

Sie befinden sich hier: [Home](#) > [News](#) > Übersicht

NEWS

Übersicht

Köpfe

Märkte

Suche

Username:

Passwort:

[Passwort vergessen?](#)

[Noch nicht registriert?](#)

NEWSLETTER

Zweimal pro Woche die aktuellsten Infos in Ihrer Mailbox!

[Jetzt Anmelden](#)



UMFRAGE

Der Euro ist

- eine Weichwährung
- eine Hartwährung
- eine Währung für ein Kerneuropa, nicht für die Südfanke
- ein Konstrukt, das es in einigen Jahren nicht mehr gibt

02.02.2011

Robert Beers Absolute Return Plus UI Fonds feiert seinen dritten Geburtstag



Niemand sollte sich wundern, wenn der vom Oberpfälzer Optionsspezialisten Robert Beer (Bild) gemanagte Absolute Return Plus UI Fonds (ISIN: DE000A0A0M80V3) in den nächsten Wochen und Monaten verstärkt auf so manchem institutionellen Radarschirm auftaucht. Am 28.01.2011 konnte der mittlerweile 376 Millionen Euro schwere Fonds, der zu 80 Prozent aus Geldmarktanlagen und zu 20 Prozent aus Spreadstrategien besteht, die über Optionen auf den EuroStoxx 50 abgebildet werden, den so wichtigen 36-Monats-Return vorlegen.

Damit hat der - nun nicht mehr ganz so junge - Absolute Return Fonds den Elchtest eindrucksvoll bestanden. Die letzten drei Jahre entsprachen nämlich einem verdichteten Zyklus, wo auf den Absturz 2008 ab März 2009 die Wiederauferstehung an den Aktienmärkten Platz griff und 2010 dann in einen Seitwärtskanal überging. [INSTITUTIONAL MONEY berichtete bereits in Heft 2/2009 über den Ansatz.](#)

Die Performance kann sich wirklich sehen lassen, konnte der Fonds doch per Ende Januar 2011 über drei Jahre kumuliert eine Performance von 25,02 Prozent aufweisen, was einem annualisierten Wert von 7,72 Prozent (Bloomberg-Daten) entspricht. Alle Kalenderjahre schlossen im Plus, Draw Downs von an die zehn Prozent muss man als Investor strategiebedingt allerdings aushalten können. Die Volatilität des Fonds liegt bei 7,78 Prozent p.a.

Allen Zuordnungsfragen des Gefäßes zum Trotz gilt: Da der Ansatz skalierbar ist und im Gegensatz zu vielen Konkurrenzprodukten auf der Höhe des Ehrgeizes war, ist eine weitere Volumenssteigerung des de facto rein institutionellen Fonds wohl vorprogrammiert. (kb)

Kategorie: Märkte

Quelle: Institutional Money

News | Übersicht

- 17.02.2011 [Paul Krugman: "Öffentliche Stimuli hat es in den USA nie gegeben"](#)
- 17.02.2011 [Jens Weidmann wird Präsident der Bundesbank](#)
- 17.02.2011 [Staatsgarantierte Bankschuldverschreibungen vom Aussterben bedroht](#)
- 17.02.2011 [Sarasin-Chefökonom: Wann findet die Finanzkrise ihr endgültiges Ende?](#)
- 17.02.2011 [Tim Gibson wird bei Henderson neuer Head of Property Equities, Asia](#)
- 17.02.2011 [Fidelity: Afrika südlich der Sahara bietet Potenzial](#)
- 17.02.2011 [Invesco ist für China optimistisch](#)
- 17.02.2011 [Nordea: Kaufkraft in den Emerging Markets nimmt weiter zu](#)
- 16.02.2011 [Lombard Odier fordert die Rentenmärkte mit fundamentalem Gewichtungansatz heraus](#)
- 16.02.2011 [Feri Institutional Advisors: Paradigmenwechsel bei institutionellen Investoren](#)

[1](#) [2](#) [3](#) [4](#) [5](#) [vor >](#)