

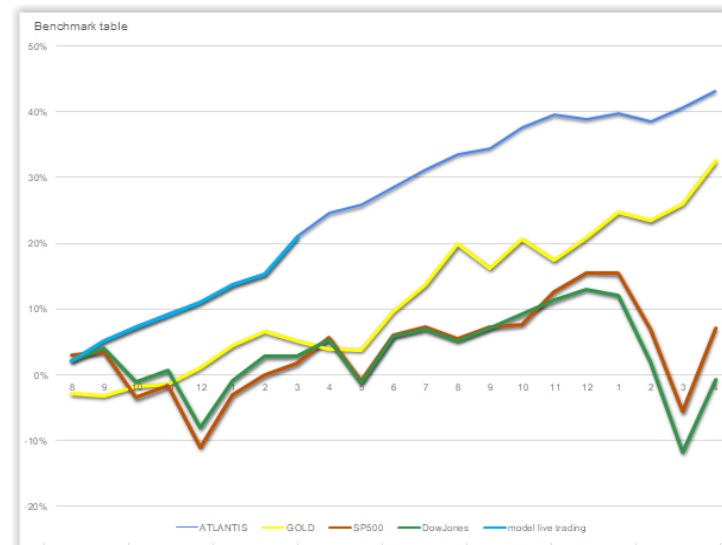


Obchodné portfólio alternatívneho investičného fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou podkladových aktív. Fond sa snaží dosahovať svoje ciele implementáciou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

#### ALTERNATIVE FUND FACTS

Name	Alternative Fund
Domicile	Czech rep.
Fund size	€ 3.16 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
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



#### 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

Corn	-
SoyBean	-

#### ALTERNATIVE FUND STATISTICS

Last month's result	+2,31%
Returns since model live trading	+43,06%
Last 12 months return	+18,54%
Number of trades during this month	84
Max. drawdown from peak	-4,91%
Annual volatility	3,62%
Sharpe ratio	0,41
Profit factor	2,09
Positive trades	74,42%



JUDr. Luboš Žuffa  
CEO company

#### KOMENTÁR

Alternatívny fond ATLANTIS v mesiaci apríl zaznamenal nárast o +2,31%. Keď sme ťažili prevažne z paniky ktorú vyvolala pandémia COVID-19, musíme zopakovať, že naše zásadné rozhodnutie - znížiť výrazne objemy prospelo k stabilite a bezpečnosti v tak nestabilnej a neistej dobe. Aj napriek tomu sme skúsenosťou dokázali vyčaziť maximum, z nášho pohľadu. Naše algoritmickej systémy zaznamenali

hlavnú časť tohto výsledku, a potvrdzuje sa že pri robustných algoritmoch na trhoch futures, vieme byť úspešný aj vo volatilnejšom období. Z pohľadu globálnych makroúdajov, musíme poznamenať, že bohužiaľ, globálna recesia je teraz nevyhnutná, pretože trhy sa snažia pochopiť hĺbku a dĺžku poklesu. Treba poznamenať že hospodárska činnosť sa dočasne pozastavila, pretože sa zaviedli opatrenia na distancovanie v sociálnej oblasti. To viedlo aj v apríli k extrémne ostrým pohybom na akciových trhoch. Treba poznamenať že Čína už ukazuje prvé znaky oživenia, tiež to že rozvinuté ekonomiky, ako Európa a USA sú vysoko závislé od odvetvia služieb a sú a budú zasiahnuté veľmi tvrdo. Predpoklad je že pokles bude až okolo 3-4%, čo je v tak silných ekonomikách dosť veľké číslo a pokles. V krátkodobom horizonte sa v peňažnej reakcii centrálnych bánk rozvinuli rekordné sumy, ktoré pomôžu zmierniť stres na finančných trhoch aj v „reálnej“ ekonomike. Federálny rezervný systém znížil sadzby v prvom štvrtroku dvakrát z 1,75% na 0,25% a zvýšil svoj program nákupu dlhopisov. Bank of England znížila základné sadzby na 0,1%. Vlády tiež ohlásili obrovské iniciatívy v oblasti fiškálnej politiky: vlády Spojeného kráľovstva a Nemecka sa zaviazali pokryť väčšinu miezd pracovníkov počas odstavky, aby zabránili spoločnostiam prepúšťať zamestnancov. Okrem toho sa pôžičky kryté vládou snažia vyhnúť inak nevyhnutnému úpadku bankrotov vedených hotovostným tokom. Americký fiškálny balík má hodnotu približne 10% HDP, ktorý ponúka podnikateľské granty a vládne úvery najmä pre spoločnosti s investičným stupňom. Na porovnanie, fiškálny stimul v roku 2008 predstavoval približne 5% amerického HDP.

#### 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%	2,31%									4,12%

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

