



Obchodné portfólio privátneho algoritmickeho 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 algoritmickej 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/>

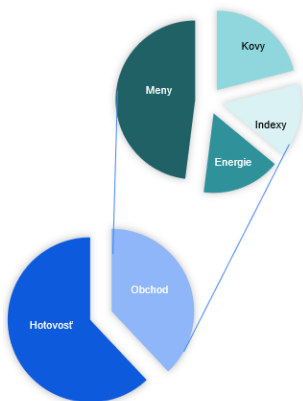
#### FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Velkosť fondu	€ 6,28MM
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

#### ŠTATISTIKY FONDU

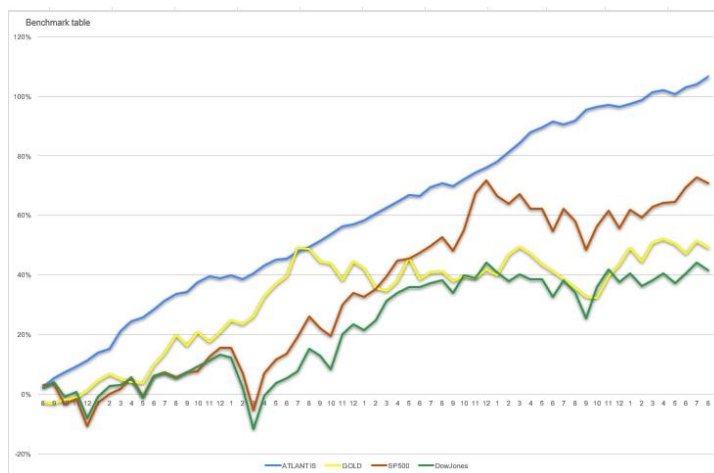
Zhodnotenie za posl. mesiac	+2,38%
Zhodnotenie od založenia fondu	106,47%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	14,06%
Počet obchodov za posl. mesiac	135
Max. drawdown from peak	2,09%
Sharpe ratio	0,79
Profit factor	2,33%
Positive trades	84,8%

#### ALOKÁCIA VO FONDE



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

#### 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	-

#### KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa  
CEO company

Privátny algoritmickej hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac august 2023 rast 2,38%. EUR/USD Eurozóna len ťažko mohla skončiť leto na horšom základe, s prepadom indexov aktivity PMI, poklesom indexu podnikateľskej dôvery IFO v Nemecku a oslabením trhu práce. To všetko vytvára obraz ekonomiky v recesii v treťom štvrtroku a dodáva dôveryhodnosť možnej prestávke menovej politiky zo strany Európskej centrálnej banky v septembri. V dôsledku slabých augustových indikátorov klesol EUR/USD pod svoj 200-dňový kľuzový priemer na 1,0805. Ide o dôležitý technický signál, ktorý potvrdzuje scenár pokračujúceho klesajúceho trendu. To, čo je na libre tak skvelé, je jej odolnosť bez ohľadu na to, čo sa deje na ekonomickom fronte. Údaje zo Spojeného kráľovstva sú slabé. Augustové PMI dosiahlo najnižšiu úroveň od januára 2021 na vrchole blokady. To je v súlade s poklesom HDP v treťom štvrtroku o 0,2%. A napriek tomu bol Sterlingov výkon celkom slušný. Pochybujeme, že aj prípadná recesia v Spojenom kráľovstve by mohla mať závažné nepriaznivé dôsledky na britskú menu. Čína je v biednom stave. V minulosti krajina používala výmenný kurz juanu, ako rýchlu a účinnú stimulačnú páku. Pokles výmenného kurzu meny zvyšuje cenovú konkurencieschopnosť čínskych firiem. To je teória. Realita je zložitejšia. Najnovšie intervencie čínskej centrálnej banky nemali za cieľ znížiť juan, ale posilniť ho voči americkému doláru. To vrhá svetlo na intenzívnu diskusiu vo vláde o tom, akú stratégiu prijať pre menu. EUR/AUD dvojica predviedla v auguste pôsobivú rally, ale predpokladáme určité vyberanie ziskov. Menové trhy tiež začínajú zdražovať po prestávke v menovej politike v Austrálii, čo nepochybne trochu prirzdilo dynamiku AUD. Ak ste využili august na to, aby ste sa vyhli menovému trhu, nič vám v súvislosti s párom EUR/JPY neušlo. Mesačné minimum bolo rovnaké ako minulý mesiac. Veľká väčšina ekonómov predpovedá, že Centrálna banka Japonska ponechá svoju menovú politiku nezmenenú minimálne do júla 2024.

#### 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%	2,38%					10,07%