

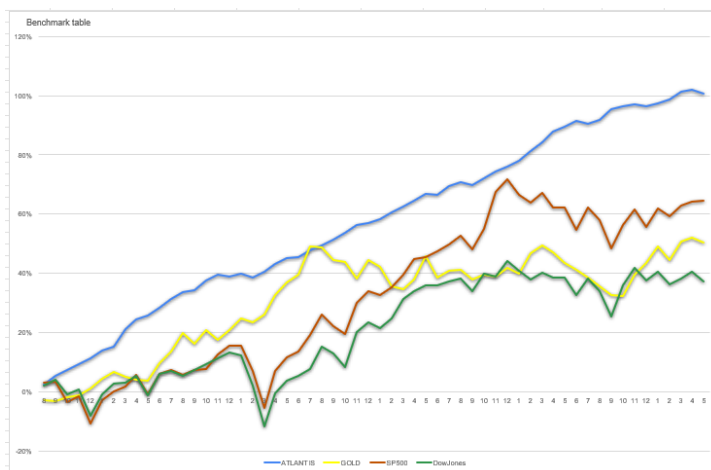


Obchodné portfólio privátneho algoritmického hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou 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	€ 6,07MM
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	↑

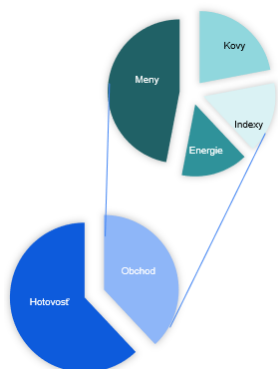
##### OTHERS

Mini- NASDAQ	-
SoyBean	-

#### ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	-1,18%
Zhodnotenie od založenia fondu	100,80%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	11,29%
Počet obchodov za posl. mesiac	127
Max. drawdown from peak	3,02%
Sharpe ratio	0,75
Profit factor	1,52%
Positive trades	69,1%

#### 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 máj 2023 pokles -1,18%. V priebehu mesiaca došlo k nepríjemnej strate na zlate a rope, kde nastali prudké pohyby v rámci nízkej likvidity. Zo sezónneho hľadiska je máj pre americký dolár vo všeobecnosti pozitívny mesiac. To sa opäť raz potvrdilo. Euro začalo dlho klesať, čo odráža tak neistotu ohľadom výhľadu menovej politiky v krátkodobom horizonte, čisto technickú úpravu (extrémne nákupné pozície na eure, čo vedie k uvoľneniu pozícií) a ekonomické podmienky, ktoré sa v eurozóne rýchlejšie oslabujú než v USA. Na libře je úžasné to, že nech sa deje čokoľvek na makroekonomickom fronte, britská mena je odolná. Jadrová inflácia, skutočný barometer inflačných tlakov, medziročne vzrástla zo 6,2% na 6,8 %. Inflácia potravín nevykazuje žiadne hmatateľné známky spomalenia (19,1 %). To všetko prispieva k masívnemu ochudobneniu populácie Spojeného kráľovstva. Napriek tomu je šterling v dobrom zdravotnom stave. Toto je dokonalý príklad meny úplne odpojenej od základov svojej ekonomiky. EUR/CNH Dvojica zaznamenala negatívnu mesačnú odchýlku. V posledných týždňoch CNH vykazovala značné známky slabosti, čo odráža sériu slabých čínskych ekonomických štatistík. Navzdory očakávaniam bude oživenie Číny veľmi pomalé a bude ho poháňať najmä export. Dopyt stále klesá. Teraz možno očakávať stimulačné opatrenia Čínskej ľudovej banky. EUR/JPY Našťastie pre euro tu bol japonský jen, ktorý mu umožnil v máji vykázat solidný výkon. Trend dvojice je stále stúpajúci. Mnoho obchodníkov verí, že veľmi vysoká inflácia v Japonsku prinúti centrálnu banku konať (to by teoreticky mohlo podporiť japonský jen). Netreba však podceňovať nečinnosť centrálnej banky. Začiatkom roka bol trh plný špekulácií o odchode z ultrakomodatívnej menovej politiky. Podľa nášho názoru má v súčasnosti status quo. To prispieva k pokračujúcemu zhodnocovaniu páru EUR/JPY.

#### 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%	-1,18%								4,40%