

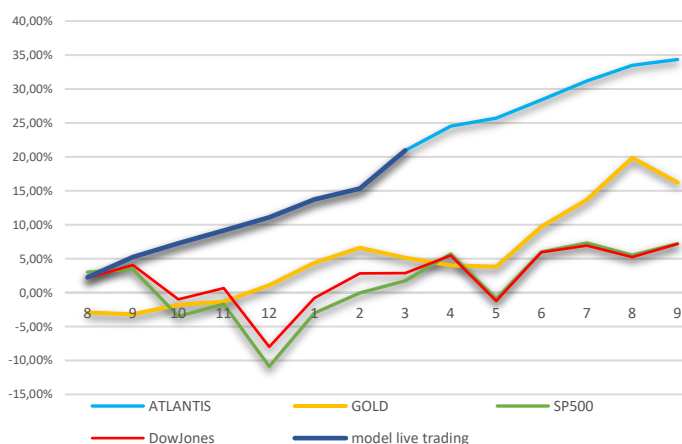
Obchodné portfólio alternatívneho investičného fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou podkladových aktív. Fond sa snaží dosahovať svoje ciele implementáciou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

#### ALTERNATIVE FUND FACTS

Name	Alternative Fund
Domicile	Czech rep.
Fund size	€3.8 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	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

#### 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

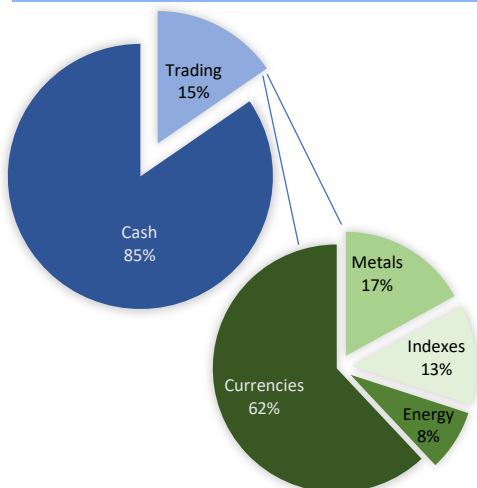
Last month's result	+0,87%
Returns since model live trading	34,35%
Last 12 months return	29,13%
Number of trades during this month	196
Max. drawdown from peak	-4,72%
Annual volatility	3,98%
Sharpe ratio	0.57
Positive trades	82,36%



JUDr. Luboš Žuffa  
CEO company

Alternatívny fond v mesiaci september 2019 zaznamenal nárast + 0,87%. Obchodný mesiac prevažne ťažil z manuálneho tradingu a technickej analýzy trhu. Algoritmické, automatizované obchodovanie zaznamenalo v tomto mesiaci stratu, keď hlavne prvá polovica mesiaca nebola priaznivá pre naše algoritmy, z dôvodu trhovej nestability pre BREXIT, ale počas druhej polovice mesiaca sa algoritmy zastabilizovali a zaznamenali návrat do štandardného režimu. Medzi triedy aktív, ktoré zaznamenali najlepší výkon patrili hlavne meny a kovy. Hlavné akciové trhy boli viac-menej pokojné, akciové indexy v USA kolísali okolo ich historických maxím. Ťažiskom v obchodovaní s komoditami bol rast cien ropy, ktorý vzrástol o viac ako 10% počas jedného víkend. Bolo to spôsobené útokom na ropné zariadenia Saudskej Arábie. Cena sa však pred koncom mesiaca ustálila na pôvodnej úrovni. ECB aj FED znížili cieľové úrokové sadzby. Tieto udalosti nemali významný vplyv na trhy s dlhopismi, pretože sa už predpokladali.

#### FUND ALLOCATION



#### 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%				23,25%

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