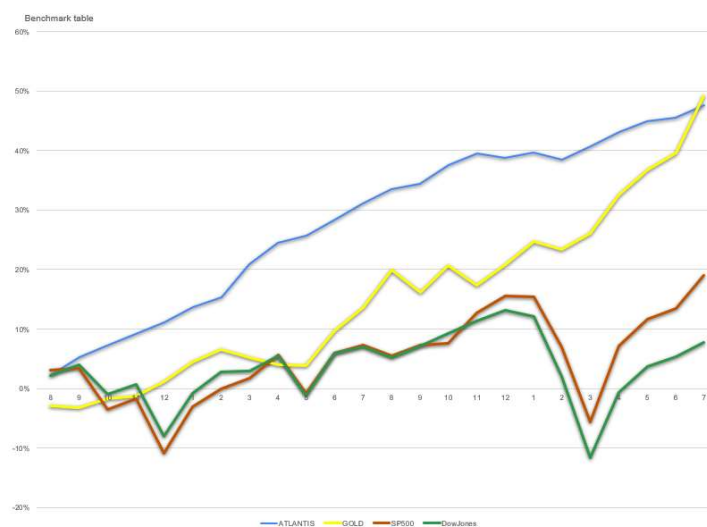


Obchodné portfólio privátneho algoritmickeho hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou automatických obchodných stratégií založených na systematickom a algoritmickej obchodovaní. Portfólio zahŕňa viaceré aktíva trhu s kovmi, menovými nástrojmi, indexami a energetickými aktívami. Realizácia jednotlivých obchodov prebieha na regulovaných, centralizovaných a derivátových trhoch. Stratégie uskutočňujú dlhé a krátke pozície s cieľom profitovať z identifikovaných krátkych, stredných a sezónnych trendov a trendov plynúcich z opakujúcich sa patternov, cenových formácií. Vytvorené systémy dokážu v kritických situáciách a pri vysokej volatilitě aplikovať hedge obchodný prístup. Cieľom portfólia, ktoré je kalibrované z ~ 50 logicky odlišných obchodných systémov, je dosahovať zisk v každom mesiaci. 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/>

ALTERNATIVE FUND FACTS

Name	Hedge Fund
Domicile	Czech rep.
Fund size	€ 3.41 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	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

Lean Hogs	-
Soybean	-

ALTERNATIVE FUND STATISTICS

Last month's result	+2,13%
Returns since model live trading	+47,52%
Last 12 months return	+16,37%
Number of trades during this month	71
Max. drawdown from peak	-4,01%
Annual volatility	4,37%
Sharpe ratio	0,51
Profit factor	2,25
Positive trades	79,45%

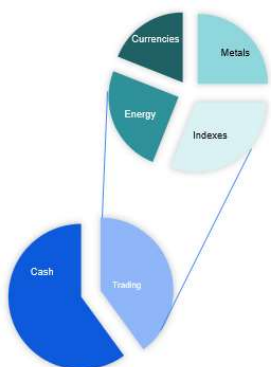


JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

KOMENTÁR

Privátny algoritmickej hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac júl 2020 rast +2,13%. Tento mesiac globálne akcie vyjadrené v amerických dolároch zaznamenali rast, aj keď údaje o hospodárskom raste potvrdili závažnosť poklesu v Q2. Prebiehajúce opatrenia centrálnej banky a vlády naďalej poskytovali podporu akciám a podnikovým dlhopisom. Pokiaľ ide o konvertibilné dlhopisy, globálne akciové trhy pokračovali v júli v rastúcom trende. Celosvetový index konvertibilných dlhopisov Thomson Reuters sa v plnej miere zúčastnil na ziskoch, keď vzrástol o 4,8%, v súlade s indexom akciových indexov MSCI World. Primárny trh s prevoditeľnými dlhopismi bol v roku 2020 neuveriteľne aktívny, ale v júli počas tradičnej letnej sezóny mierne spomalil. Hlavní emitenti sa naďalej nachádzajú v technologickom priestore, ktorý zostáva hlavnou hnacou silou návratnosti akcií. Americké akcie rástli vďaka štvrtročným príjmom získaných z akcií ako Amazon, Apple a Facebook. Získané údaje ukazujú, že HDP v 2. štvrtroku v USA prudko poklesol a dolár sa oslabil. Oslabenie doláru sa odrazilo na vývoji akcií na rozvíjajúcich sa trhoch, ktoré zaznamenali výrazné zisky ako aj na japonskom jene, ktorý sa posilnil voči americkému doláru. Federálny rezervný systém (Fed) ponechal svoju kľúčovú sadzbu politiky nezmenenú a vyhlásil, že je naďalej pripravený poskytnúť ďalšie politické opatrenia podľa potreby, pretože dúfa v to najlepšie, ale plánuje to najhoršie. Jasnejšie povedané, americké spotrebiteľské výdavky v júni pokračovali v raste o 5,6% oproti máju, keď sa znovu otvorilo viac firiem, čo spôsobilo, že inflácia zostáva utlmená. Zároveň v tomto mesiaci došlo k poklesu akcií v eurozóne, čo bolo zapríčinené poklesom ekonomickej aktivity v druhom štvrtroku a opätovným nárastom výskytu vírusu Covid-19. Akcie klesali aj vo Veľkej Británii v dôsledku obáv z druhej vlny Covid-19. Zatiaľ čo výnosy vládnych dlhopisov v mnohých veľkých ekonomikách v druhom štvrtroku poklesli (t. J. Ceny vzrástli), schválenie fondu obnovy EÚ poskytlo podporu talianskym štátnym dlhopisom. HDP eurozóny sa v druhom štvrtroku znížil o 12,1%. V Španielsku došlo k spomaleniu rastu o 18,5%, zatiaľ čo nemecký HDP sa v druhom štvrtroku znížil o 10,1%. Miera nezamestnanosti v eurozóne vzrástla v júni na 7,8% z 7,7% v máji. Údaje z prieskumu však poukázali na zlepšenie činnosti v júli. Index S&P GSCI (komoditný index) zaznamenal v júli solídny zisk, pričom slabý dolár bol silným zádnym vetrom. Drahé kovy prudko stúpili, keď zisk zlata dosiahol 8,6% a predbehol nárast ceny striebra o 30,0%. Trhy s priemyselnými kovmi zaznamenali výrazný návrat, pričom ťažili z príznakov pokračujúceho globálneho oživenia a zo zvyšovania dopytu v Číne. Energetické a poľnohospodárske komponenty priniesli skromnejšie zisky.

FUND ALLOCATION



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

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%	0,54%	2,13%						8,7%