

Metzler bei Managed Futures an der Spitze

Metzler-Strategie erhält UCITS Alternative Index Award

Der von Metzler Asset Management gemanagte Publikumsfonds Nordea 1 – Heracles Long/Short MI Fund hat von Alix Capital die Auszeichnung „Bester CTA UCITS Absolute Return Fund 2013“ über drei Jahre erhalten. Der Fonds erzielte über diesen Zeitraum einen Wertzuwachs von 11,74 %*. 2013 erreichte er mit 12,71 %* das beste Jahresergebnis seit Auflegung und erhöhte die Outperformance seit Auflegung gegenüber dem UCITS Alternative Index CTA auf über 27 %-Punkte.

Die UCITS Alternative Index Awards sind unabhängige Auszeichnungen, die einmal im Jahr von Alix Capital verliehen werden – einem der führenden Anbieter von UCITS-Alternatives-Indizes. In 13 Kategorien werden jeweils die beiden UCITS-Absolute-Return-Fonds ausgezeichnet, die über ein bzw. drei Jahre die beste risikoadjustierte Performance (netto, per 31. Dezember) erzielt haben. Die Auszeichnung des Heracles-Fonds über den Dreijahreszeitraum unterstreicht die Qualität des Ansatzes, der bereits 2009 zur „Fondsinnovation des Jahres“ im Rahmen der Euro Fund-Awards gewählt wurde.

Metzlers Managed-Futures-Ansatz: unkorrelierte Renditen und starke Diversifikationseffekte durch Optionsreplikation

Auf Basis des von Metzler Asset Management entwickelten Managed-Futures-Ansatzes erreicht der dynamisch gesteuerte Fonds Renditen, die langfristig gering korreliert zu klassischen Anlageklassen wie Aktien und Renten sind. Die hohe Diversifikation über Anlageklassen, Märkte und Zeiträume senkt die Drawdowns, reduziert die Volatilität im Portfolio und stabilisiert die Renditen. Der Fonds profitiert von anhaltenden Markttrends, kann sich aber auch in trendlosen Phasen – im Gegensatz zu vielen konventionellen Managed-Futures-Programmen – behaupten. Auch über einen längeren Zeithorizont überzeugt der Heracles-Fonds mit seiner hochdynamischen Partizipation in Trendmärkten und seiner Effizienz in volatilen Seitwärtsmärkten.

* Quellen: Thomson Reuters Datastream, Berechnungen Metzler. Die Wertentwicklung bezieht sich auf die institutionelle Anteilklasse AI, errechnet nach BVI-Methode unter Berücksichtigung aller auf Fondsebene anfallenden Kosten, ohne sämtliche auf Kundenebene anfallende Kosten einzubeziehen.

Ansprechpartner für Presseanfragen

Jörg-Matthias Butzlaff

Tel. (+49 - 69) 21 04 - 49 75

E-Mail MButzlaff@metzler.com