

IMQubator backar Romanesco

London (HedgeFonder.nu) - IMQ, en portföljförvaltare som specialiserat sig på att finansiera nya hedgefondstrategier i s.k. seeding projekt, backar nu Persistence Program - en systematisk trading strategi skapat av Romanesco Capital Management

Strategin kommer att finnas tillgänglig på Deutsche Banks dbSelect-plattform. Plattformen har en hög institutionell kvalitet och kan hjälpa till att reducera operationella risker och därmed öka nya förvaltares attraktionskraft.

Romanescos portfölj är brett diversifierad på över 45 likvida terminsmarknader, som valuta, obligationer, aktieindex och råvaror i en rad olika geografiska regioner på en 24-timmars basis och gör affärer med hjälp av en automatiserad exekutionsalgoritm som man utvecklat på Romanesco.

Tradingmodellerna kan vara långa, korta eller neutrala i de olika marknaderna. Därmed är Romanesco mer selektiv än de flesta andra CTA förvaltare vad gäller att besluta om när man ska vara exponerad mot en viss marknad.

IMQs VD och grundare Jeroen Tielman sade i ett uttalande att strategin passar in i portföljen på grund av att den inte är korrelerad med aktier och ökar diversifieringen jämfört andra existerande IMQ-förvaltare.

Korrelationsmönster jämfört med nyckelbenchmarks visar starka diversifieringsmöjligheter då Romanesco visar negativ korrelation mot både aktier och hedgefonder och en liten positiv korrelation jämfört med obligationer och managed futures. Romanescos avkastning ligger på 14% per år i snitt sedan 2005.

Bild: (c) shutterstock—Sergej Khakimullin