



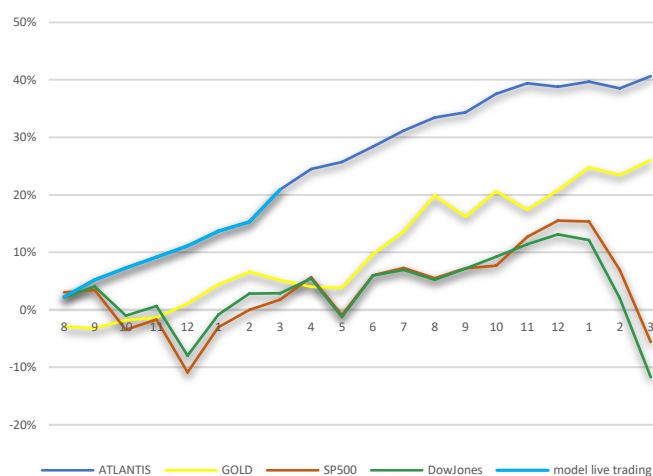
Obchodné portfólio alternatívneho investičného fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou podkladových aktív. Fond sa snaží dosahovať svoje ciele implementáciou portfólia systematických, algoritmickej 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 volatilite 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.atlanticcapital.fund/how-we-operate/>

ALTERNATIVE FUND FACTS

Name	Alternative Fund
Domicile	Czech rep.
Fund size	€ 3.96 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 ,GAIN Capital
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

Australian dollar	↑
British pound	↓
Japanese yen	↓
Canadian dollar	↑
US dollar Index	↓

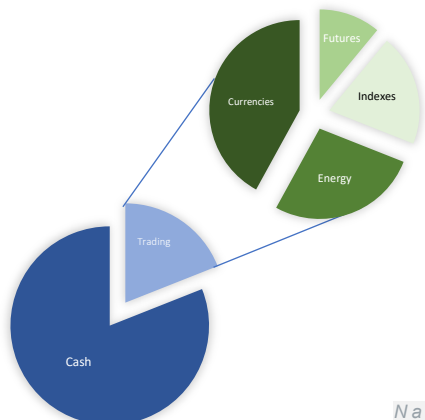
OTHERS

Lean Hogs	-
SoyBean	-

ALTERNATIVE FUND STATISTICS

Last month's result	+2,11%
Returns since model live trading	+40,63%
Last 12 months return	+19,68%
Number of trades during this month	96
Max. drawdown from peak	-4,28%
Annual volatility	3,18%
Sharpe ratio	0,39
Profit factor	2,08
Positive trades	79,54%

FUND ALLOCATION



KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Alternatívny fond ATLANTIS v mesiaci marec zaznamenal nárast o +2,11%. Na výsledku sa podpísalo algoritmickej aj diskrečne obchodovanie. Zásadné rozhodnutie znížiť výrazne objemy prospelo k stabilite a bezpečnosti v tak nestabilnej a neistej dobe. Výkonnosť algoritmov aj v takejto tržnej situácii potvrdzuje robustnosť a stabilitu stratégie. Stálo to veľa úsilia, čo vo výsledku prinieslo stabilitu fondu Atlantis do budúcnosti. Zásadnou zmenou je trading vo veľkej miere na Futures market. Z pohľadu makroekonomických ukazovateľov v tejto dobe hrá prím celosvetová pandémia vírusu COVID-19. Akciové trhy na celom svete prudko poklesli kvôli obavám z hospodárskeho vplyvu koronavírusu, veľa strát ale medzicasom bolo vymazaných nárastom a trh sa správa ako na hojdačke. Situácia sa neustále rýchlo mení, ale v čase písania sa vírus, rozšíril do viac ako 200 krajín sveta. V rámci odvetví je najviac zasiahnutý letecký a turistický priemysel. Taktiež bola vo veľkom zasiahnutá oblasť využívajúca dovoz tovarov z Číny. Jeden z najväčších prepados zaznamenal ropný priemysel, kde veľmi nízku spotrebu čierneho zlata znásobila aj „konfliktná vojna“ medzi Ruskom a Saudskou Arábiou, nízkou cenou ropy boli postihnuté všetky krajiny ktoré využívajú ťažbu ropy v prospech rozpočtu krajiny. Z pohľadu traderov sa trhy snažia vysporiadať s tým, ako dlho to bude trvať a aká bude ekonomická škoda. Situácia sa môže ukázať, ako niečo širšie a hlbšie, ako pôvodne predpokladali investori, ale každopádne konanie v panike nepomôže. Držíť všetky palce a pragmatické rozhodovanie v takto náročnej situácii.

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%	-1,19%	2,11%										1,81%

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