

Obchodné portfólio alternatívneho investičného 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 podkladových aktív. Fond sa snaží dosahovať svoje ciele implementáciou portfólia systematických, algoritmických obchodných modelov a semiautomatického prístupu s využitím dlhodobých skúseností z diskrečného obchodovania. Obchodné portfólio zahŕňa viaceré aktíva trhu s kovmi, menovými nástrojmi, indexami a energetickými aktívami. Realizácia jednotlivých obchodov prebieha na regulovaných, centralizovaných a derivátových trhoch. Stratégia uskutočňuje dlhé a krátke pozície s cieľom profitovať z identifikovaných krátkych, stredných a sezónnych trendov a trendov plynúcich z opakujúcich sa patternov, cenových formácií. Systém dokáže v kritických situáciách a pri vysokej volatilitate aplikovať hedge obchodný prístup. Cieľom portfólia, ktoré je kalibrované z ~ 50 logicky odlišných obchodných systémov, je poskytovať zisk každý mesiac. 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/how-we-operate/>

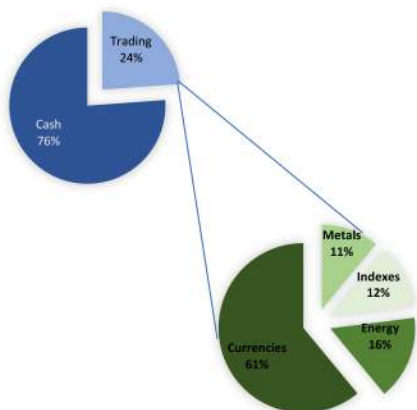
ALTERNATIVE FUND FACTS

Name	Alternative Fund
Domicile	Czech rep.
Fund size	€ 3.92 MM
Fund currency	EUR
Liquidity	Monthly
Lock-up period	None
Recommended investment term	6+ months
High watermark	Yes
Management company	Atlantis Capital CZ
Regulator	ČNB, Praha
Broker	LMAX, ATC UK, IC Markets
Management fee	0,1% monthly
Subscription fee	1,75%
Success fee	25%
Redemption fee	0%
Target annual returns	15% - 25% p.a.
Strategy	Manual, TA, Alghos

ALTERNATIVE FUND STATISTICS

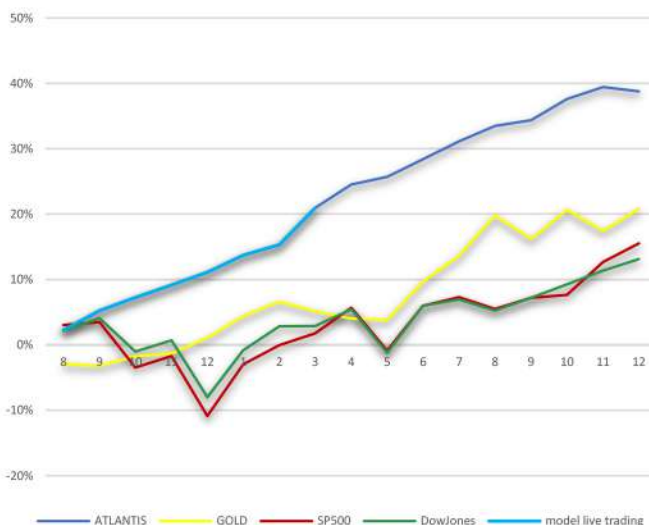
Last month's result	-0,61%
Returns since model live trading	+38,82%
Last 12 months return	+27,72%
Number of trades during this month	419
Max. drawdown from peak	-6,82%
Annual volatility	4,58%
Sharpe ratio	0,41
Profit factor	3,01
Positive trades	72,26%

FUND ALLOCATION



PERFORMANCE CHART

Benchmark table



JUDR. Luboš Žuffa
CEO company

Alternatívny fond ATLANTIS v mesiaci december zaznamenal pokles vo výške -0,61%; prvý negatívny mesiac od histórie fondu. Náš systém aktívneho riadenia rizika efektívne predikoval možné bezpečnostné a geopolitické turbulencie. Fond uzvrel všetky otvorené pozície diskrečného ako aj algoritmického obchodovania, ešte pred vianočnými sviatkami. Mesiac december na finančných trhoch bol výrazne ovplyvnený aj prebiehajúcimi voľbami v UK, kde jasne vyhral premier Johnson. Akciový trh taktiež rekordne stúpol vďaka voľbám, kde Index STOXX 600 vzrástol o 1,67% na 414,38 boda. Veľká Británia ohlásila oficiálny odchod z Európskej únie k dátumu 31.1.2019 o 23:00. Obaja rozchádzajúci sa partneri majú 11 mesiacov na to, aby vzájomne vyrokovali obchodnú dohodu, ináč by bola UK zaradená medzi 3-tích obchodných partnerov, čo znamená zavedenie vzájomných obchodných ciel. To by vplývalo na obe strany ekonomicky deštruktívne.

LIST OF TRADING INSTRUMENTS

INDEXY

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

Euro FX	↑
British pound	↑
Japanese yen	↓
Canadian dollar	↓
US dollar	↓
N.Zealand dollar	↑
Swiss franc	↑
Australian dollar	↑

TRADING RESULT

ROK	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%

Naším cieľom je dlhodobo dosahovať výnosy nad trhovým priemerom a pri nízkej volatilitate portfólia.