

PRESSEINFORMATION

Marktunabhängigkeit in turbulenten Zeiten mit Long/Short-Ansatz

First Private Systematic Commodity erreicht dreijährigen Track Record

- **Dreijähriger Track Record erreicht: 6,3 Prozent Rendite pro Jahr; Sharpe Ratio beträgt 0,8; keine Korrelation zu Aktien oder Anleihen**
- **Quantitativer Multifaktor-Ansatz ermöglicht systematisches Alpha über unterschiedliche Rohstoffmärkte, Zyklen und Terminkurven**
- **Breiter Investitionsspielraum und unkorrelierte Erträge durch Long- und Shortpositionierung**

Frankfurt, 1. Dezember 2021. Der First Private Systematic Commodity [ISIN: DE000A0Q95D0] erreichte am 30.11.2021 seinen dreijährigen Track Record, eine wichtige Zielmarke für institutionelle Investoren und Fondsselektoren. Seit Auflegung 2018 erzielte der Rohstofffonds, der als UCITS-konformes Vehikel für institutionelle Investoren aufgelegt wurde, eine Rendite von 20,1 Prozent. Dies entspricht einer Performance von 6,3 Prozent pro Jahr. Das Sharpe Ratio beträgt 0,8. Damit überzeugte er in einem volatilen Marktumfeld, das seit zwei Jahren von den Unsicherheiten rund um die Covid-19-Pandemie geprägt ist.

„Rohstoffinvestments können das Risiko-Rendite-Profil eines klassischen Portfolios deutlich verbessern, da sie nur gering zum Aktien- und Rentenmarkt korreliert sind“, sagt Richard Zellmann, Geschäftsführer von First Private. „In den Portfolios von institutionellen Investoren sind Rohstoffe jedoch noch unterproportional vertreten. Gerade Long-Short Investments eignen sich für den Wiedereinstieg, da sie ein breiteres Anlagespektrum ermöglichen und die mitunter großen Drawdowns reiner Rohstoffinvestments vermeiden helfen. Investierbare UCITS-Lösungen für einen breiten Strauß an Rohstoffen sind bis dato allerdings noch selten. Die Nachfrage nach aktiv gemanagten Rohstoff-Publikumsfonds nimmt aber Fahrt auf.“

Systematisches Alpha über unterschiedliche Märkte

Der First Private Systematic Commodity investiert über Long- und Short-Positionen in insgesamt 14 Rohstoffe aus den Segmenten Energie, Basismetalle und Edelmetalle. Agrarrohstoffe und Lebensmittel sind aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. Das Management setzt auf zehn quantitative Substrategien, um durch Ausnutzung von saisonalen Mustern, Kurvensignalen und Preismomentum ein systematisches Alpha über unterschiedliche Märkte zu erzielen. „Wir vermeiden die oft zu beobachtende Reduktion auf einzelne, beliebte Rohstoffsignale, sondern investieren über unterschiedlichste Strategien. Nur so lässt sich in dieser Asset-Klasse echte Diversifikation erreichen“, sagt Christian Schuster, Senior Portfolio Manager des First Private Systematic Commodity.

Das Fondsmanagement richtet das Portfolio monatlich komplett neu aus, um flexibel auf aktuelle Marktentwicklungen reagieren zu können. Zudem wird mit liquiden Derivaten gearbeitet, sodass der Fonds täglich handelbar ist. Die Strategie des First Private Systematic Commodity bewährt sich bereits seit mehr als sechs Jahren in den Multi-Strategy-Portfolios von First Private. Insgesamt hat die Fondsboutique mehr als 13 Jahre Erfahrung als Rohstoff-Quant-Manager.

Im kommenden Jahr 2022 wird sich das Umfeld voraussichtlich weiter günstig darstellen. Aufgrund dynamischer Entwicklungen, sowohl auf der Angebots- als auch der Nachfrageseite, werden sich einzelne Rohstoff-Future-Kurven sichtbar verändern, woraus sich interessante Opportunitäten ergeben können.

Abbildung 1: Korrelation Portfolio First Private Systematic Commodity und traditionelle Asset-Klassen

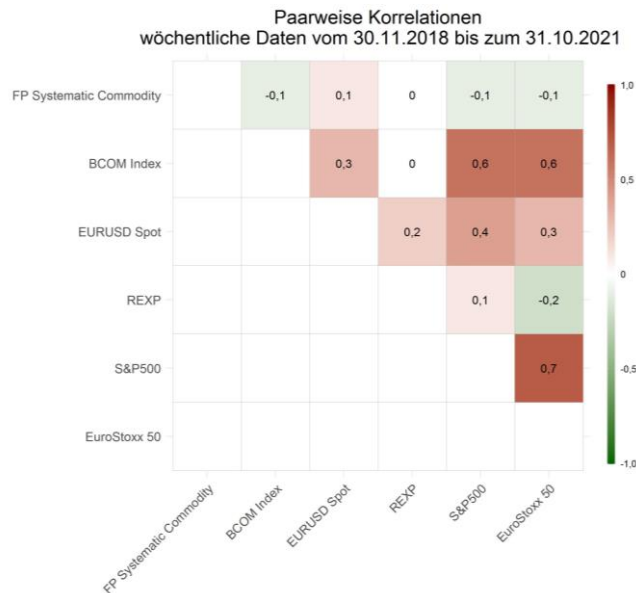
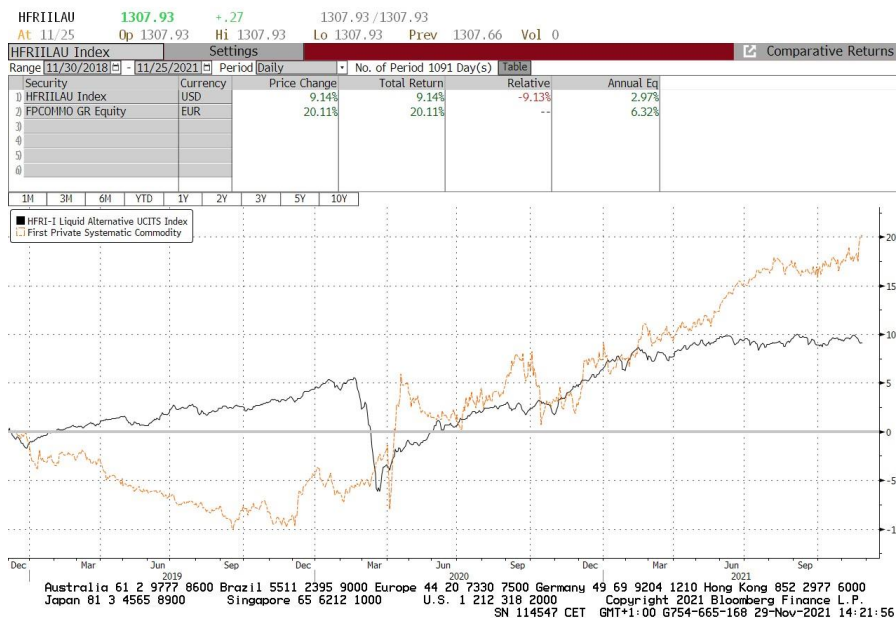


Abbildung 2: Performance First Private Systematic Commodity im Vergleich zum HFRI-Liquid Alternative UCITS Index



FP Investment Partners

Der Boutiquen-Verbund FP Investment Partners wurde 2020 auf Initiative der der Frankfurter FP Gruppe um den Investment Manager und Fondsiniciator FIRST PRIVATE Investment Management ins Leben gerufen. Ziel ist es, institutionellen Investoren Zugang zu alternativen Assetklassen zu ermöglichen, ihre Kapitalanlage nachhaltig zu stärken und gleichzeitig das Potenzial aufstrebender,

spezialisierte Investment-Teams zu fördern. „FP Investment Partners“ vernetzt die Leistungen aller Partner zugunsten optimaler Kundenlösungen. Das Angebot umfasst Alternative Investments, Real Assets sowie Quant-Investing der neuesten Generation. Die eng verbundenen Boutiquen-Partner sind unabhängige Teams mit klarer Ausrichtung, langfristigen Engagement und ausgeprägten Überzeugungen. Zu den von FP Investment Partners repräsentierten Firmen gehören unter anderem First Private Investment Management, re:cap global investors ag und Resonanz Capital. Gemeinsam betreuen oder verwalten sie insgesamt Vermögen von mehr als 5 Milliarden Euro. (Stand: Februar 2021).

Weitere Informationen unter: www.fp-investmentpartners.com

Presseinformationen: Fabienne Fahrenholtz

redRobin. Strategic Public Relations GmbH. Virchowstraße 65b. In der alten Fassfabrik. 22767 Hamburg. Tel: 040.692 123-25. Mail: fahrenholtz@red-robin.de Web: www.red-robin.de