



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

Performance durch Risikoprämien: Renten-Alternative für institutionelle Investoren

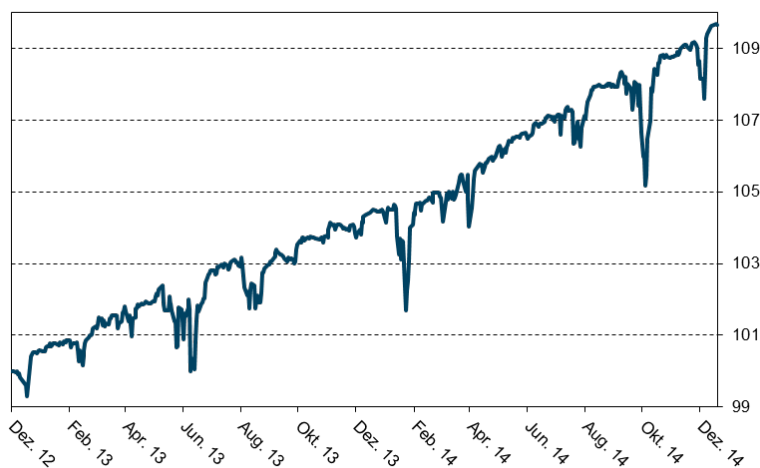
- **OptoFlex von FERI setzt börsengehandelte Optionen ein**
- **Rendite bei 4,96 Prozent p. a. – 100 Millionen Euro eingesammelt**
- **Alternative Ertragsquelle für institutionelle Investoren**

Bad Homburg, 9. Februar 2015 – Das Anlageumfeld für institutionelle Investoren ist in Zeiten expansiver Geldpolitik, niedriger Zinsen und enger Regularien durch den Gesetzgeber eine große Herausforderung. Seit zwei Jahren bietet FERI als alternative Ertragsquelle und gleichermaßen Risikoabsicherung für institutionelle Portfolios das Konzept OptoFlex, einen täglich liquiden Fonds im UCITS IV Mantel. Die Performance liegt bei 4,96 Prozent p. a., bis heute konnte FERI bereits 100 Millionen Euro für den Fonds einsammeln.

Der OptoFlex (ISIN LU0834815101) arbeitet mit einer Strategie, bei der Puts auf Aktienindizes wie den S&P 500 verkauft und ein Teil der Prämie in die Absicherung von Extremrisiken investiert werden. Der Rest bleibt dem Investor als Ertrag erhalten. „Zwischen Angebot und Nachfrage nach Put-Optionen ist ein signifikantes Ungleichgewicht erkennbar. Derartige Optionen werden hauptsächlich von wenig preissensitiven Marktteilnehmern als Crash-Versicherung gekauft. Dadurch sind diese Puts systematisch deutlich teurer als ihr fundamentalgerechtfertigter Wert“, erläutert Carsten Hermann, Managing Partner bei der FERI Trust GmbH, die Idee. Die Vereinnahmung dieser Risikoprämie führe mittelfristig zu einer attraktiven Performance. Bei besonders starken Aktienmarkteinbrüchen kommt beim OptoFlex eine zusätzliche Absicherung zum Schutz vor großen Verlusten zum Einsatz. Diese wird durch einen Teil der vereinnahmten Risikoprämien finanziert.

„Somit ermöglichen wir institutionellen Investoren eine Alternative zu Renten, die zudem größtenteils unabhängig von den Entwicklungen an den Kapitalmärkten ist“, sagt Hermann.

OptoFlex



Kennzahlen	OptoFlex
Rendite p.a.	4,96%
Volatilität p.a.	2,37%
Sharpe Ratio	2,00
Sortino Ratio	4,40
Min. Monatsrendite	-0,90%
Min. Quartalsrendite	0,03%
Min. Jahresrendite	3,52%
Positive Monate	76,00%

Über die FERI Gruppe

Die FERI Gruppe mit Hauptsitz in Bad Homburg wurde in den achtziger Jahren gegründet und hat sich zum führenden bankenunabhängigen Berater/Asset Manager von Familienvermögen, Stiftungen und institutionellen Investoren im deutschsprachigen Raum entwickelt. Auf Basis eines eigenständigen, international anerkannten Researchs entwickelt FERI für ihre Mandanten umfassende, innovative und individuelle Anlagekonzepte. Darüber hinaus gehört zur FERI Gruppe mit der FERI EuroRating Services AG eine der führenden europäischen Ratingagenturen für die Analyse und Bewertung von Anlagemärkten und Anlageprodukten sowie eines der größten Wirtschaftsforschungs- und Prognose-Institute. Derzeit betreut das Unternehmen zusammen mit MLP über 26 Mrd. Euro Assets unter Verwaltung und Beratung, darunter ca. 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