

Neue Quant-Strategie bringt Erfolg zurück

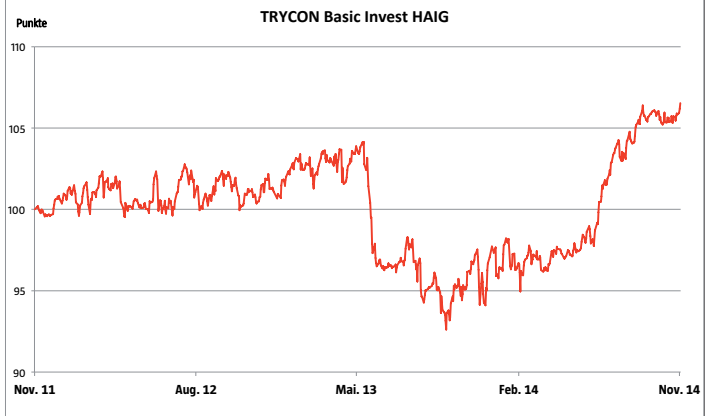
Beim TRYCON Basic Invest HAIG haben die Manager erfolgreich die Weichen für die Zukunft gestellt. Nach über zehnjähriger Entwicklungsphase nutzt der Fonds erfolgreich seit 13 Monaten eine Quant-Strategie auf Basis künstlicher Intelligenz

Die Frankfurter Absolute-Return-Spezialisten von Tungsten managen inzwischen in sechs Fonds über 260 Millionen Euro. Darunter den zuletzt sehr erfolgreichen TRYCON Basic Invest HAIG. Er hat sich nach einer Strategieumstellung vor gut einem Jahr zu einem Erfolgsfonds gemausert. Maßgeblicher Faktor dabei ist eine neue Quant-Strategie auf Basis künstlicher Intelligenz. Pablo Hess, einer der Portfoliomanager des Fonds, erklärt den Hintergrund: „QuantMatrix wurde als rein alphetriebene Renditequelle konzipiert und soll in unterschiedlichen Marktumfeldern und Volatilitätszyklen funktionieren. Gleichzeitig wollen wir die Abhängigkeit von nachhaltigen Trends vermeiden, die viele unserer Mitbewerber kennzeichnet.“ QuantMatrix liefert ihm kurzfristige Vorhersagen für rund 25 Finanzmärkte wie Aktienindizes, Anleihen, Zinsen und Währungen. Dabei werden ungleich mehr Zusammenhänge und Einflussfaktoren berücksichtigt als bei einfacheren Modellen wie zum Beispiel der Trendfolge. „Die Strategie arbeitet deutlich dynamischer und kann sich viel flexibler auf Marktveränderungen einstellen und, wenn nötig, Positionen auch mal innerhalb von 24 Stunden komplett umstellen“, sagt Hess. Bislang funktionierte das Modell muster-gültig, der Fonds hat im laufenden Jahr um knapp zehn Prozent zugelegt. Selbst im Oktober büßte er nur 0,26 Prozent ein. Hinzu kommt eine Korrelation von null zu den weltweiten Aktienmärkten – die Korrelation zu den klassischen CTAs liegt auch nur bei 0,41. Und der Gleichlauf mit Staatsanleihen beträgt lediglich 0,55. Er eignet sich also sehr gut zur Portfoliodiversifikation. *Die neue Strategie scheint sehr gut zu funktionieren. Sie verhält sich bislang in allen Marktphasen sehr robust. Daher dürfte der Fonds in Zukunft auf erhöhtes Anlegerinteresse stoßen.* jk

Daten: TRYCON Basic Invest HAIG

ISIN/WKN	LU 045 195 830 9/HAF X29
Auflegung	1. Februar 2010
Agio	bis zu 3,0 %
Laufende Gebühr p. a. (laut KIID)	1,80 %
Erfolgshonorar	20 % (High Watermark)
Infos	www.tungstencapital.de

TRYCON Basic Invest: Neue Strategie bringt Erfolg



Im September 2013 hat Tungsten die Strategie des Basic Invest umgestellt. Seitdem läuft der Fonds überzeugend. Die neue quantitative Strategie des Fonds hat seither zu Gewinnen von über zehn Prozent geführt. Gleichzeitig war die Volatilität sehr überschaubar. So kann es weitergehen.

Absolute Return Aktien: Aktuelle Kurse

Fondsname	ISIN	Kurs 13.11.14	Vorw.	Wertzuwachs seit 01.01.14	01.01.13
DNB ECO Absolute Return A €	LU0547714286	119,71	0,8	15,9	1,0
ACMBernstein Sel. Abs. Alpha	LU0736558973	17,68	0,9	12,3	25,0
Nordea Stable Equity Long/Sh	LU0826409327	112,23	0,5	9,4	19,5
JPM Highbr Stat Mkt Neutr.	LU0273792142	108,18	-0,9	6,8	1,3
Absolute Ins EQ Market Neutral	IE00B1HL8S66	1,21	0,0	6,4	7,7
Amundi Abs. Vola. World Eq.	LU0319687124	115,95	0,5	5,7	-11,4
GAM Star Global Selector € acc	IE00B5BQZT57	15,64	0,0	5,5	14,8
LOYS Global L/S I	LU0720542298	64,93	0,3	5,3	22,0
Lupus alpha Str Emg Markets	DE000A0YFF46	94,22	-0,1	5,3	-3,1
LOYS Global L/S P	LU0720541993	63,56	0,3	4,6	20,4
CCI Healthcare Long-Short	LU0475778535	137,91	-0,1	4,0	30,5
Vermögensrefugium	DE000A1CXU08	98,09	0,0	4,0	1,2
Marshall Wace TOPS MN € C	LU0333227550	119,81	-1,3	3,1	10,7
Lupus alpha All Opport. B	LU0329425713	88,23	0,6	2,8	23,6
Lupus alpha Return R	DE000A0MS734	50,16	0,1	2,4	6,5
HenGa UK Absolute Ret. €-hdg	LU0490786174	6,37	0,2	2,2	18,6
RWC US Absolute Alpha A €	LU0453474784	123,72	1,7	2,0	15,3
Universal Stars Fund	LI0028060916	86,24	1,0	2,0	5,0
Parvest Flexible Assets (EUR) C	LU0192444668	111,11	0,1	1,8	2,6
Allianz Disc. Europe Strategy A	LU0384022694	114,52	-0,9	1,7	5,5
Salus Alpha RN Special Sit. (VT)	AT0000A0GZ08	127,47	0,1	1,7	9,7
Berenberg DyMacs Eq Mrkt N	DE000A0YKMS7	104,26	0,3	1,5	1,4
ACMBernstein Sel. Abs. Alpha	LU0736559278	17,97	0,3	1,4	20,1
J. Baer Abs Ret Europe Eq € B	LU0529497694	116,77	-0,4	1,4	5,7
BILKU 1 EPOS Fonds TL	LU0348700047	109,39	-0,2	1,0	5,6
Warburg Global Konz. Stabil.	DE000A0HGL71	62,10	1,4	0,9	20,8
Athena UI	DE000A0Q2SF3	106,60	-0,2	0,8	-0,6
DNCA Invest Miura A	LU0512124362	116,62	0,4	0,7	7,9
Schroder GAIA Egerton Eur. €	LU0463469048	150,92	-0,1	0,7	23,4
CS One (L) Sm&MC Alpha L/S B	LU0525285697	127,38	0,0	0,4	16,9
Danske Eur Long-Short Dy	LU0861185303	10,37	-0,1	0,4	4,1
Candriam Index Arbitrage C	FR0010016477	1360,17	0,1	0,1	1,5
Swiss Alpha Strategy Europe	LU0457851060	1072,45	1,2	-0,2	-2,5
BSF European Abs. Ret. A2	LU0411704413	123,96	-0,2	-0,3	3,3
ACMBernstein Europ Flex Eq	LU0590155247	16,83	0,1	-0,4	8,7
Lupus alpha Structure Invest	DE0006329055	149,14	-1,4	-0,4	7,7

Pflichtblatt für Ihr Geld.

Analysen | Kommentare | Tipps



Morgen im Handel!

Mehr Geld für Anleger

Die DAX-Konzerne schütten im kommenden Jahr rund 30 Milliarden Euro Dividende aus - so viel wie noch nie. Wie Aktionäre profitieren

Immer samstags neu!

Im Handel für 3,90 €