

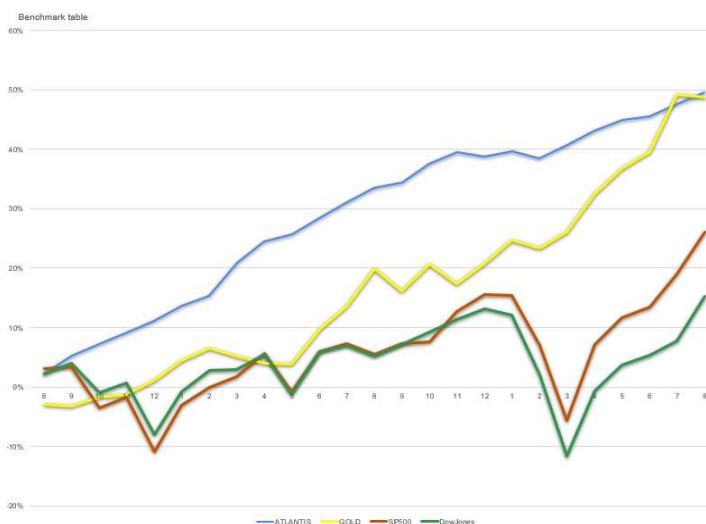


Obchodné portfólio privátneho algoritmickeho hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou 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.atlantiscapital.fund/>

ALTERNATIVE FUND FACTS

Name	Hedge Fund
Domicile	Czech rep.
Fund size	€ 3.47 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	↓

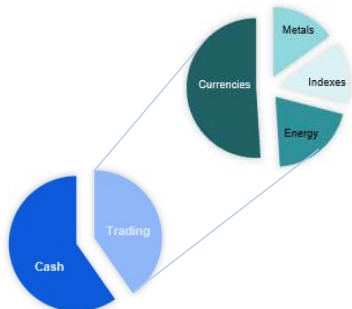
OTHERS

Kcw CBT	-
MiniDJ	-

ALTERNATIVE FUND STATISTICS

Last month's result	+1,86%
Returns since model live trading	+49,50%
Last 12 months return	+15,9%
Number of trades during this month	75
Max. drawdown from peak	-4,71%
Annual volatility	4,97%
Sharpe ratio	0,62
Profit factor	2,05
Positive trades	78,15%

FUND ALLOCATION



KOMENTÁR



JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmickej hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac august 2020 rast +1,86%. V auguste zaznamenalo euro najlepšiu mesačnú výkonnosť voči japonskému jenu. Nie je prekvapením, že silná výkonnosť akciových trhov po celom svete pomohli podporiť pokles japonskej meny, ktorá tradične slúžila ako bezpečný prístav pre účastníkov trhu. Rovnako ako v prípade švajčiarskeho franku (CHF), kanadskeho dolára (CAD) a austrálskeho dolára (AUD), euro v auguste stratilo určité postavenie voči libře. Ako zdôrazňujeme už niekoľko mesiacov, veríme, že k dohode, v rámci Brexit procesu, dôjde na poslednú chvíľu, zhruba v polovici decembra alebo dokonca na konci decembra, čo znamená, že volatilita okolo páru EUR / GBP by mohla vzrásť na konci tohto roka. COVID-19 sa naďalej prejavuje v šoku pre malých amerických zamestnávateľov. Malé podniky sú oporou americkej vynaliezavosti a ovplyvňujú miestne ekonomiky v mestách po celej krajine. Bývalý predseda Federálneho rezervného systému Ben Bernanke zdôraznil úlohu týchto spoločností počas poslednej recesie slovami: „malé podniky hrali dôležitú úlohu pri podpore minulých hospodárskych oživení.“ Najpriamejším príkladom pozastavenia oživenia je index nákupných manažérov (Purchasing Managers' Index) eurozóny pre sektory služieb, ktorý sa prepadol z júlových 54,7 na iba 50,1 v auguste. Letecká doprava v celej Európe sa od apríla zlepšila a na začiatku augusta klesla doprava len o 50% v porovnaní s predchádzajúcim rokom. Odvtedy však letecká doprava zaznamenala mierny pokles, čo spôsobilo obavy z toho, že hospodárske oživenie Európy sa spomaľuje. August je pre akcie väčšinou pomalý mesiac, avšak globálny akciový trh dokázal dosiahnuť silnú výkonnosť. Index S&P 500 získal v tomto mesiaci rekordné maximum 7%. NASDAQ opäť prekonal výkon s 9,6%. Európa tiež v tomto mesiaci zaznamenala pozitívne zisky, pričom index Stoxx 50 vzrástol o 3% a nemecký index DAX vzrástol o 5%. Silný mesiac výkonnosti zaznamenalo aj Japonsko, keď v auguste zaznamenal TOPIX nárast o 7,5%. August bol pre ropu bezproblémovým mesiacom, keď sa ropa Brent obchodovala v úzkom rozmedzí 44-46 USD za barel. Po dosiahnutí svojho historického maxima začiatkom augusta a prelomení nad hranicu 2 000 dolárov za uncu sa zlato s rastom výnosov dlhopisov dostalo do konsolidácie. Index amerického dolára (USD) stratil v auguste ďalších 1,5% a dosiahol najnižšiu úroveň od apríla 2018. Vyvinuté trhové meny, ako napríklad nórska koruna (+ 4,7%), austrálsky dolár (+3,5%), kanadský dolár (+ 2,6%) a britská libra (+ 2,3%), boli na čele medzi ziskami voči USD. V Ázii bol čínsky jüan (+ 2%) lepšou výkonnosťou vzhľadom na jeho hospodárske oživenie a široké oslabenie USD.

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%	1,86%					10,56%

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