

# ATLANTIS

## trading portfolio



ATLANTIS  
CAPITAL GROUP

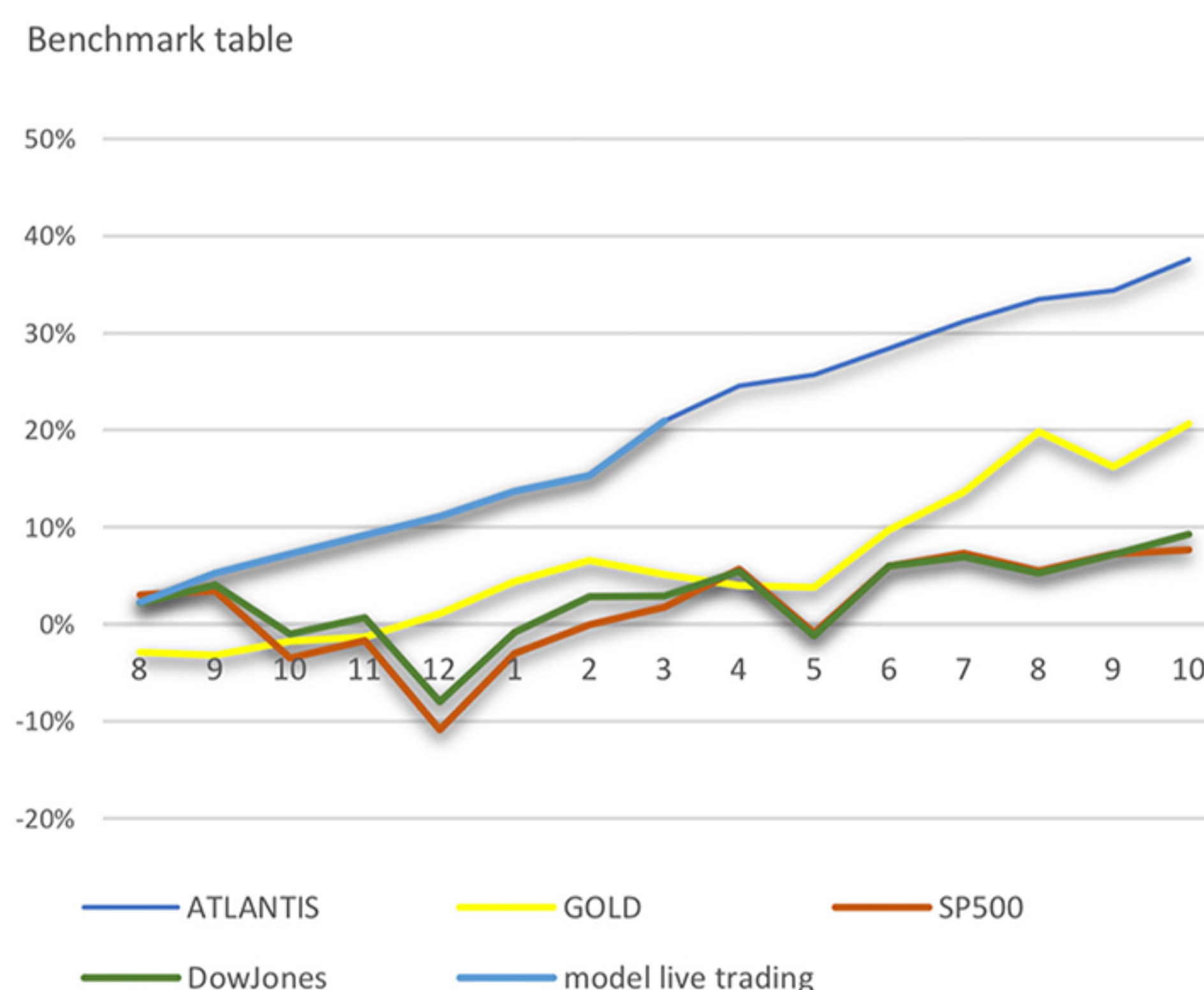
ALTERNATIVE FUND report. 2019 OKTÓBER

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 semiautomatizovaného 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	€ 4.05 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

### 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

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

### ALTERNATIVE FUND STATISTICS

Last month's result	+3,23%
Returns since model live trading	37,58%
Last 12 months return	29,13%
Number of trades during this month	369
Max. drawdown from peak	-4,72%
Annual volatility	3,58%
Sharpe ratio	0,61
Profit factor	3,94
Positive trades	80,12%

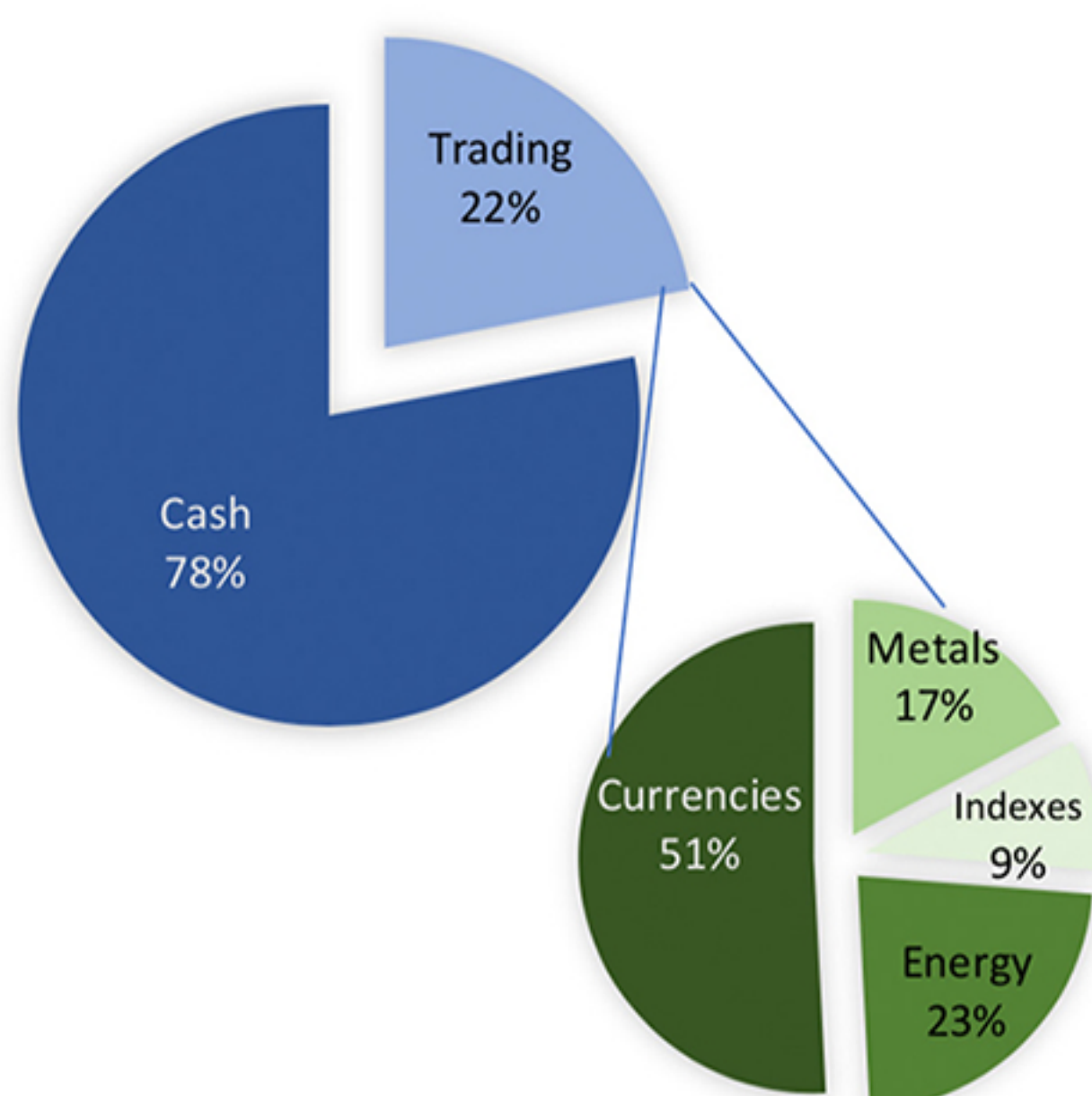


JUDr. Luboš Žuffa  
CEO company

Alternatívny fond v mesiaci október zaznamenal veľmi príjemný nárast vo výške 3,23%. Obchodný mesiac plne využil svoj potenciál. Diskrečné aj algoritmické stratégie zaznamenali plusové hodnoty. Pričom ťažili hlavne zo zníženej úrovne nervozity v druhej časti mesiaca. Medzi triedy aktív, ktoré zaznamenali najlepší výkon patrili energie a meny. Fed znížil úrokové sadzby z 2% na 1,75% s tým, že sa v najbližšom období bude pohybovať medzi 1,5% a 1,75%. Brexit je odložený na koniec januára v roku 2020 po voľbách, ktoré prebehnú v decembri. USA a Čína dosiahli čiastočnú obchodnú dohodu. Bola uzavretá prvá fáza dohovorov medzi zúčastnenými stranami. Dojednania by mali zaručiť prímerie po vyše rok trvajúcej obchodnej vojne medzi oboma veľmocami. Je to dobrý základ pre širší konsenzus, ktorý by americký prezident Donald Trump a jeho čínsky náprotivok Si Ťin-pching mohli podpísať neskôr v tomto roku. Čína by mala súhlasiť s ústupkami v oblasti poľnohospodárstva a USA by mali urobiť colné ústupky. Dohoda je však len predbežná a môže sa zmeniť. Na tieto informácie akciové trhy reagovali veľmi pozitívne, americké a európske akciové indexy opäť výrazne posilnili.

Alternatívny fond v mesiaci október zaznamenal veľmi príjemný nárast vo výške 3,23%. Obchodný mesiac plne využil svoj potenciál. Diskrečné aj algoritmické stratégie zaznamenali plusové hodnoty. Pričom ťažili hlavne zo zníženej úrovne nervozity v druhej časti mesiaca. Medzi triedy aktív, ktoré zaznamenali najlepší výkon patrili energie a meny. Fed znížil úrokové sadzby z 2% na 1,75% s tým, že sa v najbližšom období bude pohybovať medzi 1,5% a 1,75%. Brexit je odložený na koniec januára v roku 2020 po voľbách, ktoré prebehnú v decembri. USA a Čína dosiahli čiastočnú obchodnú dohodu. Bola uzavretá prvá fáza dohovorov medzi zúčastnenými stranami. Dojednania by mali zaručiť prímerie po vyše rok trvajúcej obchodnej vojne medzi oboma veľmocami. Je to dobrý základ pre širší konsenzus, ktorý by americký prezident Donald Trump a jeho čínsky náprotivok Si Ťin-pching mohli podpísať neskôr v tomto roku. Čína by mala súhlasiť s ústupkami v oblasti poľnohospodárstva a USA by mali urobiť colné ústupky. Dohoda je však len predbežná a môže sa zmeniť. Na tieto informácie akciové trhy reagovali veľmi pozitívne, americké a európske akciové indexy opäť výrazne posilnili.

### 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%	3,23%			26,48%

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