

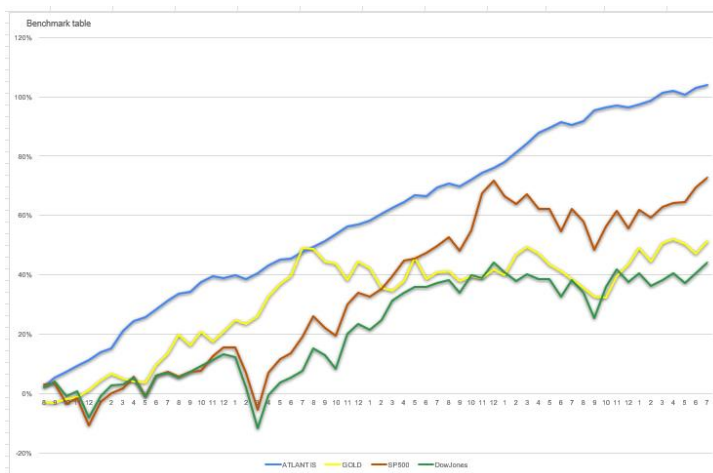


Obchodné portfólio privátneho algoritmického hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou 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	€ 6,14MM
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	↓

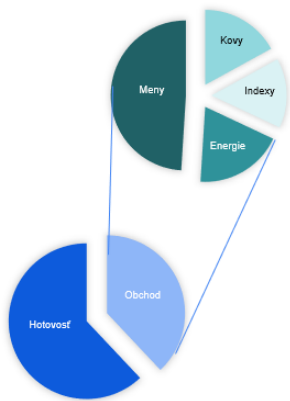
##### OTHERS

Mini- NASDAQ	-
SoyBean	-

#### ŠTATISTIKY FONDU

Zhodnotenie za posl. mesiac	+1,15%
Zhodnotenie od založenia fondu	104,09%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	13,65%
Počet obchodov za posl. mesiac	104
Max. drawdown from peak	2,04%
Sharpe ratio	0,77
Profit factor	2,07%
Positive trades	79,5%

#### 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 júl 2023 rast 1,15%. Dvojica mesiacov: EUR/GBP, Sterling je mena, ktorú treba tento mesiac sledovať a to z dvoch dôvodov. Po prvé, Centrálna banka Anglicka sa má stretnúť 3. augusta a existuje neistota ohľadom rozsahu budúceho zvýšenia sadzieb. Po druhé, čisté dlhé pozície v librách sú na historickom maxime. Skôr či neskôr určite dôjde k opätovnému vyváženiu, a ak k tomu dôjde, keď trh bude čeliť kríze likvidity, ako je tomu dnes, mohlo by to spôsobiť vážne výkyvy výmenného kurzu. Veľmi vysoká volatilita páru EUR/USD odráža úpravu očakávaní pre eurozónu. V posledný júlový týždeň zaznamenal obchodne vážený výmenný kurz eura (meradlo toho, či je euro nadhodnotené alebo podhodnotené) najprudší týždenný pokles od mája. Bolo to spôsobené nahromadením slabých štatistík v eurozóne. Operátori si uvedomili, že doteraz boli príliš optimistickí, pokiaľ ide o vyhliadky eura. Táto úprava by mohla krátkodobo pokračovať a viesť k ďalšiemu znehodnoteniu eura. Od júna čínska vláda prostredníctvom verejných bánk, ktoré nazhromaždili obrovský objem menových rezerv, intervenovala na onshore a offshore trhu, aby obmedzila znehodnotenie CNH. Nedávne znehodnotenie páru EUR/CNH však tieto intervencie neodráža. V skutočnosti si trh pravdepodobne uvedomil, že euro je trochu nadhodnotené vzhľadom na oslabené základy eurozóny. Pokračujúce vyvažovanie páru môže trvať niekoľko týždňov. V strednodobom horizonte je však stúpajúci trend stále nedotknutý.

#### 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%	1,15%						7,69%