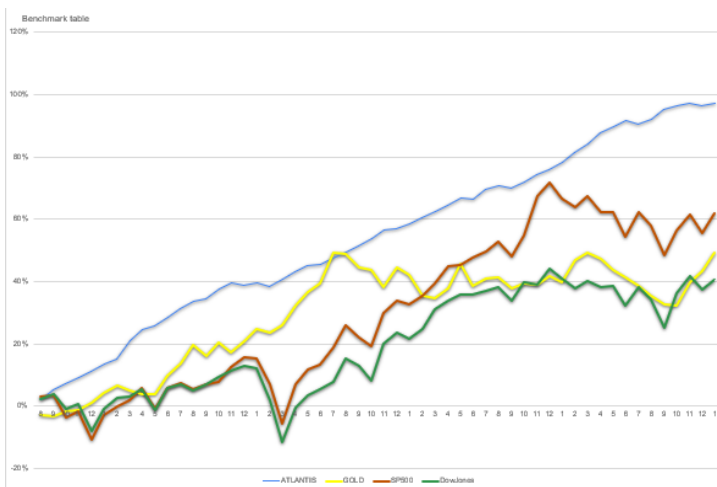


Obchodné portfólio privátneho algoritmickeho hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou automatických obchodných stratégií založených na systematickom a algoritmickej 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	€ 6,56 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
Správčovský 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	↓

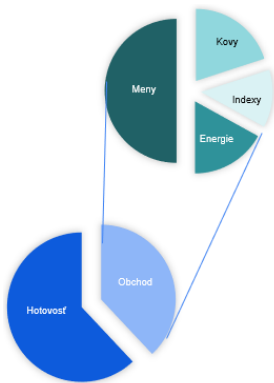
OTHERS

Mini- NASDAQ	-
SoyBean	-

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	0,96%
Zhodnotenie od založenia fondu	97,36%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	19,21%
Počet obchodov za posl. mesiac	120
Max. drawdown from peak	2,11%
Sharpe ratio	0,69
Profit factor	1,95%
Positive trades	78,7%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmickej hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac január 2023 rast 0,96%. Na začiatku tohto roka je kľúčovou otázkou, kedy centrálné banky pozastavia cyklus sprísňovania sadzieb. Podľa nášho názoru, úrokové sadzby zostanú vysoké počas dlhšieho obdobia, očakávaná zníženia sadzieb, ktoré sa na trhu uchytili v druhej polovici minulého roka, sú jednoznačne mylné. Prostredie vysokých úrokových sadzieb má ešte dlho prevládať (čo znamená prísnejšie finančné podmienky). EUR/USD zaznamenal v januári silnú rally. Dôvodom bola skutočnosť, že o ekonomickej trajektórii eurozóny bolo viac dobrých ako zlých správ. Obávaná recesia sa nakoniec neobjavila. Z krátkodobého hľadiska je nepravdepodobné, že by menová politika bola vysoko diferenciálnym faktorom pre smerovanie EUR/USD. EUR/GBP je jedným z menových párov, o ktorých máme najmenej pochybností, pokiaľ ide o jeho trajektóriu v krátkodobom a strednodobom horizonte. Predpovedáme vyberanie ziskov na páre EUR/GBP, najmä po jeho excelentnom výkone z minulého týždňa. Podľa nášho názoru však trend zostáva stúpajúci. Trh predpovedal sprísnenie japonskej menovej politiky (kvôli prudko rastúcej inflácii), to sa však nenaplnilo. Zmena guvernéra japonskej centrálnej banky v apríli budúceho roka bude pravdepodobne príležitosťou na strategickú revíziu menovej politiky. Švajčiarskej mene by sa malo tento rok dať. Očakávame, že Švajčiarska národná banka si nejaký čas zachová jastrabie tóny (v prospech sprísnenia menovej politiky), keďže narastajú obavy z vysokej inflácie.

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%
2023	0,96%												0,96%