



PRESSEMITTEILUNG

Falcon Vermögensverwaltung und Universal-Investment starten marktneutralen Derivate-Arbitrage-Fonds

- Falcon Stabilität nutzt Fehlpreisungen und Preisineffizienzen im Derivatemarkt
- Absolute-Return-Ansatz mit Zielrendite von mindestens vier Prozent p.a. nach Kosten
- Stabiler Portfoliobaustein im Niedrigzinsumfeld auch für konservative Anleger
- Stabile Erträge ermöglichen attraktive Ausschüttungspolitik

Frankfurt am Main / Hamburg, 9. April 2019. Die auf die Entwicklung von alternativen Investmentprodukten spezialisierte Frankfurter Falcon Vermögensverwaltung AG und Universal-Investment haben den Mischfonds [Falcon Stabilität](#) (ISIN DE000A2JQKW4 / DE000A2JQKV6) lanciert und können privaten wie institutionellen Anlegern damit einen stabilen Portfoliobaustein im aktuellen Niedrigzinsumfeld bieten. Der in Deutschland und der Schweiz zum Vertrieb zugelassene Fonds verfolgt eine Derivate-Arbitragestrategie, deren Anlageziel darin besteht, durch Ausnutzung von Preisdifferenzen verschiedener Finanzderivate in allen Marktphasen Arbitrage-Gewinne zu vereinnahmen. Die Anlagestrategie ist vollkommen unkorreliert zu anderen Anlageklassen. Der Falcon Stabilität strebt eine jährliche Zielrendite von mindestens vier Prozent nach Kosten an, die Zielvolatilität liegt bei maximal fünf Prozent. Eine jährliche Ertragsausschüttung ist geplant.

Flankiert wird die Strategie durch einen speziell entwickelten Algorithmus, der alleine in Deutschland kontinuierlich die Preisbewegungen von mehr als 1,4 Mio. derivativen Finanzprodukten scannt. Dabei werden Produkte identifiziert, deren Merkmale wie Basiswert, Bezugsverhältnis und Fälligkeit identisch sind, deren Kurse jedoch aufgrund von Fehlpreisungen oder Marktineffizienzen voneinander abweichen. Durch den simultanen An- und Verkauf (long-/short-Position) kann diese Preisdifferenz vereinnahmt werden. In der Regel wird nur in sogenannte Kurzläufer mit einer Laufzeit von maximal drei Monaten investiert.

„Mittels unseres proprietären Algorithmus finden wir fortwährend attraktive Arbitrage-Möglichkeiten, die in volatilen Marktphasen tendenziell steigen“, so Fondsmanager Roger Krüger, Vorstand der Falcon Vermögensverwaltung AG. „Die endgültige Handelsentscheidung trifft aber immer unser erfahrenes Portfoliomanagement-Team. Aufgrund der erwarteten niedrigen Korrelationen zum Aktien- und Rentenmarkt bei stabilen Renditen kann der Falcon Stabilität eine sinnvolle Portfoliobeimischung im aktuellen Niedrigzinsumfeld darstellen, in dem die zunehmende Korrelation von Aktien und Anleihen ein Problem für die Diversifikation des Vermögensportfolios darstellt. Mit dem Fonds können Anleger auf dieses Marktrisiko reagieren und ihr Portfolio um einen Stabilitätsfaktor ergänzen. Unsere oberste Maxime ist immer der langfristige Werterhalt.“

Die Positionen werden möglichst so zusammengestellt, dass eine Änderung des Basiswertkurses keine unmittelbare Änderung des Portfoliowerte nach sich zieht, das so genannte Delta-Hedging. In

Börsenphasen, in denen keine attraktiven Arbitragemöglichkeiten identifiziert werden, können bis zu 100 Prozent des Sondervermögens in liquiden Finanzinstrumenten gehalten werden.

„Unsere Derivate-Arbitrage-Strategie setzen wir in der Falcon Vermögensverwaltung AG seit 2015 mit großem Erfolg um“, so Krüger. „Mit der Umsetzung in einem OGAW-Fonds möchten wir unsere Strategie einem breiteren Anlegerkreis zugänglich machen.“

Vertriebspartner der Falcon Vermögensverwaltung GmbH ist die VILICO Investment Service GmbH in Hamburg.

* * *

Die Daten zum FALCON Stabilität auf einen Blick

Fondsname	Falcon Stabilität	
Fondspartner	Falcon Vermögensverwaltung AG, Frankfurt am Main	
Kapitalverwaltungsgesellschaft	Universal-Investment Gesellschaft mbH, Frankfurt am Main	
Verwahrstelle	Joh. Berenberg, Gossler & Co. KG, Hamburg	
Fondskategorie	Mischfonds flexibel	
Fondswährung	Euro (EUR)	
Anteilklassen	I (Institutionell)	R (Retail)
WKN / ISIN	A2JQKV / DE000A2JQKV6	A2JQKW / DE000A2JQKW4
Ertragsverwendung	Ausschüttend	
Laufende Kosten (Schätzung)	2,1 % jährlich	2,5 % jährlich
Mindestanlage	EUR 100.000	Keine
Ausgabeaufschlag	bis zu 5 %	
Rücknahmegebühr	Keine	
Erfolgsabhängige Vergütung	20 % High Watermark	

ÜBER FALCON VERMÖGENSVERWALTUNG

Die FALCON Vermögensverwaltung AG mit Sitz in Frankfurt am Main wurde als mittelständisches inhabergeführtes Unternehmen gegründet und ist heute Teil der FALCON INVESTMENT GRUPPE. Kerngeschäft der FALCON Vermögensverwaltung AG ist die Betreuung von anspruchsvollen Privatkunden, Family Offices sowie institutionellen Anlegern. Eine besondere Expertise besteht in der Entwicklung alternativer Investmentstrategien mit Fokus auf derivative Anlagestrategien. Vorstand der FALCON Vermögensverwaltung AG ist Roger Krüger, der über mehr als 25 Jahre Berufserfahrung bei Schweizer und Deutschen Banken verfügt. Dort war er schwerpunktmäßig in leitenden Funktionen im Bereich Equity FX Derivate tätig. Weitere Informationen unter: www.falconinvestment.de

ÜBER UNIVERSAL-INVESTMENT

Universal-Investment ist mit rund 432 Milliarden Euro verwaltetem Vermögen, davon 354 Milliarden Euro in eigenen Vehikeln sowie etwa 78 Milliarden Euro in Zusatzservices wie Insourcing, weit über 1.300 Publikums- und Spezialfondsmandaten und rund 650 Mitarbeitern die größte unabhängige Investmentgesellschaft im deutschsprachigen Raum. Die Investmentgesellschaft ist die zentrale Plattform für unabhängiges Asset Management und vereint das Investment-Know-how von Vermögensverwaltern, Privatbanken, Asset Managern und Investmentboutiquen. Mit der Anfang 2019 durchgeführten Akquisition von UI labs ergänzt zudem der branchenführende IT-Datenspezialist das Service-Portfolio um Front-Office- und Datenlösungen. Die 1968 gegründete Universal-Investment-Gruppe mit Sitz in Frankfurt am Main sowie Töchtern, Niederlassungen, und Beteiligungen in Luxemburg, Polen und Österreich gehört zu den Pionieren in der Investmentbranche und ist heute Marktführer in den Bereichen Master-KVG und Private-Label-Fonds. Laut dem aktuellen PwC 2018 ManCo Survey ist Universal-Investment die größte AIFM-ManCo in Luxemburg; bei den Third-Party-ManCos rangiert Universal-Investment ebenfalls auf Platz 1. (Stand: 28. Februar 2019).

Mehr Informationen unter: www.universal-investment.com

Ihre Ansprechpartner für Presseanfragen

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Bernd Obergfell
Head of Communications
T: +49 69 71043-575
M: +49 151 5381 6803
bernd.obergfell@universal-investment.com

FALCON Vermögensverwaltung AG
Bereich Presse
T: +49 69 260 1424 0
info@falconinvestment.de

Vertriebspartner

VILICO Investment Service GmbH
Stefan Bülling
Geschäftsführer
T: +49 40 822 205 11
info@vilicoinvest.de