



## P R E S S E M I T T E I L U N G

### 5 Jahre OptoFlex: Zwischenbilanz einer Erfolgsgeschichte

- **Innovative Optionsprämienstrategie hat sich bewährt**
- **25 Prozent Performance seit Auflage, über 4,7 Prozent p. a.**
- **Systematischer Investitionsansatz mit Fokus auf Risikoabsicherung**

**Bad Homburg, 12. Dezember 2017** - Der FERI OptoFlex feiert mit dem heutigen Tag sein fünfjähriges Jubiläum und hat sich damit am Markt für risikoarme Anlagekonzepte fest etabliert. Seit Auflage erreichte die institutionelle Anteilsklasse des Fonds bei sehr geringer Volatilität eine Gesamtpformance von über 25 Prozent, das Fondsvolumen liegt bei über 900 Millionen Euro. Der OptoFlex bietet speziell institutionellen Investoren eine sehr attraktive Anlagealternative zu Renten. Das Konzept einer stark risikoreduzierten Optionsprämienstrategie setzt neue Maßstäbe im Bereich der alternativen Investments für professionelle Anleger. „Die eigentliche Innovation liegt darin, dass wir typische Fehler vermeiden, die im Management von Optionsstrategien gemacht werden. Wir legen unseren Fokus auf die Reduzierung des Downside-Risikos“, erklärt Daniel Lucke, Portfolio Manager bei FERI. Der Manager verantwortet den Fonds gemeinsam mit Steffen Christmann. „Wir sind der Grundeinsicht gefolgt, dass es in hocheffizienten Märkten, wie etwa dem US-Aktienmarkt, heute kaum mehr möglich ist, einen entscheidenden Informationsvorsprung zu erzielen. Deshalb verfolgen wir konsequent einen prognosefreien Ansatz, bei dem der Fokus auf Sicherheit und Transparenz liegt“, ergänzt Christmann.

Der OptoFlex ist ein täglich liquider Fonds im UCITS V Mantel. Die Investmentstrategie beruht darauf, Puts auf den S&P 500 Index zu verkaufen und einen Teil der vereinnahmten Prämie in eine Absicherungsstrategie, bestehend aus Derivaten auf den US-Aktien- und Volatilitätsmarkt, zu investieren. Der Rest der vereinnahmten Versicherungsprämie verbleibt dem Investor als Ertrag. Das Basisportfolio des Fonds besteht aus EUR-denominierten und variabel verzinslichen Anleihen mit hohem Investment-Grade-Rating und Geldmarktinstrumenten.

Die Aussichten sind gut, dass der OptoFlex seine Erfolgsgeschichte fortsetzt. Die von FERI entwickelte innovative Optionsprämienstrategie ist sehr beliebt und es gibt bis heute kaum einen vergleichbaren Investmentansatz am Markt. „Das Konzept bietet unverändert viel Potenzial. Es besteht weiterhin ein mittelfristig positiver Erwartungswert der Volatilitätsprämie, die wir vereinnahmen. Deshalb halten wir an unserer Strategie unverändert fest“, sagt OptoFlex Manager Lucke.



## Über die FERI Gruppe

Die FERI Gruppe mit Hauptsitz in Bad Homburg wurde 1987 gegründet und hat sich zu einem der führenden Investmenthäuser im deutschsprachigen Raum entwickelt. Für institutionelle Investoren, Familienvermögen und Stiftungen bietet FERI maßgeschneiderte Lösungen in den Geschäftsfeldern:

- **Investment Research:** Volkswirtschaftliche Prognosen & Asset Allocation-Analysen
- **Investment Management:** Institutionelles Asset Management & Private Vermögensverwaltung
- **Investment Consulting:** Beratung von institutionellen Investoren & Family Office Dienstleistungen

Das 2016 gegründete **FERI Cognitive Finance Institute** agiert innerhalb der FERI Gruppe als strategisches Forschungszentrum und kreative Denkfabrik, mit klarem Fokus auf innovative Analysen und Methodenentwicklung für langfristige Aspekte von Wirtschafts- und Kapitalmarktforschung.

Derzeit betreut FERI zusammen mit MLP ein Vermögen von 32,7 Mrd. Euro, darunter über 3 Mrd. Euro Alternative Investments. Die FERI Gruppe unterhält neben dem Hauptsitz in Bad Homburg weitere Büros in Düsseldorf, München, Luxemburg, Zürich und Wien.

Pressekontakt:

FERI AG

Katja Liese

Tel.: 06172 / 916-3192

presse@FERI.de