

iM Global Partner creerà il fondo UCITS iMGP DBi Managed Futures

iM Global Partner ha annunciato oggi il futuro lancio di un nuovo fondo UCITS, iMGP DBi Managed Futures, insieme al partner Dynamic Beta investments per consentire agli investitori europei di accedere al sempre più interessante mercato dei “managed futures”.

Dynamic Beta investments (DBi) è un pioniere nell’attività di replica degli indici dei fondi alternativi e ha come obiettivo quello di offrire i vantaggi derivanti dalla diversificazione dei managed futures a una platea di investitori più ampia. DBi è stato nominato come sub-Manager del fondo **iMGP DBi Managed Futures**, fondo della sicav iMGP domiciliato in Lussemburgo.

Andrew Beer, Managing Member di Dynamic Beta investments e co-gestore del fondo, ha dichiarato: «La strategia dei “managed futures” consente potenzialmente una grande diversificazione, soprattutto in un contesto di inflazione. Nel 2015 ci eravamo prefissati di risolvere i due maggiori ostacoli caratteristici dei fondi alternativi ed in particolare nell’ambito dei Managed Futures: commissioni e spese elevate e rischio legato ad un unico gestore. I managed futures rappresentano il culmine di questo impegno».

Questa strategia è disponibile per gli investitori statunitensi da oltre 3 anni ed è diventata il più grande ETF di managed futures sul mercato. L’ETF managed futures di DBi (DBMF) domiciliato negli Stati Uniti ha infatti conosciuto una crescita straordinaria negli ultimi 12 mesi, con un incremento di oltre il 1000% del patrimonio gestito, che è passato dai 60 milioni di dollari di un anno fa a oltre 1 miliardo di dollari di oggi, e con un rendimento a 1 anno del 24,5% (al 25 novembre 2022, fonte Bloomberg, rendimento complessivo basato sui prezzi).

Jamie Hammond, iM Global Partner Deputy CEO, Head of International Distribution di iM Global Partner, ha commentato: «Il successo del nostro ETF domiciliato negli Stati Uniti (DBMF) ha portato i clienti europei a chiederci se avessimo intenzione di proporre un prodotto simile ma in versione UCITS. Questo lancio è la concretizzazione di tale richiesta. I clienti hanno fatto esperienza dei vantaggi della diversificazione nell’inclusione dei managed futures nei loro portafogli. Ora tale strumento è disponibile nella versione UCITS con liquidità e NAV giornaliera».

Il fondo iMGP DBi Managed Futures

Il nuovo fondo mira a replicare i rendimenti dei costi pre-commissione/pre-negoziazione di 20 importanti fondi speculativi di managed futures in un contenitore UCITS. Puntando alla performance di un portafoglio di fondi speculativi, suddivisi in diverse sub-strategie, il fondo mira a contenere il rischio legato al singolo gestore.

Il fondo punta a far combaciare le esposizioni dei fattori chiave dei fondi speculativi target con un portafoglio di contratti futures liquidi regolato dinamicamente.

Il fondo iMGP DBi Managed Futures non investe direttamente in hedge fund. Il gestore delegato, DBi, utilizza piuttosto modelli quantitativi per stimare le attuali ponderazioni dei fattori degli hedge fund target e investe in future su indici per cercare di ottenere esposizioni simili. Il portafoglio viene ribilanciato settimanalmente

Philippe Uzan, iM Global Partner Deputy CEO, CIO Global Asset Management, ha dichiarato: «A seguito della forte volatilità e dei rendimenti negativi dei mercati azionari e obbligazionari, molti investitori stanno disperatamente cercando un modo alternativo per diversificare. Quest'anno l'ETF managed futures di DBi ha fornito finora dei rendimenti positivi in ciascuno dei 6 mesi in cui le obbligazioni e gli indici azionari globali sono stati entrambi negativi. Inoltre ha registrato un andamento positivo nel 2020 (1,8%) e 2021 (11,2%) quando gli asset tradizionali erano in rialzo».