

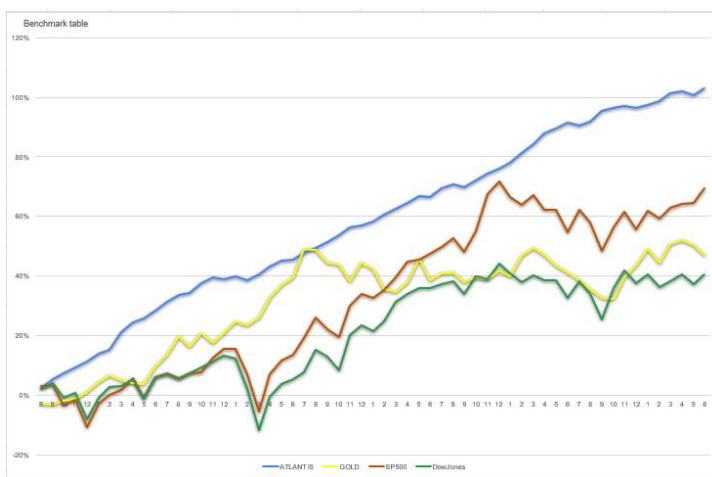


Obchodné portfólio privátneho algoritmického hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou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

#### FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 6,08MM
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	↓

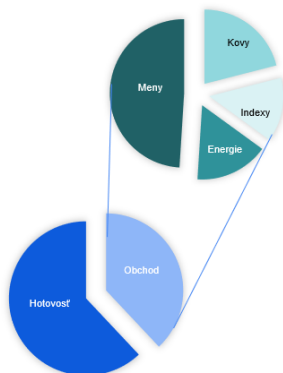
##### OTHERS

Kcw CBT	-
Lean Hogs	-

#### ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	2,14%
Zhodnotenie od založenia fondu	102,94%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	11,36%
Počet obchodov za posl. mesiac	131
Max. drawdown from peak	2,20%
Sharpe ratio	0,77
Profit factor	2,43%
Positive trades	82,5%

#### ALOKÁCIA VO FONDE



#### KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa  
CEO company

Privátny algoritmický hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac jún 2023 rast 2,14%. Každý rok sa poprední svetoví politici stretávajú v Sintre, stredne veľkom meste v Portugalsku, ktoré je známe krásou svojich hradov a blízkosťou k úchvatným miestam. Toto je ideálne miesto na uvažovanie o budúcnosti sveta a zmenách menovej politiky. Zvyčajne toto stretnutie nie je hlavná udalosť, ale tento rok bol iný. Posolstvo centrálnych bankárov bolo jednoznačné: svet po Covide je komplikovanejší, korelácie z minulosti už neplatia a inflácia sa nehybe, takže náklady na peniaze sa budú musieť výrazne zvýšiť. Nedá sa z toho dostať: zvyšovaniu sadzieb ešte nie je koniec. EUR/USD Euro sa odrazilo späť. Lopta je však na strane amerického dolára. Usilujeme o to, aby sme zistili, aký katalyzátor by mohol vrátiť euro späť k jeho nedávny maximám okolo 1,125. Naopak, pozadie dosť podporuje americký dolár. Mene pomáha skutočnosť, že trh podcenil pretrvávanie inflácie (a teda aj potrebu zvýšiť úrokové sadzby). Podcenila tiež odolnosť americkej ekonomiky, čím posunula možnosť recesie o niečo ďalej. K tomu sa pridalo, že dolár sa stal opäť vysoko atraktívnym v stratégiách carry trade (ktoré sa snažia využiť rozdiely v úrokových sadzbách medzi rôznymi ekonomickými regiónmi). Podmienky sú zrelé na zhodnotenie dolára. EUR/GBP Sme presvedčení, že libra v nasledujúcich mesiacoch prekoná euro, pretože Centrálna banka Anglicka potrebuje výrazne zvýšiť úrokové sadzby. V Spojenom kráľovstve sa inflácia stáva do značnej miery štruktúrnou a z minulosti vieme, že návrat k normálu môže priniesť iba rozhodné opatrenie v oblasti úrokových sadzieb. Toto je hlavná podpora pre šterlingov. Euro pokračuje v raste voči japonskému jenu v dôsledku rozhodnutia Centrálnej banky Japonska zachovať ultraakomodatívnu menovú politiku (na rozdiel od iných centrálnych bánk). Japonské úrady však začína znepokojovať slabosť jenu. Nie je vylúčené, že sa táto obava v krátkodobom horizonte premietne do priamych zásahov na menovom trhu (ako tomu bolo v septembri 2022). Toto leto bude preto potrebná ostražitosť.

#### 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%	2,14%							6,54%

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