



Merit: Auszeichnung für Managed Futures „Blue Danube“
09.12.2008

Der Blue Danube Fund Futures Select schaffte bei den diesjährigen Dachfonds Awards des „geld-Magazins“ in der Kategorie „Hedge Dachfonds“ gleich zweimal auf das Siegerpodest, einmal mit 13 Prozent als Sieger in der 1-Jahreswertung und mit 30,3 Prozent als Zweiter im Vergleich der 5-Jahresperformance. „Im heurigen Jahr haben vor allem mittel- und langfristige Trendfolgeansätze zur positiven Rendite beigetragen, der Futures Select konnte die Trends auf den Aktien-, Zins- und Währungsmärkten gut ausnutzen. Wir spüren durch die jahrelange Konstanz der Fondsperformance derzeit starkes Interesse von institutionellen, sicherheitsorientierten Anlegern“, freut sich Fondsmanager Michael Zillner, Gründer und CEO der Merit-Gruppe, über die Auszeichnungen.

Investmentstrategie Futures Select

Der 1995 aufgelegte Futures Select Fund wird seit November 2000 nach der Strategie des MERIT Futures Portfolio verwaltet. Das Multi-System Managed Futures/CTA-Produkt, unterscheidet sich im Wesentlichen durch den Einsatz unterschiedlicher Manager und Stile (u.a. Day Trading/Short-term, mittel- und langfristiger Trendfolge) von anderen Produkten seiner Vergleichsgruppe. Die Allokationen innerhalb dieses Portfolios werden mittels eines eigens entwickelten Riskmanagementansatzes gesteuert. Zusätzlich risikominimierend ist auch die starke Diversifikation des Marktportfolios auf über 80 unterschiedliche Märkte (Aktienindizes, Währungen, Anleihen, Metalle, Getreide etc.). Co-Fondsmanager Markus Leitner: „Die Auszeichnungen bestätigen erneut unsere Strategie, - auch im relativ volatilen Managed Futures Bereich ist es möglich, Produkte konservativ zu managen und bei ansprechender Performance einstellige Volatilitäts- und Maximum-Drawdown Werte zu erzielen!“ Der Futures Select gewann im Oktober 2,38 Prozent und liegt somit für das Gesamtjahr 2008 bei 12,52 Prozent.

Neben einer breiten Diversifikation zeichnet den Futures Select Fund auch eine niedrige Kostenstruktur aus. Sämtliche Orders werden über Merit geführt, sodass eine zentrale Risiko-Steuerung möglich ist. Der Futures Select ist eine sinnvolle Ergänzung zu bestehenden Allokationen im Hedge Fund-of-Fund Bereich und als Einstiegsprodukt in den CTA-Bereich konzipiert. Besonders Wert wird auf die Reduzierung des Kursverlustrisikos durch den strikten Ansatz für das Risikomanagement (permanent Real-Time P&L sowie Risikoüberwachung) gelegt.