

Herausragende Portfolios kombinieren

10.05.2011, 16:43 | Handel, Wirtschaft, Finanzen, Banken & Versicherungen

Pressemitteilung von: *chili assets.de*



Strategiekombination

Strategische Allokation: Carmignac Patrimoine A und 'Aktienverwaltung long/short'

Durchstöbert man deutschsprachige Finanzmagazine stößt man auf einen Fundus interessanter Anlagemöglichkeiten. Die Kontakte der Journalisten zu renommierten Fondshäusern aber auch zu kleineren noch aufstrebenden Anbietern bereichern Interessenten auf der Suche nach geeigneten Investments. Im Fokus stehen Anlagen, die Investoren ein qualitativ hochwertiges Investment bieten und sehr exakt recherchiert sind. Zu erkennen ist allerdings, dass die Themenwahl überwiegend auf langfristig orientierte Investmentstile ausgerichtet ist. Unsere Untersuchungen zeigen jedoch, dass lang- und kurzfristige Handelsstile geschickt miteinander kombiniert oft die besten Ergebnisse bieten.

Im Mittelpunkt medialer Aufmerksamkeit steht zur Zeit der Mischfonds Carmignac Patrimoine A (WKN A0DPW0). Er überzeugt mit einer konstant guten Leistung, die zu Recht mit etlichen Auszeichnungen honoriert wurde. Das Management hat seine Qualität beim Aufstöbern von langfristigen Trends der globalen Finanzmärkte unter Beweis gestellt. Ein taktisches Overlay sorgt für die Absicherung vor größeren Kurseinbrüchen und damit für ein ausgezeichnetes Risikomanagement. Trotz des mittlerweile enorm angewachsenen Fondsvolumens fühlen sich Investoren bisher in sämtlichen Marktphasen sicher – nicht nur wenn die Börsensonne scheint, sondern auch in Marktphasen, in denen die Voraussetzung für den Anlageerfolg für benchmark-nahe Anlagestrategien nicht gegeben sind.

Eine herausragende Leistung mit erstklassigem Risikomanagement zeigt in unserer Datenbank für Managed Accounts die `Aktienverwaltung long/short` des Düsseldorfer Anbieters PP-Brokerage. Mit der richtigen Titelauswahl und dem richtigen Timing gelingt es Trading Advisor Marc Wilhelms nicht nur, die Volatilität gegenüber einem indexnahen Investment niedrig zu halten, sondern seit Handelsbeginn auch permanent besser abzuschneiden als diese. Branchenprobleme bedingt durch die Finanzkrise, den Flash-Crash oder die Katastrophe in Japan wurden frühzeitig erkannt, so dass PP-Brokerage Investoren nicht von Gewinneinbußen betroffen waren. Im Gegensatz zu Carmignac ist die Haltedauer der Zielpositionen allerdings teilweise deutlich kurzfristiger. Diese kann bei der `Aktienverwaltung long/short` zwar durchaus mehrere Monate betragen, allerdings liegt auch eine Haltedauer von wenigen Stunden vollkommen im Rahmen der Anlagestrategie.

Kombiniert man die langfristige Orientierung von Carmignac und die kurzfristige Ausrichtung des PP-Brokerage Portfolios zeigt sich ein sehr interessantes Bild. Aufgrund der spekulativen Grundhaltung von PP-Brokerage wurde die `Aktienverwaltung long/short` lediglich in einer geringen prozentualen Größenordnung mit dem Carmignac Patrimoine vermischt. Trotzdem zeigt sich eine Verbesserung der Performance- und Risikokennziffern in Bereichen, die Anleger sehr stark zu schätzen wissen dürften. Die Mischung von 85% Carmignac Patrimoine und 15% `Aktienverwaltung long/short` zeigt eine deutliche Verkürzung der Kennziffer „längste Verlustphase“ die bei Carmignac auf Monatsbasis 11 und bei der `Aktienverwaltung long/short` 8 Monate beträgt. In der Kombination beider Anlagen reduziert sich die längste Verlustphase auf 5 Monate und auch der maximale Drawdown geht auf nur -3,41% zurück. Im Gegenzug konnte diese Konstellation der Anlagen im Vergleich zur Einzelbetrachtung von Carmignac auch einigen Mehrwert in Sachen Performance erbringen. So steigt der durchschnittliche Jahresertrag im betrachteten Zeitraum um +2,04% an.

Fazit: Eine Mischung von zwei hochwertigen Anlagestrategien, eine mit langfristiger Orientierung, die andere spezialisiert auf schnelle Wechsel zwischen Long- und Shortpositionen, kann Investoren gleich mehrere Vorteile verschaffen: Eine Verkürzung der Verlustphasen einerseits und langfristig betrachtet dürfte sich der Zinseszinsseffekt mit der verbesserten Jahresperformance deutlich bemerkbar machen. Diversifikationseffekte erfolgen in diesem Fall also nicht über ein erweitertes Anlagespektrum in Form von Ländern, Branchen oder Themen, sondern über die geschickte Kombination von kurz- und langfristigen Handelsansätzen.

Portrait

chili-assets.de

chili-assets.de ist eine Vergleichsplattform für Managed Accounts. Institutionelle-, private Investoren und Medienteilnehmer haben auf dieser Internetseite die Möglichkeit die Leistungsfähigkeit verschiedenster Managed Accounts miteinander zu vergleichen. Die von Capitalteam Consulting recherchierten und geprüften Performance- und Risikokennziffern erleichtern Interessenten die Auswahl der passenden Anbieter. Weitere Informationen finden Sie unter www.chili-assets.de.

Hinweis zu Managed Accounts

Managed Accounts favorisieren zumeist chanceorientierte Anlagestile, die nicht in jeder beliebigen prozentualen Größenordnung für die Wertpapierdepots der Investoren geeignet sind. Die richtigen Handelsstrategien in der richtigen Dosierung allerdings können herkömmlichen Wertpapierdepots die richtige Würze verleihen und maßgeblich zu einem besseren Chance-Risiko-Verhältnis beitragen.

News-ID: 536289 • Views: 652 (Stand: 30.09.2026)

Link zur Pressemitteilung:

<https://www.openpr.de/news/536289/Herausragende-Portfolios-kombinieren.html>