

Erstmals als UCITS III-Fonds: Varengold Alternative Alpha partizipiert an diversifiziertem Managed Futures-Index

Varengold Alternative Alpha – so heißt der neue UCITS III-Fonds der Varengold Wertpapierhandelsbank AG. Varengold ist es gelungen, einen innovativen Managed Futures-Index zu entwickeln, in den der täglich liquide UCITS III-Fonds investiert. Damit steht diese Anlagestrategie auch breiten Anlegerschichten offen. Aufgrund seiner erwarteten Ertragsstabilität sowie seiner Null-Korrelation zu Aktien- und Rentenmärkten, eignet sich der deutsche Fonds zur Optimierung eines klassischen Portfolios aus Aktien, Anleihen und Renten.

Hamburg – 15. Dezember 2010 – Die Varengold Wertpapierhandelsbank AG startet erstmals einen UCITS III-Fonds: den Varengold Alternative Alpha. „Fonds und Index sind aufgrund diverser Anfragen entstanden“, so Steffen Fix, Gründer und Vorstand der Varengold Wertpapierhandelsbank AG. „Unsere Kunden fragten bereits seit einiger Zeit nach einem UCITS III-Fonds mit Multi-Manager-Exposure. Über den neu geschaffenen Varengold Alternative Alpha Index ist es uns nunmehr gelungen, dem Kunden ein diversifiziertes risikooptimiertes Managed Futures-Universum in einem einfach investierbaren UCITS III-Fonds zur Verfügung zu stellen.“ Der Fonds startet mit einer institutionellen Anteilsklasse (WKN: A1C5D5), eine Anteilsklasse für Privatkunden ist für Anfang 2011 geplant.

Institutionelle Investoren erhalten mit dem Fonds eine flexible Investmentmöglichkeit und partizipieren an der Entwicklung des Varengold Alternative Alpha Index. Der Fonds bildet dabei die Wertentwicklung eines richtlinienkonformen Managed Futures Index ab. Die Index-Komponenten erwirtschaften ihre Erträge an mehr als 200 Finanzmärkten - und zwar sowohl bei steigenden als auch bei fallenden Kursen. „Der Varengold Alternative Alpha soll mittelfristig unabhängige Renditen zu den traditionellen Anlageklassen

Aktien, Anleihen oder Renten liefern“, erklärt Yasin Sebastian Qureshi, Gründer und Vorstand der Varengold Wertpapierhandelsbank AG. Die Schwierigkeit für uns war es einen Index aufzubauen, der gemäß den deutschen Anforderungen eine tägliche Liquidität aufweist. Mit dem Index als auch dem UCITS III-Fonds haben wir uns erneut bewusst für den Standort Deutschland entschieden, welcher unserer Einschätzung nach im Vergleich zu anderen Standorten wesentlich größere Anforderungen stellt und somit erhöhte Transparenz und Sicherheit liefert.“ Der richtlinienkonforme Managed Futures-Index setzt sich aus einem Portfolio von internationalen Top Asset Managern zusammen, die den hohen Kriterien für die Indexaufnahme erfüllen müssen. „Wir setzen bei der Indexzusammensetzung auf ein Höchstmaß an Qualität und Sicherheit. Daher werden nur Manager berücksichtigt, die auf Managed Account Plattformen mit täglicher Liquidität zu finden sind. Zudem müssen die Asset Manager für eine potentielle Indexaufnahme einen realen Track Record von zwei Jahren, ein verwaltetes Volumen in Höhe von mindestens 100 Millionen US-Dollar aufweisen und im Rating des Varengold Risk Managements Systems beste Ergebnisse erzielen. Der Manager-Auswahlprozess und die Asset Allokation sind tragende Pfeiler, um die Stabilität des Index zu gewährleisten“, betont Qureshi. Hierbei wird das Konzept von der mehr als 15-jährigen Expertise von Varengold im Bereich der Manager Due Diligence, Risikoüberwachung und alternative Investments profitieren. Aktuell setzt sich der Index aus sieben Managern zusammen, die mit ihren Strategien in folgende Substrategien unterteilt werden können: 45 Prozent „Short-Term Trading“ (kurzfristige Trendfolgemodelle mit einer Haltedauer von 1-14 Tagen), 30 Prozent „Trend Following“ (mittel- bis langfristige Trendfolgemodelle mit einer Haltedauer von 3–18 Monaten.) und 25 Prozent „Global Macro“ (Handelsmodelle auf Basis fundamentaler Daten für mittel- bis langfristige Trends).

Der Varengold Alternative Alpha strebt ein optimiertes Rendite- und Volatilitätsziel an, die dekorrelierte Zielrendite liegt bei 10 Prozent über 3-Monats-Euribor.“

Varengold Alternative Alpha Anteilklasse I (Institutionell):

Fondsbezeichnung	Varengold Alternative Alpha
WKN	A1C5D5
ISIN	DE000A1C5D54
Rechtsform	Deutscher UCITS III Fonds
Währung	Euro
Nettoinventarwert	täglich
Asset Manager	Varengold Wertpapierhandelsbank AG
Verwaltungsgebühr	aktuell 1,34 % p.a
Gewinnbeteiligung	10 % mit High Water Mark und Hurdle Rate (3-Monats-Euribor)
Rücknahme	täglich
Depotbank	State Street Bank GmbH, München

Über Varengold:

Die Varengold Wertpapierhandelsbank AG ist eine deutsche Investmentbank mit zwei Kerngeschäftsfeldern – Asset Management und Capital-Markets-Brokerage. Mit Kunden aus über 85 Ländern und ausgewählten Partnern – Banken, Brokern, Hedgefonds- sowie Asset Managern – zählt Varengold zu den Global Playern.

Varengold wurde als Asset-Management-Boutique 1995 von Steffen Fix und Yasin Qureshi gegründet und fokussiert sich seitdem auf die regulierte sowie krisensichere Anlageklasse Managed Futures. Der große Erfolg im Asset Management mit Managed Futures forcierte 1998 den Ausbau des arrondierenden Geschäftsfelds Capital-Markets-Brokerage. Heute ist die Varengold Bank an der Deutschen Börse gelistet und bei der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) registriert. Sie verwaltet hauptsächlich Kundengelder institutioneller Investoren in maßgeschneiderten Strukturen sowie zum öffentlichen Vertrieb zugelassene Managed Futures-Produkte für Privatinvestoren.

Seit Gründung erzielte Varengold auf Grund der langjährigen Expertise weit überdurchschnittlich gute Handelsergebnisse im Asset Management. Mit dem Ziel, transparente, leistungsstarke und liquide Finanzprodukte anzubieten, zählt Varengold zu den renommiertesten und erfolgreichsten Asset Managern seiner Klasse weltweit.

Seit dem 20. März 2007 ist die Varengold Wertpapierhandelsbank AG (ISIN DE0005479307) im Entry Standard der Deutschen Börse in Frankfurt notiert.

Weitere Informationen zum Unternehmen unter www.varengold.de

Pressekontakt:

Christina Tilli
Varengold Wertpapierhandelsbank AG
Große Elbstraße 27
22767 Hamburg
Tel.: 040 / 66 86 49 52
Fax: 040 / 66 86 49 49
c.tilli@varengold.de