



Aionite Capital

Aionite Evolution

Aionite Capital Fund
Factsheet, October 2024

the hedge fund journal

2022

**Tomorrow's
Titans**



**HEDGEWEEK
EUROPEAN AWARDS 2022**

Best All Hedge Fund Under \$50 Mln

Aionite Capital Fund

Factsheet, October 2024



STRATEGY DESCRIPTION

Multi-asset absolute return strategy, investing in equity indices, bonds, commodities and currencies to form a well diversified balanced portfolio.

The program simulates markets with the help of artificial intelligence and hundreds of investment strategies. Depending on the market environment, a higher allocation goes to those strategies that have a evolutionary higher probability of success.

The strategy is ideal for investors looking for a multi-asset solution or an alternative for their equity investments. The strategy is uncorrelated to other investments.

ABOUT

Aionite Capital is a start-up from the University of Zurich. We make investing in Evolutionary Finance accessible. The fund's strategy is inspired by the work of Charles Darwin and based on the research on Evolutionary Finance. Evolutionary Finance is an interdisciplinary field that combines concepts from evolutionary biology, complexity theory and finance to study the behavior of financial markets.

Startup

**University of
Zurich^{UZH}**

FUND PRICES AND RETURNS

Last Price	151.41
Return last Month	-4.12%
Return 2024	5.10%
Return since launch	1.51%

RISK FIGURES

Up-to-down months	1.26
Standard deviation	9.13%
Correlation to S&P 500	0.19
Correlation to SMI	0.22
Correlation to Gold	0.02
Correlation to US Treasuries	-0.27

INFORMATIONEN

Classification	global macro / multi-strategy
Philosophy	Evolutionary Finance
Focus	absolute return
Implementation	systematic
Universe	equities, bonds, commodities, volatility, FX
Characteristic	uncorrelated to traditional assets and CTA/ trend
Fund launch	October 2020
Fund currency	CHF
AuM	<50 Mio. CHF
Legal structure	contractual fund (Swiss law)
Management fee	0.083% per month
Performance fee	10% with «high watermark»

SUBSCRIPTIONS

Availability	online banking/ Swiss banks
Subscriptions	monthly, last business day
Redemptions	monthly, three business days prior
ISIN	CH0561075661
Valor	56107566





POSITIONS AT THE END OF THE REPORTING PERIOD

	short	long	Net
Equities	0.0%	25.5%	25.5%
Volatility	-0.5%	0.0%	-0.5%
Bonds	0.0%	74.1%	74.1%
Currencies	-47.3%	47.3%	0.0%
Commodities	-13.7%	21.2%	7.4%
Metals	0.0%	4.4%	4.4%
Livestock	0.0%	11.3%	11.3%
Energy	-3.7%	0.0%	-3.7%
Food	0.0%	4.3%	4.3%
Agriculture	-10.0%	1.3%	-8.8%
Total	-61.6%	168.1%	106.5%
Absolute Total			229.8%

RETURNS BY ASSET CLASS

	MTD	YTD
Equities	-0.56%	2.06%
Volatility	-0.19%	0.83%
Bonds	-2.26%	-1.42%
Currencies	-0.54%	0.61%
Commodities	-0.57%	3.02%
Metals	-0.20%	-1.26%
Livestock	0.51%	-0.59%
Energy	-0.13%	-0.58%
Food	-0.59%	5.47%
Agriculture	-0.15%	-0.02%
Total	-4.12%	5.10%

HIGHEST RETURN CONTRIBUTIONS FOR THE MONTH

Cocoa	COM	0.08%
Natural Gas	COM	0.11%
CADUSD	FX	0.11%
EURUSD	FX	0.15%
Lean Hogs	COM	0.47%

LOWEST RETURN CONTRIBUTIONS FOR THE MONTH

DBR 10y	IR	-0.39%
ACGB 10y	IR	-0.41%
UST 10y	IR	-0.57%
UKT 10y	IR	-0.57%
Coffee	COM	-0.65%

MONTHLY NET RETURNS IN CHF

	Jan	Feb	Mar	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Gesamt
2024	1.49%	2.74%	3.12%	1.65%	-0.15%	0.72%	0.39%	-0.95%	0.29%	-4.12%			5.10%
2023	0.58%	0.50%	-2.97%	2.82%	2.24%	0.88%	0.49%	-0.35%	0.71%	0.17%	-0.08%	-0.43%	4.54%
2022	-4.94%	-1.85%	2.68%	-0.05%	-1.46%	-3.04%	-4.02%	-1.23%	3.05%	-1.50%	-6.18%	-0.04%	-17.43%
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%



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. Auch kann das absolute Gesamtengagement gegenüber einzelnen Anlagenklassen über 100% 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.