

Warburg - Liquid Alternatives (ehemals Warburg - Defensiv - Fonds)

UCITS Hedge Awards 2025: Beste Performance in der Kategorie Short Volatility

the hedge fund journal

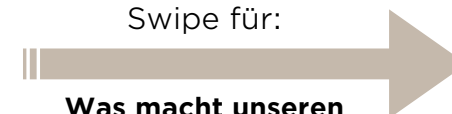
UCITS Hedge Awards 2025

Short Volatility (Quantitative)
Best Performing Fund in 2024
WARBURG - Liquid Alternatives

”

*Warburg Invest ist stolz,
wir sagen danke!*

Swipe für:



**Was macht unseren
Ansatz erfolgreich?**

Warburg - Liquid Alternatives (ehemals Warburg - Defensiv - Fonds)

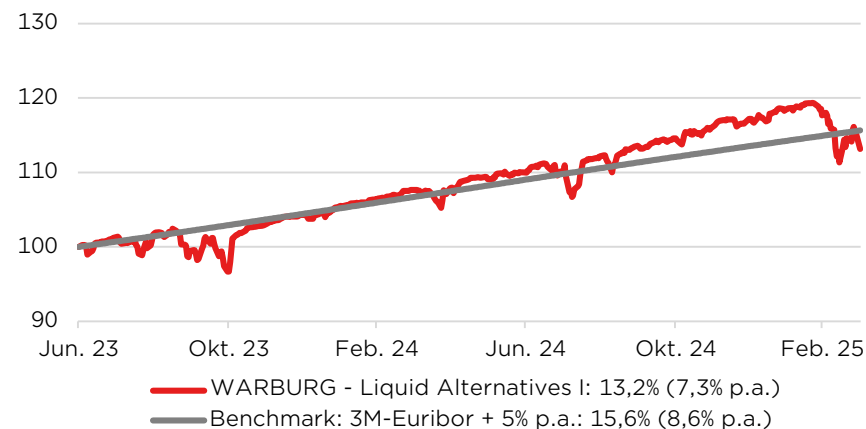
Unser Konzept: Vereinnahmung der Volatilitäts-Risikoprämie mit effizientem Risikomanagement

Investoren-Mehrwert



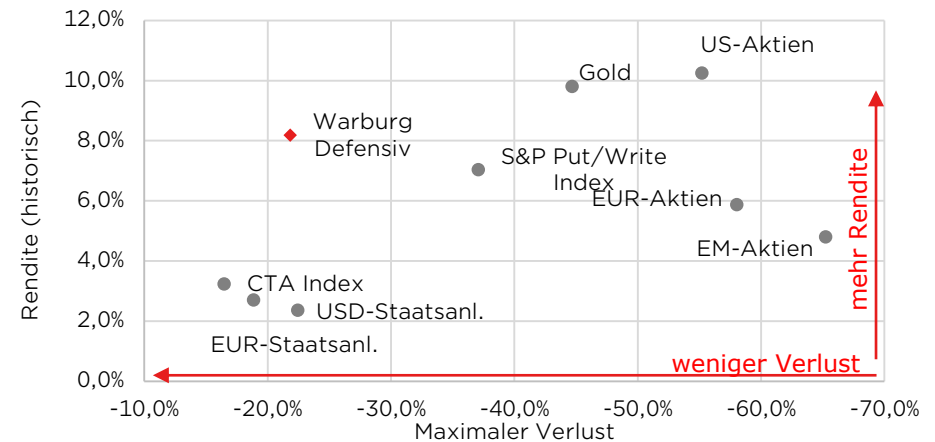
Attraktive Zielrendite in Höhe des 3-Monats-Euribor + 5% p.a.

Wertentwicklung seit Strategieumsetzung (Juni 2023)



Diversifikationseffekte auf Portfolioebene

Maximaler Verlust-Rendite-Verhältnis



USPs im Vergleich zu Wettbewerbern

1 Effizientes Risikomanagement auf mehreren Ebenen

2 Diversifikation der Strategie über verschiedene Laufzeiten und Basiswerte

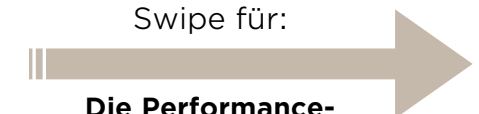
3 CTA-Strategien* als Makro-Hedge gegen nachteilige Marktphasen

Quelle: Warburg Invest; Zeitraum: 06/2023 - 03/2025; 01/2006 - 03/2025

*Trend-Folgestrategien auf eine Vielzahl von Anlageklassen

Vergangene Wertentwicklungen sind kein verlässlicher Indikator für künftige Ergebnisse.

Swipe für:

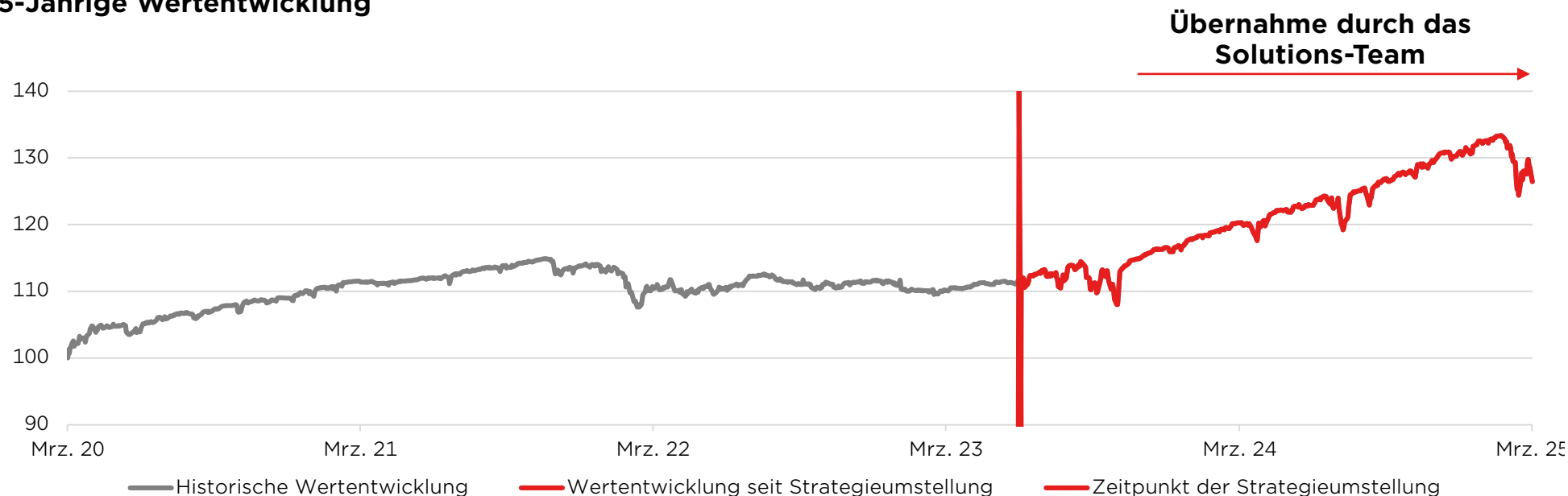


Die Performance-Übersicht

Warburg - Liquid Alternatives (ehemals Warburg - Defensiv - Fonds)

Systematische Performanceverbesserung seit Strategie- und Fondmanagementwechsel

5-Jährige Wertentwicklung



Performance-Attribution seit Strategie- und Fondmanagementwechsel

1

Historische Wertentwicklung

- Diskretionärer Ansatz zur Vereinnahmung der Volatilitäts-Risikoprämie
- Delta-Hedge als Risikomanagement-Tool

2

Wertentwicklung seit 06/2023

- Neues Management-Team mit neuer Strategie
- Effizientes, auf die Basiswerte abgestimmtes, Risikomanagement

Quelle: Warburg Invest; Zeitraum: 03/2020 - 03/2025
 Vergangene Wertentwicklungen sind kein verlässlicher Indikator für künftige Ergebnisse.

Swipe für: 

**Das Portfolio-
Management Team**

Warburg - Liquid Alternatives (ehemals Warburg - Defensiv - Fonds)

Langjährige Zusammenarbeit, breite Expertise und ein Teamansatz der sich auszahlt!



“ *Die Auszeichnung im ersten vollen Kalenderjahr nach der Fonds-übernahme und Strategieanpassung des WARBURG - Liquid Alternatives, macht mich und das gesamte Team stolz und zeigt, dass wir uns mit unserem systematischen Ansatz und einem effizienten Risikomanagement am Markt behaupten können.*

Sven Wünschmann, CQF (Lead Portfoliomanager)

Management Team (von links nach rechts)

Sven Wünschmann, CQF: Lead Portfolio Manager

Kristen Schlüter, CFA: Co-Portfolio Manager

Stefan Ewald, CFA: Co-Portfolio Manager



Warburg - Liquid Alternatives (ehemals Warburg - Defensiv - Fonds)


Chancen- und Risikohinweis

Chancen

- Positive Performance in positiven, seitwärts tendierenden und leicht konsolidierenden Märkten
- Langfristig attraktives Chance-Risiko-Verhältnis
- Positive Diversifikationseffekte für bestehende Kapitalanlagen

Risiken

- Keine explizite Wertsicherung bzw. Wertuntergrenze
- Für das Basisportfolio bestehen Emittenten-, Durations- und Spreadrisiken
- Starke Marktkorrekturen können zu Rückgängen im Fondspreis führen

Swipe für: 

Disclaimer

Disclaimer

Diese Ausarbeitung ist von Warburg Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH (Warburg Invest) erstellt worden. Sie ist nur an denjenigen als Empfänger gerichtet, dem die Ausarbeitung willentlich von Warburg Invest zur Verfügung gestellt wird. Wird diese Ausarbeitung einem Kunden zur Verfügung gestellt, ist dieser allein der Empfänger, auch wenn die Ausarbeitung einem Mitarbeiter oder Repräsentanten des Kunden übergeben wird. Der Empfänger ist nicht berechtigt, diese Ausarbeitung zu veröffentlichen oder Dritten zur Verfügung zu stellen oder Dritten zugänglich zu machen.

Diese Ausarbeitung stellt weder ein Angebot noch eine Aufforderung zur Abgabe eines Angebots dar, sondern dient allein der Orientierung und Darstellung von möglichen geschäftlichen Aktivitäten. Die in dieser Ausarbeitung enthaltenen Informationen erheben nicht den Anspruch auf Vollständigkeit und sind daher unverbindlich. Soweit in dieser Ausarbeitung Aussagen über Preise, Zinssätze oder sonstige Indikationen getroffen werden, beziehen sich diese ausschließlich auf den Zeitpunkt der Erstellung der Ausarbeitung und enthalten keine Aussage über die zukünftige Entwicklung, insbesondere nicht hinsichtlich zukünftiger Gewinne oder Verluste. Die Inhalte dieser Information entsprechen dem Stand zum Zeitpunkt der Erstellung. Sie können aufgrund künftiger Entwicklungen überholt sein, ohne dass dieses Dokument geändert wurde.

Ausführliche produktspezifische Informationen entnehmen Sie bitte dem aktuellen Verkaufsprospekt, der Basisinformation (PRIIP) sowie dem Jahres- und ggf. Halbjahresbericht. Diese Dokumente bilden die allein verbindliche Grundlage für den Kauf von Investmentanteilen. Sie sind kostenlos am Sitz der Kapitalverwaltungsgesellschaft (Warburg Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH, Ferdinandstraße 75 in 20095 Hamburg) sowie auf der Homepage www.warburg-fonds.com und der jeweiligen Verwahrstelle, die Sie dem Verkaufsprospekt entnehmen können, erhältlich.

Die steuerliche Behandlung hängt von den persönlichen Verhältnissen des Anlegers ab und kann künftig Änderungen unterworfen sein. Nähere steuerliche Informationen entnehmen Sie bitte dem Verkaufsprospekt. Personen, die Investmentanteile erwerben wollen, halten oder eine Verfügung im Hinblick auf Investmentanteile beabsichtigen, wird daher empfohlen, sich von einem Angehörigen der steuerberatenden Berufe über die individuellen steuerlichen Folgen des Erwerbs, des Haltens oder der Veräußerungen der in dieser Unterlage beschriebenen Investmentanteile beraten zu lassen.

Etwaige Wertentwicklungen wurden nach BVI-Methode, d.h. ohne Ausgabeaufschlag, berechnet. Individuelle Kosten wie beispielsweise Gebühren, Provisionen und andere Entgelte sind in der Darstellung nicht berücksichtigt und würden sich bei Berücksichtigung negativ auf die Wertentwicklung auswirken. Frühere Wertentwicklungen, Simulationen oder Prognosen stellen keinen Indikator für künftige Performance dar. Die künftige Wertentwicklung hängt von vielen Faktoren wie der Entwicklung der Kapitalmärkte, den Zinssätzen und der Inflationsrate ab und kann daher nicht vorhergesagt werden.

Für Schäden, die im Zusammenhang mit der Verwendung und/oder der Verteilung dieser Ausarbeitung entstehen oder entstanden sind, übernimmt Warburg Invest keine Haftung.