



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 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/>

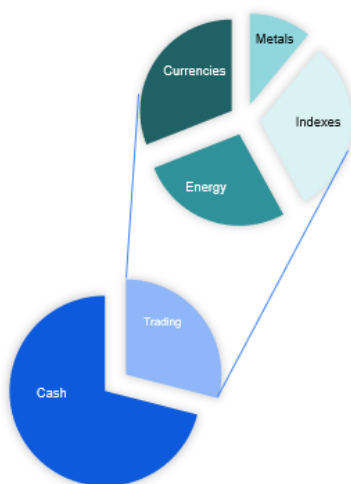
ALTERNATIVE FUND FACTS

Name	Alternative Fund
Domicile	Czech rep.
Fund size	€ 3.32 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, Alghos

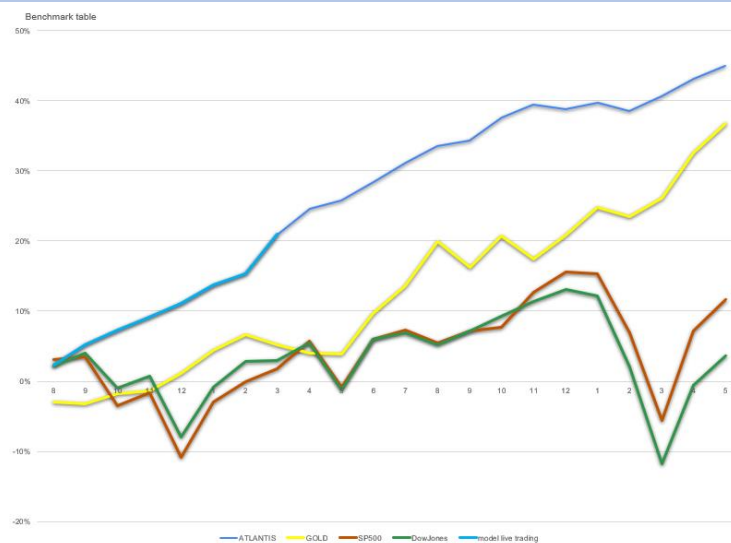
ALTERNATIVE FUND STATISTICS

Last month's result	+1,91%
Returns since model live trading	+44,85%
Last 12 months return	+19,25%
Number of trades during this month	71
Max. drawdown from peak	-4,49%
Annual volatility	4,01%
Sharpe ratio	0,43
Profit factor	2,01
Positive trades	76,31%

FUND ALLOCATION



PERFORMANCE CHART



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

KOMENTÁR

Quantový hedge fond ATLANTIS zarobil za mesiac máj 2020 +1,91%. Trading prebiehal prevažne na futures, v algo štýle. Musíme zopakovať, že naše zásadné rozhodnutie - znížiť výrazne objemy prospelo k stabilite a bezpečnosti v tak nestabilnej a neistej dobe. Algoritmické systémy dokázali vyťažiť maximum, z ich diverzifikácie a minimálnej korelácie využitých trhov. Tieto algoritmické systémy zaznamenali hlavnú časť tohto výsledku, a potvrdzuje sa že pri robustných algoritmoch na trhoch futures, vieme byť úspešní aj vo volatilnejšom období. Z pohľadu globálnych makroúdajov, sa referenčných minimálnych hodnôt dosiahnutých v marci trhy už v máji odrazili vyššie. V piatok 29. mája panovali obavy z možnosti vzostupu napätia medzi USA a Čínou v súvislosti s nedávnymi krokmi v Hongkongu, kde sa Čína rozhodla presadiť zákon o národnej bezpečnosti, zvyšuje to znepokojenie nad jeho funkciou globálneho finančného centra. Avšak, prezident Trump na tlačovej konferencii nebol až tak konfrontačný, ako sa očakávalo. Vo Veľkej Británii panuje optimizmus pri opätovnom otvorení niektorých častí ekonomiky. Na európskych trhoch v máji získal EuroStoxx +4,18% a japonský Nikkei 225 získal +8,34%. V USA skončili DowJones a NASDAQ po máji, aj v júni s pekným rastom - index blue chips vzrástol o 4,26% za mesiac, zatiaľ čo technologicky orientovaný NASDAQ priniesol zisk 6,76%. Zlato sa v súčasnosti obchoduje na úrovni okolo 1 730 dolárov za trójsku uncu, zo ziskom +2,49% v mesiaci máj. Ku koncu mesiaca bola cena podporovaná rastúcim napätím medzi USA a Čínou. Brent a Crude oil sa ku koncu obchodoval na úrovni približne 36,00 USD za barrel, čo bol mesačný zisk 36,06%. Cena ropy bola podporená rastúcou dôverou, že ťažobný priemysel dodržiava záväzky na zníženie dodávok, ako aj zdvíhajúcim dopytom po palive sa zdvihne, pretože obmedzenia sa uvoľnia..

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%	1,91%								6,03%

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