

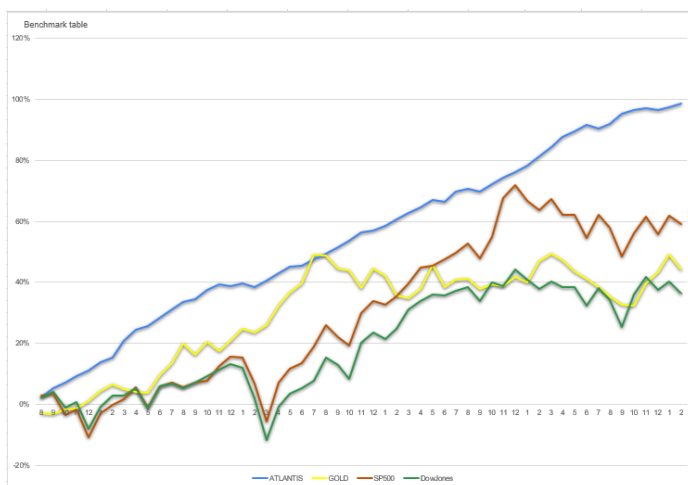


Obchodné portfólio privátneho algoritmického hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou 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
Velkosť fondu	€ 5,61 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	↑

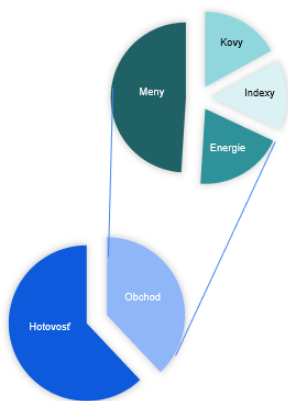
OTHERS

Kcw CBT	-
Lean Hogs	-

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	1,25%
Zhodnotenie od založenia fondu	98,61%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	17,40%
Počet obchodov za posl. mesiac	131
Max. drawdown from peak	2,48%
Sharpe ratio	0,77
Profit factor	2,08%
Positive trades	80,1%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac február 2023 rast 1,25%. EUR/USD má z krátkodobého hľadiska opäť klesajúci trend. Po prudkom náraste na začiatku roka to dáva určitý zmysel. Pri zaujatí extrémnych pozícií na menovom trhu (v tomto prípade na strane nákupu) možno následne očakávať, že sa kyvadlo

opäť kýva späť. Sme naďalej presvedčení, že euro má v strednodobom horizonte stále potenciál rastu, najmä vzhľadom na dynamiku inflácie, ktorá prinúti Európsku centrálnu banku (ECB) niekoľkokrát zvýšiť svoju menovú sadzbu. Do leta predpovedáme koncovú sadzbu 4%. Ak sa inflácia nepodarí zmierniť, táto miera môže byť ešte vyššia. Medzimesačne EUR/CHF klesol o -0,30%. To je v súlade s našimi prognózami na zvyšok roka. Očakávame, že CHF bude výkonnejší ako euro, keďže Švajčiarska národná banka (SNB) je nastavená byť pozornejšia (v prospech sprísnenia menovej politiky) ako ECB. Náš scenár pre pár EUR/CAD sa nemení. Chýbajúca dynamika rastu cien ropy v krátkodobom horizonte spolu s vyhlídkou na prerušenie menovej politiky v Kanade bude v strednodobom horizonte zaťažovať CAD. Stále predpovedáme prudký nárast ceny ropy z druhej polovice roka pod vplyvom čínskeho dopytu. To musí pomôcť CAD. Medzitým je dynamika pre EUR/CAD pozitívna. Vo februári Austrálska centrálna banka prekvapila devízový trh tým, že neoznámila prestávku v menovej politike, čo spôsobilo prepád EUR/AUD. Z dlhodobého hľadiska bude AUD pravdepodobne profitovať z opätovného otvorenia Číny (kvôli úzkym ekonomickým väzbám medzi Austráliou a Čínou). Z krátkodobého hľadiska má však trh jednoznačne nákupnú pozíciu na páre EUR/AUD, čo nám naznačuje, že fáza zhodnocovania sa zjavne neskončila.

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%	1,25%											2,21%