

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 diskrétného obchodovania. Obchodné portfólio zahŕňa viaceré aktiva trhu s kovmi, menovými nástrojmi, indexami a energetickými aktívami. Realizácia jednotlivých obchodov prebieha na regulovaných, centralizovaných a derivatových trhoch. Stratégia uskutočňuje dlhé a krátke pozície s cieľom profitať z identifikovaných krátkych, stredných a sezónnych trendov a trendov plynujúcich 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.atlanticcapital.fund/how-we-operate/>

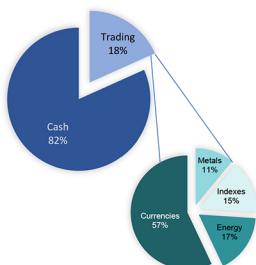
ALTERNATIVE FUND FACTS

Name	Alternative Fund
Domicile	Czech rep.
Fund size	€ 4.17 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

ALTERNATIVE FUND STATISTICS

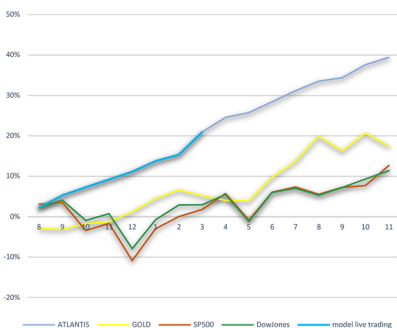
Last month's result	+1,85%
Returns since model live trading	+39,43%
Last 12 months return	+30,26%
Number of trades during this month	209
Max. drawdown from peak	-4,83%
Annual volatility	4,11%
Sharpe ratio	0.59
Profit factor	3,62
Positive trades	79,91%

FUND ALLOCATION



PERFORMANCE CHART

Benchmark table



JUDr. Luboš Zuffa
CEO company

Alternatívny fond ATLANTIS v mesiaci november zaznamenal nárast vo výške 1,85%. Obchodný mesiac plne využil svoj potenciál. Diskrétné aj algoritmické stratégie zaznamenali plusové hodnoty. Negatívom bola extrémne znížená volatilita na trhoch. Čína a USA sa dohodli na zrušení zostávajúcich tarif v prvej fáze. Celkovo by malo byť 17 fáz a skôr to vyzerať na dohodu, ale až po prípadnom nezvolení Donalda Trumpa v roku 2020. V rámci pracovného trhu USA boli publikované prevažne dobré správy. Údaje zverejnené začiatkom mesiaca ukázali, že aj napriek štrajku v spoločnosti General Motors, bolo v októbri vytvorených 128 000 nových pracovných miest, oproti prognózovaným 85 000. Miera nezamestnanosti sa však mierne zvýšila na 3,6%; zo septembrových 50-ročných mínim 3,5%. Volebné hlasovanie vo Veľkej Británii - prieskumy ukazujú rastúcu šancu konzervatívcov, pre domácu menu Libru sú to pozitívne výhľadky. Mesiac November sa niesol v pokojnej atmosfére s tým, že americké akciové indexy si opäť pripísali nové maximá.

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%		28,33%

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	↓

Nášim cieľom je dlhodobo dosahovať výnosy nad trhovým priemerom a pri nízkej volatilitě portfólia.