



## Aionite Capital Fund

Factsheet per Juli 2022

Der **Aionite Capital Fund** folgt einem «Multi Strategy» & «Global Macro» Ansatz und positioniert sich damit als echte Alternative zu traditionellen Anlagen wie Aktien. Der Fonds strebt nach attraktiven risikoadjustierten Renditen bei gleichzeitig tiefer Markt-Korrelation und tiefem Tail-Risiko. Die Anlagephilosophie beruht auf dem Konzept des «Evolutionären Investieren».

**Aionite Capital** ist Vorreiter des «Evolutionären Investieren», einem Ansatz der mit Hilfe von künstlicher Intelligenz aus einer Vielzahl an Anlagestrategien die Erfolgsversprechendsten herausfiltert und sich entsprechend auf steigende oder fallende Kurse positioniert. Investiert wird in unterschiedliche Märkte, von Rohstoffen, Obligationen und Aktien, bis hin zu Währungen oder Volatilität. Das breite Anlageuniversum hilft dabei nicht nur bei der Portfoliodiversifikation, sondern eröffnet auch mehr Renditeopportunitäten.

«**Evolutionär Investieren**» bedeutet, sich dem Wandel der Märkte und den unterschiedlichen Marktphasen dynamisch anzupassen. Dafür bedarf es einem Ansatz wie dem unserem, der mit der hohen Komplexität der Märkte zurecht kommt, anpassungsfähig ist und sich selbständig weiterentwickelt.

### EVOLUTIONÄR IN JEDER HINSICHT

Unsere Strategie unterscheidet sich in vielerlei Hinsicht von klassischen Anlagelösungen:

- ▼ Grosses Anlageuniversum, global ausgerichtet, mit allen Anlageklassen (Aktien, Obligationen, Rohstoffen, Währungen, Volatilität).
- ▼ «Evolutionäres Investieren» schätzt mittels wissenschaftlichen Signalen und künstlicher Intelligenz die Attraktivität jedes einzelnen Marktes.
- ▼ Ob fallende oder steigende Kurse – in beiden Szenarien kann profitiert werden.
- ▼ Risikobetrachtung zielt auf Extremrisiken und verteilt diese ähnlich auf die unterschiedlichen Anlageklassen.
- ▼ Systematische Strategieumsetzung verhindert emotionale Fehler und «behavioral biases» beim Investieren.
- ▼ Enge Zusammenarbeit mit wissenschaftlichen Grössen im Bereich evolutionärer Strategien.

### FONDSKURSE UND RENDITE

Preis bei Lancierung	150.00	Rendite Juli 2022	-4.02%
Preis am 31.12.2021	167.77	Rendite 2022	-12.18%
Preis am 30.06.2022	147.34	Rendite seit Fondsstart	-1.74%

### FONDSKENNZAHLEN

Sharpe ratio*	-0.02	Korrelation zu S&P 500	0.44
Calmar ratio	0.07	Korrelation zu SMI	0.41
Up-to-down months	1.00	Korrelation zu Gold	0.23
Standardabweichung	10.01%	Korrelation zu US Treasuries	0.07
Maximum Drawdown	-20.91%		

\*short rate -0.75%

### PRODUKTBESCHRIEB

Einteilung	Alternative Anlagen
Klassifizierung	Global Macro / Multi Strategy
Philosophie	Evolutionäres Investieren
Umsetzung	Systematisch
Universum	Aktien, Obligationen, Rohstoffe, Volatilität, FX
Fondsstart	1. Oktober 2020
Fondswährung	CHF
AuM	<50 Mio. CHF (per 1.5.22)
Domizil	Schweiz
Rechtstruktur	Fonds nach CH-Recht
Fondsadmin	Pernet von Ballmoos AG
Custodian	BNP Zürich
Auditor	Deloitte
Verwaltungsgebühr	0.083% pro Monat
Performance-Gebühr	10% mit «high watermark»



## Startup

University of  
Zurich <sup>UZH</sup>

### ZEICHNUNGEN & RÜCKNAHMEN

Zeichnungen	monatlich, letzter Arbeitstag
Rücknahmen	monatlich, drittletzter Arbeitstag
Mindestanlage	100'000.–
ISIN	CH0561075661
<b>Valor</b>	<b>56107566</b>



## POSITIONEN PER ENDE JULI 2022

	short	long	Net
Aktien	-21.4%	8.1%	-13.3%
Volatilität	-3.1%	0.0%	-3.1%
Obligationen	-17.6%	9.5%	-8.1%
Währungen	-28.1%	28.1%	0.0%
Rohstoffe	-37.0%	7.4%	-29.6%
Metalle	-10.5%	1.1%	-9.3%
Vieh	-6.7%	2.6%	-4.1%
Energie	0.0%	1.7%	1.7%
Food	-10.4%	0.0%	-10.4%
Agrikultur	-9.5%	2.0%	-7.5%
Total	-107.2%	53.1%	-54.0%
Absolut Total			160.3%

## RENDITE NACH ANLAGEKLASSE PER ENDE JULI 2022

	MTD	YTD
Aktien	-2.20%	-5.71%
Volatilität	0.26%	-1.19%
Obligationen	-2.11%	-11.97%
Währungen	-0.01%	2.05%
Rohstoffe	0.05%	4.64%
Metalle	0.39%	0.50%
Vieh	-0.16%	0.36%
Energie	-0.06%	1.58%
Food	-0.07%	-1.16%
Agrikultur	-0.05%	3.37%
Total	-4.02%	-12.18%

## HÖCHSTE RENDITEBEITRÄGE IM JULI 2022

Asset Class	Top
CBOE VIX VOL	0.29%
Copper COM	0.21%
EURUSD FX	0.21%
EURGBP FX	0.20%
Rubber COM	0.19%

## NIEDRIGSTE RENDITEBEITRÄGE IM JULI 2022

Asset Class	Bottom
S&P 500 EQ	-0.87%
CAN 10y IR	-0.62%
UKT 10y IR	-0.53%
ACGB 10y IR	-0.41%
DAX EQ	-0.30%

## MONATLICHE NETTORENDITEN

	Jan	Feb	Mar	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Gesamt
2022	-4.94%	-1.85%	2.68%	-0.05%	-1.46%	-3.04%	-4.02%						-12.18%
2021	-1.34%	3.86%	2.30%	4.03%	2.23%	1.14%	2.86%	1.36%	-7.50%	-3.07%	-1.80%	2.29%	5.88%
2020										-4.29%	7.20%	3.00%	5.68%



WhatsApp via QR-Code

[www.aionite.ch](http://www.aionite.ch)  
[www.linkedin.com/company/aionite-capital/](https://www.linkedin.com/company/aionite-capital/)  
[info@aionite.ch](mailto:info@aionite.ch)

## IHR BODENSTÄNDIGER PARTNER

Wir von **Aionite Capital** sind in Zürich daheim, lokal verwurzelt, und pflegen einen ehrlichen & bodenständigen Austausch mit unseren Investoren. Wir stehen zu 100% hinter unserem Ansatz und sind mit unserem persönlichen Geld investiert. Wir sitzen im selben Boot wie unsere Investoren und wollen gemeinsam erfolgreich sein.

Trotz unserer jahrzehntelanger Erfahrung als Fondsmanager haben wir als Forschende und Dozenten unsere Wurzeln in der akademischen Welt. Wir verschmelzen das Beste aus der Praxis und der Forschung zu einem einzigen, ganzheitlichen Anlageprodukt, unserem **Aionite Capital Fund**. Dies ist unsere Antwort, um langfristig besser zu investieren.

**DISCLAIMER.** Aionite Capital ist eine Marke für alternative Investments von PVB Pernet von Ballmoos AG. Alle in diesem Dokument veröffentlichten Details dienen ausschließlich zu Werbe- und Informationszwecken und stellen weder eine Anlageberatung noch eine Anlageempfehlung dar. Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen stellen auch kein Angebot dar, sofern nicht ausdrücklich darauf hingewiesen wird. Allein verbindliche Grundlage für den Kauf des Aionite Capital Fonds sind der aktuelle Verkaufsprospekt, die (Jahres-)Berichte, das Fondsreglement sowie weitere rechtliche Dokumente. Der Prospekt, die Vertragsbedingungen und die Jahres- oder Halbjahresberichte können kostenlos bei der Fondsleitung bezogen werden. Die Adresse lautet PVB Pernet von Ballmoos AG, Zollikerstr. 226, 8008 Zürich.

Die vergangene Performance ist kein Hinweis auf zukünftige Performance und garantieren keinen Erfolg in der Zukunft. Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen wurden mit grösster Sorgfalt von Aionite Capital zusammengestellt. Alle Informationen und Meinungen wurden aus zuverlässigen Quellen bezogen. Trotz professioneller Sorgfalt kann Aionite Capital die Richtigkeit oder Vollständigkeit der Informationen nicht garantieren. Aionite Capital übernimmt keine Haftung für Investitionen, die auf der Grundlage der in diesem Dokument enthaltenen Informationen getätigt werden.

Der Aionite Capital Fund ist ein vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "übrige Fonds für alternative Anlagen" mit besonderem Risiko, der mittels Derivate seine Anlagestrategie, wie in Ziff. 1.2 des Prospektes und in § 8 des Fondsvertrages beschrieben, implementiert (Einsatz von Aktien-, Bond-, Rohstoff-, Volatilitäts- sowie Währungsderivaten). Die Risiken des Aionite Capital Fund sind aufgrund der eingesetzten Instrumente und Anlagetechniken nicht mit denjenigen von Effektenfonds vergleichbar. Der Aionite Capital Fund setzt zu einem grossen Teil Derivate ein und kann dadurch ein Gesamtengagement von mehr als 100% erzielen. Namentlich darf das absolute Gesamtengagement aller Anlagen bis zu 600% des Nettoinventarwertes betragen. Die eingesetzten kotierten Derivate unterliegen dem Risiko von operationellen Störungen an den Börsen, an denen sie kotiert sind, was zu Verlusten führen kann. Eine Investition in den Anlagefonds beinhaltet u.a. Markt-, Währungsrisiken sowie Modellrisiken. Die Anleger werden ausdrücklich auf die im Prospekt enthaltenen Risikohinweise aufmerksam gemacht. Eine Investition in den Anlagefonds kann unter Umständen grossen Wertschwankungen unterworfen sein. Personen, die in den Fonds investieren, müssen bereit und in der Lage sein, in ausserordentlichen Fällen Kapitalverluste, einschliesslich eines Totalverlusts hinzunehmen. Deshalb sollten die Anteile am Aionite Capital Fund bei Anlegern nur einen geringen Teil des Portfolios ausmachen, und die Anteile sollten innerhalb eines diversifizierten Portfolios gehalten werden. Der Anleger darf deshalb nicht auf die Realisierung der Anlage auf einen bestimmten Termin angewiesen sein. Ein Investment in diesen Anlagefonds eignet sich nur für objektiv in hohem Masse risikofähige Investoren mit langfristigem Anlagehorizont.