

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 volatilitě 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	€ 4.07 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 , 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

#### PERFORMANCE CHART

Benchmark table



#### 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	↑

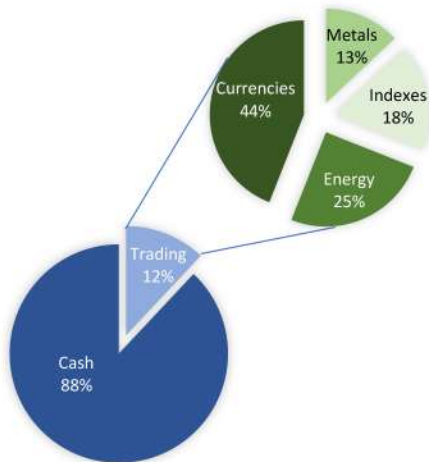
##### CURRENCIES

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

#### ALTERNATIVE FUND STATISTICS

Last month's result	+0,89%
Returns since model live trading	+39,71%
Last 12 months return	+26,00%
Number of trades during this month	66
Max. drawdown from peak	-6,24%
Annual volatility	4,19%
Sharpe ratio	0,39
Profit factor	2,15
Positive trades	73,21%

#### FUND ALLOCATION



JUDR. Luboš Žuffa  
CEO company

#### KOMENTÁR

Alternatívny fond ATLANTIS v mesiaci január zaznamenal mierny nárast o +0,89%. Výsledok bol vo veľkej miere ovplyvnený začiatkom kalendárneho roka a tým aj nanovo umiestňovanými pozíciami na trhu, a to až v druhom týždni mesiaca január. Fond profitoval hlavne z diskrečnej časti portfólia, algoritmy naberali nové pozície od začiatku mesiaca, ktoré ale ešte neboli uzavreté v rámci mesiaca január, zaujímavejšie výnosy očakávame vo februári. V rámci ekonomiky, eurozóna mala slabý koniec roku 2019, čo bol aj rovnaký príbeh vo Veľkej Británii, keď výrobná produkcia v decembri klesla najrýchlejším tempom za osem rokov. Bolo to odvodňované spomaľujúcou sa globálnou požiadavkou - a to predtým, ako bol identifikovaný koronavírus. Obchodná vojna USA s Čínou bola v tomto období odsunutá z popredia, aj v súvislosti s prebiehajúcimi problémami Číny s pandemickým koronavírusom, ktorý pomaly ale isto začína vplývať aj na ekonomiku – globálne. Podľa prognózy MMF však došlo k dobrým správam, že britská ekonomika porastie rýchlejšie ako eurozóna. Medzinárodný menový fond vidí rast z 1,3% v minulom roku na 1,4% v tomto roku a 1,5% v roku 2021. Z krajín G7 sa predpokladá, že iba USA a Kanada porastú rýchlejšie ako Spojené kráľovstvo, zatiaľ čo Taliansko, Francúzsko, Nemecko a Japonsko sa „bude snažiť udržať krok“. V rámci Brexitu, momentálne existuje „prechodné obdobie“ s EÚ, ktoré trvá do konca tohto roka, počas ktorého sa teoreticky vyriešia podmienky obchodnej dohody.

#### 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%
2020	0,89%												0,89%

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