Fondskonzept im Überblick

Abaki Fixed Income Convexity

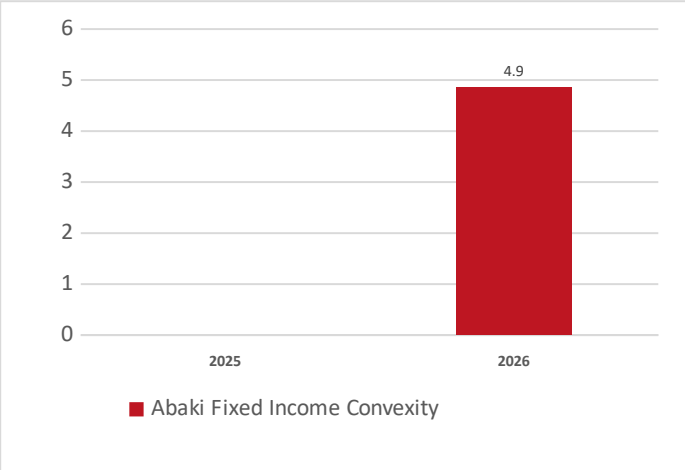
Vereinnahmung von Zinskonvexitätsprämien bei Anleihen hoher Laufzeit

marktneutral

Beschreibung Fondsstory

Die Strategie basiert auf dem "Ernten" der Konvexitätsprämie ultra-langer EUR-Anleihen (NRW, Österreich), den sogenannten "100-jährigen" Bonds. Derivate werden zur Absicherung des Zinsrisikos und zur Erzielung von Marktneutralität (Duration 0) eingesetzt. Die Abaki Strategie nutzt die mathematische Eigenschaft, dass Anleihen mit hoher Konvexität eine asymmetrische Reaktion bei fallenden und steigenden Renditen aufweisen und somit unabhängig von der Richtung der Renditebewegung ein positiver Erwartungswert für das Portfolio möglich ist. Dabei profitiert die Strategie von hoher bzw. steigender Zinsvolatilität, ist eine ideale Ergänzung für Renten-Portfolien und verringert im Portfoliokontext aufgrund der Marktneutralität das Risiko.

Wertentwicklung (in %)*



Historische Kennzahlen (in %)*

Performance	1 Jahr	3 Jahre p.a.	5 Jahre p.a.
Fonds	9.5	-	-

Quelle: Morningstar, *Anteilklasse Abaki Fixed Income Convexity

Weitere Informationen

Fondsmanager

ICM InvestmentBank AG



Marc Preuß



Michael Adam



Michael Klawitter

Anlegerversprechen

Marktneutrale Erzielung einer Rendite von 8–10 % p.a. bei Volatilität von ca. 8 %

Besonderheiten

- Prognosefreies, marktneutrales Portfolio dank Zins- und Kredit-Hedges
- Fokus auf ultra-langlaufende Anleihen mit hoher Konvexität
- Profitiert überproportional von steigender Zinsvolatilität
- Zielrendite von 8 - 10 % p.a. bei ca. 8 % Volatilität
- Ideal zur Diversifikation klassischer Anleihenportfolios

Eckdaten

ISIN	**DE000A40RCU9 / DE000A40RCV7**
Mindestanlage	€ 0 / € 500.000
Fondsvolumen	28 Mio. €
SFDR	Artikel 6
SRI	4

Quelle: Morningstar

Nur für professionelle Marktteilnehmer