

## IMB Managed Futures Fund – Teilstrategie Long-Only

### Beschreibung

Dem Portfoliomanagement des IMB Managed Futures Fund liegt ein Handelssystem auf den Deutschen Aktienindex (DAX) mit quantitativem Modell zugrunde. Dazu werden Daten in Bezug auf den Index analysiert und Handelssignale (long, neutral oder short) generiert. Entsprechend Delegierte Verordnung (EU) Nr. 231/2013 ist die Anlagestrategie der Hedgefonds-Strategie "Managed Futures/CTA Quantitative" zuzuordnen. Es sind drei Teilstrategien (Long/Short; Long-Only; Short-Only) verfügbar, mit denen unterschiedliche Ziele verfolgt werden können.

Mit der Teilstrategie Long-Only wird durch das Risikomanagement während unsicherer Marktphasen das Exposure reduziert, um Verluste (Drawdown) möglichst zu vermeiden und eine schwankungsarme Wertentwicklung zu erzielen. Basierend auf dem Handelssystem wird das Fondsportfolio mit Future-Kontrakten long oder neutral auf den DAX ausgerichtet.

Für die Flexibilität der Anleger besteht wöchentlich eine Rückgabemöglichkeit der Fondsanteile, die vom Investmentvermögen zum Nettoinventarwert zurückgenommen werden (offener Fonds).

Der Fonds investiert seine Mittel in höchst liquide derivative Finanzinstrumente an geregelten Märkten (EUREX) sowie in EURO-nominierte Anleihen und kann liquide Mittel bei Kreditinstituten halten.

### Fondsdetails

Anteilspreis	115,86
Währung	EUR
Ertragsverwendung	thesaurierend
Managementvergütung	bis zu 1,5%
Ausgabeaufschlag	bis zu 3,5%
Fondsart	Offener Spezial-AIF
AIF- Verwaltungsgesellschaft	IMB Kapitalverwaltungs- gesellschaft mbH

### Kennzahlen<sup>1)</sup>

	seit 11/2024
Rendite kumuliert	15,7%
Vola (annualisiert)	9,6%
Sharp-Ratio <sup>2)</sup>	1,79
Max. Drawdown	-3,9%
Korrelation vs. DAX	0,47

### Historische Wertentwicklung<sup>1)</sup>



Hinweis: Spezial-AIF gem. KAGB sind ausschließlich für den Vertrieb an semiprofessionelle- und professionelle Anleger zugelassen. Diese Informationen richten sich nur an taugliche Personen. Die AIF-Verwaltungsgesellschaft ist bei der zuständigen Aufsichtsbehörde (BaFin) registrierungspflichtig.

1) Berechnungen und Darstellung der depotführenden Stelle. Die AIF-Verwaltungsgesellschaft übernimmt keine Gewähr oder Haftung.

2) Risikoloser Zins: 3M US Treasury Bill.