



Swisscanto (LU) Alternative Risk Premia Fund

Neuer Swisscanto-Fonds mit Fokus auf alternative Risikoprämien für Institutionelle und Vermögensverwalter

Frankfurt, 27. November 2017 – Der Anfang November aufgelegte Swisscanto (LU) Alternative Risk Premia Fund ist ab sofort zum öffentlichen Vertrieb in Deutschland und Österreich zugelassen. Der Fonds legt den Fokus auf die Nutzung alternativer Risikoprämien und ermöglicht professionellen Anlegern einen zielgerichteten Zugang zu bisher nicht separierten Performancequellen. Die Vielfalt der Prämien aus den unterschiedlichsten Assetklassen gestattet die Konstruktion eines Portfolios, das gegenüber Aktien und Anleihen attraktive Korrelationseigenschaften aufweist.

„Mit diesem Fonds bieten wir einen Baustein an, der die Abhängigkeit von den traditionellen Anlageklassen reduziert und die Diversifikation in einem Gesamtportfolio sinnvoll erhöht. Der Fonds notiert in Schweizer Franken mit abgesichertem Währungsrisiko gegenüber den Anlagewährungen. Es gibt zum Fondsstart zwei thesaurierende Tranchen, die für institutionelle Investoren sowie Vermögensverwaltungen zum Vertrieb zugelassen sind“, so Jan Sobotta, Leiter Sales Ausland bei Swisscanto Asset Management International S.A..

Anleger profitieren vom „All-Wetter-Portfolio“

Der Swisscanto (LU) Alternative Risk Premia Fund investiert im Bereich der nicht-traditionellen Anlagen über alle Anlageklassen hinweg in 15 bis 20 mehrheitlich marktneutrale alternative Risikoprämien und erzeugt mit diesen Prämien ein diversifiziertes, alternatives Portfolio. „Traditionelle Risikoprämien kompensieren den Anleger für das Tragen eines systematischen Risikos. Dies können zum Beispiel Zinsrisiken, Kreditrisiken, Marktrisiken oder auch Währungsrisiken sein. Alternative Risikoprämien hingegen entlohen spezifische Risiken oder – basierend auf Erkenntnissen der Behavioral Finance – diverse Verhaltensmuster wie beispielsweise Angebots-/Nachfrage-Ungleichgewichte und weitere gut erforschte Marktineffizienzen“, so Sobotta.

Der Swisscanto (LU) Alternative Risk Premia Fund legt innerhalb der traditionellen Anlagenklassen in fünf verschiedene Hauptkategorien von alternativen Risikoprämien an. Diese sind: 1. Volatility (Optionsprämien ernten), 2. Carry (Einkommen ernten), 3. Momentum/Trend (Gewinner kaufen, Verlierer verkaufen), 4. Value (billig kaufen, teuer verkaufen) und 5. Defensive (Ausnutzung von irrationalem Investorenverhalten).

„Die Prämien werden mit einem risikobasierten Ansatz und dem ‚Humanlast-look‘ kombiniert, wobei im Rahmen der Portfoliokonstruktion das Verhalten der Prämien, ihre Volatilität, das Tail-Risiko sowie die Korrelation der Prämien untereinander berücksichtigt werden. Generell strebt der Fonds eine Volatilität von sechs bis acht Prozent an und stellt ein marktneutrales Element für Portfolios dar. Mit dieser Strategie erschließt das Management alternative Risikoprämien, bringt unkorrelierte Renditetreiber ins Depot und reduziert so die Abhängigkeit von den traditionellen Anlageklassen. Schlussendlich sollen die Investoren von einem ausgewogenen und robusten ‚All-Wetter-Portfolio‘ profitieren“, sagt Sobotta.

Fondsdaten:

Fondsname	ISIN
Institutionelle Kunden/Vermögensverwaltungskunden	
Swisscanto (LU) Alternative Risk Premia Fund DTH CHF (thesaurierend)	LU1676040725
Swisscanto (LU) Alternative Risk Premia Fund GTH CHF (thesaurierend)	LU1676041020

Merkmal	Beschreibung
Fondsname	Swisscanto (LU) Alternative Risk Premia Fund
Fondsdomizil	Luxemburg
Struktur	Luxemburg UCITS
Verwaltungsgesellschaft	Swisscanto Asset Management International S.A.
Depotbank	RBC Investor Services Bank S.A., Luxemburg
Portfolio Manager	Zürcher Kantonalbank, Zürich
Währung	CHF (hedged)
Emissionspreis	100 CHF per Lancierung am 2. November 2017
Management Fee	DTH-Tranche: 0,55 % GTH-Tranche: 0,45 %
Ausgabe-/Rücknahme-kommission	Max. Ausgabekommission: 5%, Rücknahmekommission: keine
Zulassungen zum öffentlichen Vertrieb	Luxemburg, Deutschland, Österreich und Schweiz

Für weitere Auskünfte oder falls Sie Kontakt zu einem Ansprechpartner bei Swisscanto Invest wünschen, wenden Sie sich bitte an: männer p.r., Frank Männer, 0711/490 66-171, fm@maenner-pr.de

Swisscanto Invest

Ausgewiesene Spezialistinnen und Spezialisten entwickeln unter der Marke Swisscanto Invest qualitativ hochstehende Anlageprodukte. Die Swisscanto-Fonds werden regelmäßig international ausgezeichnet.

www.swisscanto.com