



# COUPON FUND OVERVIEW

Anteilsklasse I USD dist | Juni 2024

## FONDSÜBERSICHT

|                                   |  |
|-----------------------------------|--|
| Inventarwert pro Anteil           | 92.9   |
| Fondsvermögen (m)                 | 65'725'096   |
| Fondsleitung                      | J. Safra Sarasin   |
| Depotbank                         | Investmentfonds AG, Basel<br>Bank J. Safra Sarasin AG, Basel |
| Portfolio Management              | DIVAS Asset Management AG<br>Zürich                          |
| Portfolio Manager                 | Daniel Habshush<br>Tobias Widmer                             |
| Fondsdomizil Schweiz              | Schweiz  |
| ISIN-Nr.                          | CH0365134698   |
| Valoren-Nr.                       | 36513469   |
| Bloomberg Ticker                  | DGBCIUD SW   |
| Lancierungsdatum                  | 18.09.2018   |
| Abschluss Rechnungsjahr           | August   |
| Laufende Kosten                   | 0.89%  |
| Verwaltungsgebühr                 | 0.75%  |
| Rechnungswährung                  | USD  |
| Währung Anteilsklasse             | USD  |
| Ausschüttungshäufigkeit           | halbjährlich   |
| Total Ausschüttungen (USD/Anteil) | 11.72  |
| Ausgabekom. max                   | 0%   |
| Rücknahmekom. max                 | 0%   |
| Rechtsform                        | FCP  |
| Ausgabe/Rücknahme                 | wöchentlich  |
| Benchmark (BM)                    | n.a.   |

## Statistische Kennzahlen

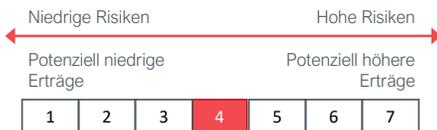
| Statistische Kennzahlen | Fonds |
|-------------------------|-------|
| Volatilität             | 10.8% |
| Sharpe Ratio            | 0.08  |

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) | 6.07  |
| Verfallrendite          | 5.15% |
| Modified Duration       | 0.48  |
| Cash Quote              | 4.7%  |

## 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



|        | 1 Monat | 3 Monate | YTD   | 1 Jahr | 3 Jahre p.a. | 5 Jahre p.a. |
|--------|---------|----------|-------|--------|--------------|--------------|
| Fonds* | 0.39%   | 1.33%    | 1.89% | 7.27%  | 5.64%        | 0.96%        |

|        | 2021  | 2022  | 2023  | Seit Lancierung |
|--------|-------|-------|-------|-----------------|
| Fonds* | 4.66% | 3.60% | 8.89% | 5.05%           |

## Grösste Positionen - Fixed Income Portfolio

|                     |       |
|---------------------|-------|
| 0 US Gov 05/15/2025 | 16.5% |
| 0 US Gov 06/12/2024 | 8.0%  |
| 0 US Gov 240711     | 7.6%  |
| 0 US Gov 240808     | 7.6%  |
| 0 US Gov 240905     | 7.5%  |
| 0 US Gov 250320     | 7.3%  |

## Grösste Positionen - Option Overlay

|                            |      |
|----------------------------|------|
| Put on EURO STOXX 50 INDEX | 7.0% |
| Put on S&P 500 Index       | 6.8% |
| Put on EURO STOXX 50 INDEX | 6.8% |
| Put on S&P 500 Index       | 6.7% |
| Put on EURO STOXX 50 INDEX | 5.2% |
| Put on EURO STOXX 50 INDEX | 4.7% |
| Put on S&P 500 Index       | 3.7% |
| Put on EURO STOXX 50 INDEX | 3.5% |
| Put on S&P 500 Index       | 3.2% |
| Put on S&P 500 Index       | 3.0% |

## Option Overlay

| Kennzahlen           |       |
|----------------------|-------|
| Exposure             | 80%   |
| Ø-Prämie             | 0.45% |
| Ø-Tenor (Monate)     | 4.1   |
| Delta auf Fondslevel | 0.04  |

## Option Overlay

| Aufteilung nach Regionen |     |
|--------------------------|-----|
| Schweiz                  | 0%  |
| Europa                   | 45% |
| N. Amerika               | 55% |

## 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%   |

\* Wertentwicklung netto Kosten und Gebühren, Ausschüttungen reinvestiert. Quelle: Divas Asset Management AG, Daten per 28.06.2024

Dieses Factsheet wurde von DIVAS Asset Management AG lediglich zu Werbe- und Informationszwecken und gestützt auf eigene Daten erstellt. Die rechtsverbindlichen Dokumente, also der aktuelle Verkaufsprospekt, die wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger sowie der Jahres- und Halbjahresbericht sind kostenlos bei der Depotbank (Bank J. Safra Sarasin AG, Elisabethenstrasse 62, CH-4002 Basel, Schweiz) und der Fondsleitung (J. Safra Sarasin Investmentfonds AG, Wallstrasse 9, CH-4002 Basel, Schweiz) erhältlich."