

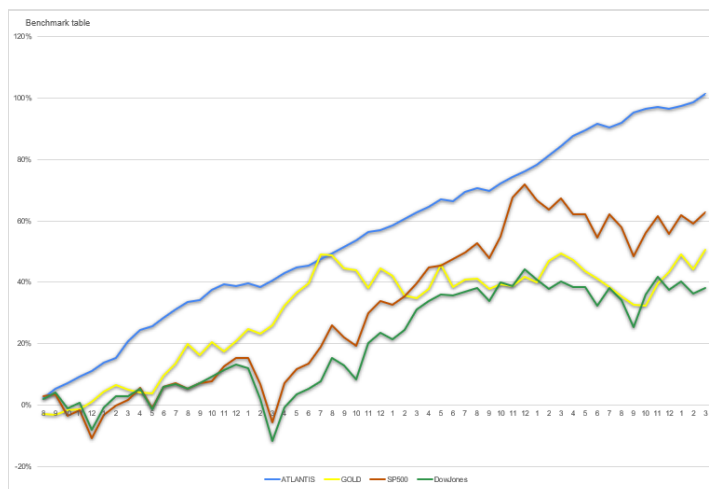


Obchodné portfólio privátneho algoritmického hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou 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	€ 5,76 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	↓

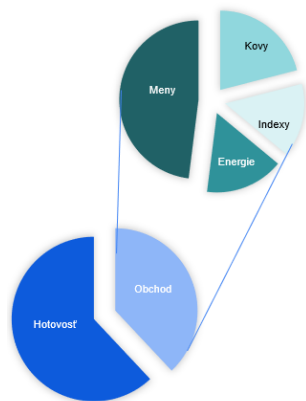
OTHERS

Mini- NASDAQ	-
SoyBean	-

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	2,81%
Zhodnotenie od založenia fondu	101,42%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	17,07%
Počet obchodov za posl. mesiac	163
Max. drawdown from peak	3,24%
Sharpe ratio	0,79
Profit factor	2,62%
Positive trades	84,8%

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 marec 2023 rast 2,81%. V marci sa objavili náznaky hrozacej finančnej krízy. Bankové modely, najmä tie, ktoré majú problémy so ziskovosťou, znepokojili rast úrokových sadzieb, ktorý vyvolala snaha bojovať proti pretrvávajúcej inflácii. Napätie sa však čoskoro zmiernilo vďaka rýchlemu konaniu centrálnych bánk, ktoré dodali likviditu bankám v núdzi a podnietili procesy fúzií a akvizícií. Apríl, poznačený niekoľkými zasadnutiami centrálnej banky, vyzerá byť pokojnejší. Euro bolo v marci vysoko volatilné v dôsledku rastúceho napätia v bankách. No pár EUR/USD sa nakoniec vrátil do pásma okolo 1,09. Pred niekoľkými týždňami sa medzi analytikmi diskutovalo o tom, či americký dolár vyjde silnejší z obdobia bankového stresu. Ako ukazuje výkonnosť páru GBP/USD v marci, odpoveď je nie. Na mesačnej báze predviedla dvojica vynikajúci výkon 2,99 %. Tento nárast sa podľa nášho názoru vysvetľuje skôr znehodnotením amerického dolára než obnovenou dôverou v britskú menu. Trh sa snaží, že napätie v bankách spôsobí, že ponuka úverov sa zníži (prehĺbený rast) a prinúti americkú centrálnu banku ukončiť cyklus sprisňovania menovej politiky skôr, ako sa plánovalo.

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%	2,81%										5,02%