



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	€ 6,0 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	↑

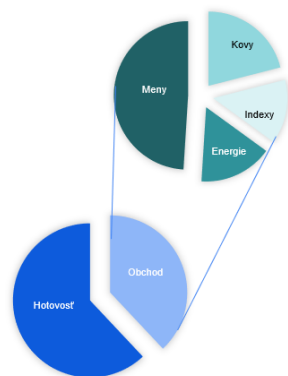
OTHERS

Kcw CBT	-
Lean Hogs	-

ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	0,56%
Zhodnotenie od založenia fondu	101,98%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	14,23%
Počet obchodov za posl. mesiac	116
Max. drawdown from peak	2,81%
Sharpe ratio	0,79
Profit factor	1,83%
Positive trades	77,1%

ALOKÁCIA VO FONDE



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

KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac apríl 2023 rast 0,56%. Stav amerického bankového sektora však naďalej vyvoláva obavy. V nasledujúcich mesiacoch a štvrtroch možno očakávať ďalšie bankroty bánk. To nevyhnutne neznamená, že americká ekonomika vstúpi do recesie. V 80. rokoch kolaps série amerických sporiteľní tento scenár neprinesol. Riziko je však oveľa vyššie ako len pred dvoma alebo tromi mesiacmi. Vývoj v americkom bankovom sektore bude podľa nášho názoru tento rok hlavným motorom finančných trhov, najmä mien. Americká centrálna banka (Fed) oznámila prerušenie menovej politiky po zvýšení kľúčovej sadzby o 25 bázických bodov. Na rozdiel od toho Európska centrálna banka potvrdila, že na zníženie inflácie bude potrebné ďalšie zvyšovanie sadzieb (pravdepodobne v júni). Úrokový diferenciál medzi oboma stranami Atlantiku by mal logicky podporiť euro. Neočakávame, že výrazná nedostatková výkonnosť dolára v prvom štvrtroku bude v krátkodobom horizonte pokračovať, najmä kvôli obavám o americký bankový sektor. Na libre je zarážajúce, že jej výkonnosť je úplne oddelená od ekonomických základov Spojeného kráľovstva. Keďže náklady na dlh sa zdvojnásobili na 12 % HDP v priebehu iba dvoch rokov (vyššie ako v ktorejkoľvek krajine eurozóny), existuje dôvod domnievať sa, že Spojené kráľovstvo bude čoskoro čeliť náročným fiškálnym rozhodnutiam. Inými slovami, úspornosť sa javí ako nevyhnutná. Napriek tomu to pravdepodobne nebude mať žiadny vplyv na menu Spojeného kráľovstva.

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%	0,56%									5,58%