

Universal-Investment und Novethos starten globalen Multi-Asset-Fonds

Der Münchner Vermögensmanager Novethos und die Frankfurter Investmentgesellschaft Universal-Investment starten den globalen Multi-Asset-Fonds SRM Systematic Growth UI (ISIN DE000A1JBY78). Der Fonds investiert primär über Investmentfonds, ETFs und Zertifikate in ein globales Universum verschiedenster Anlageklassen.

- **Bewährte quantitative Strategie als Fonds nun auch offen für breiteren Anlegerkreis**
- **Risikomanagementsystem ermöglicht Begrenzung von Verlustphasen**
- **Aktuell liegt der Schwerpunkt auf den Emerging Markets**

11. Juli 2012 - Der Münchner Vermögensmanager Novethos und die Frankfurter Investmentgesellschaft Universal-Investment starten den globalen Multi-Asset-Fonds [SRM Systematic Growth UI](#) (ISIN DE000A1JBY78). Der Fonds investiert primär über Investmentfonds, ETFs und Zertifikate in ein globales Universum verschiedenster Anlageklassen. Die Fondsberater von Novethos treffen ihre Entscheidungen sowohl bei der Auswahl der Instrumente als auch bei der Asset Allocation mit einem selbst entwickelten Anlage- und Risikomanagementsystem. Dieses quantitative Analysesystem ermöglicht eine emotionsfreie Portfoliosteuerung und führte in den vergangenen vier Jahren in zahlreichen Kundenportfolios zu sehr guten Risiko-Rendite-Profilen. So konnte mit der Strategie seit Beginn im November 2008 eine durchschnittliche jährliche Rendite von 9,17 Prozent erzielt werden.

„Unser Anspruch ist es, weltweit diejenigen Anlageklassen und Anlageinstrumente zu kombinieren, die im jeweiligen Marktumfeld das beste Gewinnpotenzial besitzen, ohne das Risiko aus den Augen zu verlieren“, so Ulrich Kniehase, Entwickler des Systems und Partner bei Novethos. „Aktuell führt das System zu einer eher ausgewogenen Risikostruktur mit 35 Prozent Aktien, 40 Prozent Anleihen und 11 Prozent Rohstoffen. Der regionale Schwerpunkt sowohl in den Aktienanlagen, als auch bei den Anleihen liegt in den Emerging Markets. Der Liquiditätsanteil aus dem Risikomanagementprozess beträgt etwa 14 Prozent und signalisiert eine ebenfalls eher vorsichtige Markteinschätzung“ beschreibt Kniehase die derzeitige Allokation.

Während des Investmentprozesses wird aus mehreren hundert Fonds, ETFs und Finanzinstrumenten schrittweise systematisch eine Best-of-Auswahl von 36 Positionen errechnet. Als Auswahlkriterien dienen Renditezahlen, Kursschwankungsbreiten (Sharpe Ratio), maximale Verlustgrößen (MAR-Ratio) sowie eine niedrige Korrelation in Verlustphasen. Die Gewichtung der einzelnen Positionen im Fondsportfolio erfolgt ebenfalls computergestützt und wird monatlich an die jeweilige Marktlage angepasst. In kritischen Marktphasen werden die individuellen Investitionsquoten verlustgefährdeter Titel schrittweise systematisch reduziert und Liquidität aufgebaut. Im Ergebnis soll sich aus den drei Bausteinen Instrumentenanalyse, Portfoliokonstruktion und Risikomanagement ein auf die jeweilige Marktlage angepasstes Fondsportfolio mit überschaubaren Verlustrisiken und überdurchschnittlichen Ertragschancen ergeben.

Die Daten zum SRM Systematic Growth UI auf einen Blick

Fondspartner	NOVETHOS Financial Partners GmbH, München
Investmentgesellschaft	Universal-Investment-Gesellschaft mbH, Frankfurt am Main
Depotbank	Hauck & Aufhäuser Privatbankiers KGaA, Frankfurt am Main
ISIN/WKN	DE000A1JBY78/A1JBY7
Fondswährung	EUR (Euro)
Fondskategorie	Mischfonds offensiv
Ertragsverwendung	Thesaurierend
Gebühr für Fondsberatung, Verwaltung & Depotbank	Derzeit effektiv 1,725 % p. a.
Ausgabeaufschlag	Bis zu 5 %
Mindestanlage	-
Erfolgsabhängige Vergütung	Bis zu 15 % p. a. der vom Fonds erwirtschafteten Rendite über dem Referenzwert von 4 % p. a. mit High-Water-Mark

Ihre Ansprechpartner:

Novethos Financial Partners GmbH	Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Andreas Meißner	Bernd Oberfell
- Geschäftsführer -	- Pressereferent -
Tel.: 089 / 20 30 44 - 110	Tel.: 069 / 7 10 43 - 575
E-Mail: andreas.meissner@novethos.de	E-Mail: bernd.oberfell@universal-investment.com

Über Novethos

Novethos Financial Partners mit Sitz in München ist ein ganzheitlicher Vermögensmanager mit besonderer Expertise im systematischen Asset Management. Die Gesellschaft ist im Privatbesitz und seit 2008 im deutschsprachigen Raum aktiv. Ulrich Kniehase ist Programmierer der Portfoliomanagement-Software und hat diese zusammen mit seinem Partner Wolfgang Kronschnabl in den vergangenen acht Jahren weiter perfektioniert. Beide Partner haben langjährig Erfahrungen in der Managed-Futures-Branche gesammelt und entwickelten wegen der dort vorherrschenden Problematik des Risikomanagements die Idee dieses unkonventionellen Asset-Management-Ansatzes. Weitere Informationen unter www.novethos.de

Über Universal-Investment

Universal-Investment ist mit einem verwalteten Vermögen von rund 138 Mrd. Euro, weit über 1.000 Publikums- und Spezialfondsmandaten und rund 430 Mitarbeitern die größte unabhängige Kapitalanlagegesellschaft (KAG) im deutsch-sprachigen Raum. Das Unternehmen konzentriert sich mit den drei Leistungsbereichen Administration, Insourcing und Risk Management auf die effiziente und risikoorientierte Verwaltung von Fonds, Wertpapieren, alternativen Investments und Immobilien. Die KAG ist die zentrale Plattform für unabhängiges Asset Management und vereint das Investment-Know-how von Vermögensverwaltern, Privatbanken, Asset Managern und Investmentboutiquen zu einer außer-gewöhnlichen Kollektion erstklassiger Private-Label-Fonds. Als Tochter renommierter Bankhäuser gehört die 1968 gegründete Universal-Investment mit Sitz in Frankfurt am Main sowie Töchtern und Beteiligungen in Luxemburg und Österreich zu den Pionieren in der Investmentbranche und ist heute Marktführerin in den Bereichen Master-KAG und Private-Label-Fonds. Geschäftsführer des Konzerns sind Oliver Harth (stv. Sprecher), Markus Neubauer, Stefan Rockel, Alexander Tannenbaum und Bernd Vorbeck (Sprecher der Geschäftsführung). Stand: 30.06.2012

Mehr Informationen unter www.universal-investment.de



