

Merit feiert Erfolge mit Managed Futures-Fonds

"Blue Danube Fund Futures Select" im August mit +2,22% ein Outperformer



Managed Futures entwickeln sich in Zeiten fallender Aktienkurse naturgemäss "positiver" als die klassischen Aktienmärkte. So ist es nicht verwunderlich, dass einige Managed Futures-Fonds nun schöne Erfolge erzielen können. Das gilt auch für mehrere österreichische Anbieter, wie etwa die Merit Alternative Investments GmbH.

Deren "Blue Danube Fund Futures Select" konnte entgegen den aktuellen negativen Börsentrends und massiven Rückgängen im August eine positive Performance von +2,22% erzielen. Die aktuelle Jahresperformance des Fonds liegt per 25. September bei rund +7,50% und bestätigt damit seine Ertragerwartungen. In den letzten Wochen wurden vor allem mit Longpositionen im US-Dollar und auf den Anleihemärkten verdient. Zusätzlich konnten auch die Abwärtstrends auf den Energie- und Metallmärkten gewinnbringend genutzt werden.

Der "Futures Select Fund" ist ein Multi-Style-Produkt im Managed Futures Bereich das aus unterschiedlichen Modulen besteht. Der Fonds eignet sich durch sein moderates Ertrags-/Risikoprofil gut als "Einstiegsprodukt" in den Bereich der Alternativen Investments, ist Merit-Geschäftsführer und Fondsmanager Andreas Mayer überzeugt: "Im aktuellen schwierigen Börsenumfeld eine positive Performance zu erzielen, zeigt Qualität und bestätigt unsere Strategie, - auch in dem relativ volatilen Managed Futures Bereich ist es möglich, Produkte konservativ zu managen und bei ansprechender Performance einstellige Volatilitäts- und Maximum-Drawdown Werte zu erzielen."

Die Investmentstrategie des "Blue Danube Futures Select" beschreibt Merit wie folgt:
"Der Blue Danube SICAV Umbrella, mit dem Teilfonds Futures Select, wurde 1995 von der Firma Benchmark aufgelegt und wird seit November 2000 nach der Strategie des MERIT Futures Portfolio verwaltet. Der Futures Select ist ein Multi-System (CTA)-Produkt, das sich im Wesentlichen durch die starke Diversifikation des Marktportfolios (Aktienindizes, Währungen, Anleihen, Metalle, etc.) und unterschiedlichen Managed-Futures Stile (u.a. Day Trading/Short-term, mittel- und langfristiger Trendfolge) von anderen Produkten seiner Vergleichsgruppe unterscheidet."

Neben einer breiten Marktdiversifikation über Aktien, Zinsinstrumente, Währungen, Metalle, Energie- und Agrarprodukte zeichnet den Futures Select auch eine niedrige Kostenstruktur aus. Sämtliche Orders werden über Merit geführt, sodass eine zentrale Risiko- und Leverage-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. Merit ist mit seinem "Blue Danube Fund Futures Select" auch mehrfacher Gewinner bei den Alternative Investments Awards.