

7orca Vega Return Publikumsfonds hat erste Prüfung in einem herausfordernden Volatilitätsmarkt bestanden

- Der 7orca Vega Return Publikumsfonds ist ein echter Multi-Asset Short-Volatility Fonds und vereinnahmt global die Volatilitätsrisikoprämie in den Anlageklassen Aktien, Anleihen und Währungen.
- Die Marktverwerfungen der ersten Jahreshälfte 2018 waren ein wirkungsvoller Praxistest für alle Short-Volatility-Strategien, auch für den im Dezember 2017 aufgelegten 7orca Vega Return. Seit Februar 2018 befindet er sich im deutlichen Aufwärtstrend, die Wertentwicklung seit Jahresbeginn ist positiv.
- Systematischer Investmentprozess und stringentes Risikomanagement zahlen sich aus.

Hamburg, 02. August 2018. Die 7orca Asset Management AG (7orca) ist auf quantitative Investmentstrategien zur Absicherung von Währungsrisiken und zur Vereinnahmung von Volatilitätsrisikoprämien spezialisiert. Der am 04.12.2017 aufgelegte Publikumsfonds 7orca Vega Return (ISIN: DE000A2H5XY6 für Anteilsklasse I und DE000A2H5XX8 für Anteilsklasse R) hat Anfang Juli 2018 die Talsohle durchschritten und die Marktturbulenzen des ersten Halbjahres hinter sich gelassen.

Volatilitätsrisikoprämie als Renditequelle

Die Volatilitätsrisikoprämie ist eine ökonomisch fundierte und empirisch nachgewiesene Renditequelle, die jedoch nicht direkt investierbar ist. Durch Optionsgeschäfte bietet 7orca Vega Return einen effizienten Zugang zu dieser Prämie. „Mit unserem prognosefreien, systematischen Investmentansatz vereinnahmen wir die Volatilitätsrisikoprämie global in den Aktien-, Anleihen- und Währungsmärkten“, erklärt Tom Pansegrau, CFA, Senior Portfoliomanager bei 7orca.

„Durch den Verkauf von Optionen auf die liquidesten Marktindizes kann eine langfristige, positive Rendite erzielt werden. Die Volatilitätsstrategie ist grundsätzlich nicht-direktional und überwiegend unabhängig vom vorherrschenden Wirtschafts- und Zinszyklus“, sagt der Fondsmanager.

Risikomanagement – ein integraler Bestandteil des Investmentprozesses

Pansegrau, der seit 2011 mit Short-Volatility-Strategien betraut ist und bei 7orca in diesen aktuell mehr als 70 Millionen Euro in einem Publikumsfonds und Spezialfondsmandaten verantwortet, setzt ein stringentes und ganzheitliches Risikomanagement um. Sein Portfolio ist stets über die Basiswerte hinweg global diversifiziert.

Wie auch für die übrigen Short-Volatility-Strategien war die schwierige Marktphase in der ersten Jahreshälfte 2018 und insbesondere der sprunghafte Anstieg der Volatilität im Februar 2018 eine Herausforderung für den 7orca Vega Return. Der Ende 2017 aufgelegte Fonds hat die Verluste seit Jahresbeginn aufgeholt. So nimmt die Wertentwicklung des Fonds seit Jahresbeginn unter seinen Mitbewerbern einen der vorderen Plätze ein. Die Total Expense Ratio beträgt 0,72 Prozent für die institutionelle Anteilsklasse, eine Performance Fee wird nicht erhoben.

7orca Vega Return ist ein sinnvoller Portfoliobaustein

Tindaro Siragusano, CEO von 7orca, fasst zusammen: „Die 7orca Vega Return Strategie gewährt als echte, global diversifizierte Multi-Asset Short-Volatility Strategie Zugang zu einer natürlichen Renditequelle. Hierzu bieten wir unseren Anlegern als Investmentvehikel sowohl einen effizienten Publikumsfonds als auch maßgeschneiderte Spezialfondslösungen an.“

Pressekontakt:

Silke Blum, CAIA
silke.blum@7orca.com
+49 (0) 40 3346 046-12
7orca Asset Management AG
Am Sandtorkai 77
20457 Hamburg, Deutschland
www.7orca.com

