

# **DIVAS** GLOBAL BARRIER COUPON FOND OVERVIEW

Anteilsklasse I CHF dist hedged | Juli 2024

# **FONDSÜBERSICHT**

FONDSUBLIGITI	
Inventarwert pro Anteil	78.78
Fondsvermögen (m)	63'960'000
Fondsleitung	J. Safra Sarasin
	Investmentfonds AG, Basel
Depotbank	Bank J. Safra Sarasin AG,
	Basel
Portfolio Management	DIVAS Asset Management AG
	Zürich
Portfolio Manager	Daniel Habshush
	Tobias Widmer
Fondsdomizil Schweiz	Schweiz
ISIN-Nr.	CH0389634780
Valoren-Nr.	38963478
Bloomberg Ticker	DGBICDH SW
Lancierungsdatum	14.11.2017
Abschluss Rechnungsjahr	August
Laufende Kosten	0.89%
Verwaltungsgebühr	0.75%
Rechnungswährung	USD
Währung Anteilsklasse	CHF
Ausschüttungshäufigkeit	halbjährlich
Total Ausschüttungen (CHF/Anteil)	10.00
Ausgabekom. max	0%
Rücknahmekom. max	0%
Rechtsform	FCP
Ausgabe/Rücknahme	wöchentlich
Benchmark (BM)	n.a.

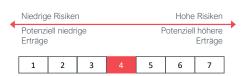
# Statistische Kennzahlen Fonds Volatilität 10.3% Sharpe Ratio -0.16

Die statistischen Kennzahlen werden auf der Basis der Vormonate berechnet (Seit Lancierung, Basis USD).

#### Cash & Fixed Income Portfolio - Kennzahlen

Ø-Rating	Aaa
Ø-Restlaufzeit (Monate)	5.59
Verfallrendite	5.05%
Modified Duration	0.45
Cash Quote	3.1%

# **RISIKO - UND ERTRAGSPROFIL**



Die ausgewiesene Risiko- und Ertragskategorie beruht auf historischen Daten und kann nicht als verlässlicher Hinweis auf das künftige Risikoprofil des Fonds herangezogen werden. Die Einstufung des Fonds kann sich im Laufe der Zeit ändern und stellt keine Garantie dar.

# **FONDSPORTRAIT**

Der DIVAS Global Barrier Coupon Fund nutzt eine exklusive «Put-Writing-Strategie» auf globalen Aktienindizes, kombiniert mit aktivem Portfoliomanagement und striktem Risikomanagement. Ziel ist eine «Cash-Plus-Rendite» mit einer zusätzlichen Prämie von 1-4% über dem risikofreien Zinssatz. Der Fond adressiert damit die Schwächen passiver Strategien und strukturierter Produkte. Der DIVAS Global Barrier Coupon Fund weist ein niedriges Beta und geringe Korrelation zu Anleihen und Aktien auf. Durch konsequentes Ernten von Optionsprämien und rigoroses Risikomanagement strebt der Fonds nach stetigen Renditen über verschiedene Marktzyklen hinweg und erhöht so das Renditepotenzial und die Stabilität traditioneller Multi-Asset-Portfolios.

#### Wertentwicklung\* index



						p
Fonds*	0.15%	0.65%	1.57%	2.87%	2.85%	-1.39%
	2021	2022	2023		Sei	t Lancierung
Fonds*	3.66%	1.36%	4.31%			-10.39%

3 Monate

#### Grösste Positionen - Fixed Income Portfolio

1 Monat

0 US Gov 05/15/2025	17.3%
0 US Gov 06/12/2024	8.3%
0 US Gov 240808	7.9%
0 US Gov 240905	7.9%
0 US Gov 250320	7.7%
0 US Gov 241003	6.7%

# Grösste Positionen - Option Overlay

Put on EURO STOXX 50 INDEX	7.4%
Put on EURO STOXX 50 INDEX	7.2%
Put on S&P 500 Index	7.1%
Put on S&P 500 Index	7.0%
Put on S&P 500 Index	4.9%
Put on EURO STOXX 50 INDEX	4.9%
Put on S&P 500 Index	4.1%
Put on S&P 500 Index	3.9%
Put on EURO STOXX 50 INDEX	3.9%
Put on S&P 500 Index	3.9%

# **Option Overlay**

	Kennzahlen	
	Exposure	96%
	Ø-Prämie	0.57%
	Ø-Tenor (Monate)	3.4
	Delta auf Fondslevel	0.08

#### **Option Overlay**

Aufteilung nach Regionen			
Schweiz			0%
Europa		41%	
Nord Amerika	59%		

# **Option Overlay**

Aufteilung nach Sektoren	
Energy	0%
Materials	0%
Industrials	0%
Consumer Discretionary 100%	
Consumer Staples	0%
Health Care	0%
Financials	0%
Real Estate	0%
Information Technology	0%
Telecommunication Services	0%
Utilities	0%

1 Jahr 3 Jahre p.a. 5 Jahre p.a.

<sup>\*</sup> Wertentwicklung netto Kosten und Gebühren, Ausschüttungen reinvestiert. Quelle: Divas Asset Management AG, Daten per 31.07.2024