

iM Global Partner lanza un nuevo fondo UCITS, el iMGP DBi Managed Futures

Los inversores europeos tienen acceso a una exitosa estrategia de Managed Futures

Luxemburgo - 16 de febrero de 2023. Tras la aprobación de la CSSF a finales de diciembre, iM Global Partner ha anunciado el lanzamiento de un nuevo fondo UCITS, el **iMGP DBi Managed Futures** con su socio, Dynamic Beta investments, gracias al gran interés de los inversores europeos que han asignado hasta ahora 60 millones de euros en capital inicial.

Jamie Hammond, socio de iM Global, director general adjunto y responsable de distribución internacional, comentó: "Los futuros gestionados (Managed Futures) fueron una de las clases de activos con mejores resultados de 2022, y nuestra estrategia de ETF de futuros gestionados domiciliada en EE.UU. (DBMF) recibió un enorme apoyo de los inversores que buscaban diversificación fuera de los mercados de renta variable, combinada con una baja correlación. Por ejemplo, el SG CTA Index tuvo una correlación negativa de sólo -0,02 con las acciones mundiales (MSCI World Index) durante los últimos 5 años. Debido a ello, recibimos muchas consultas de inversores con sede en Europa sobre la posibilidad de ofrecer esta estrategia en formato UCITS, lo que hemos hecho ahora."

Dynamic Beta investments (DBi) es la subgestora del **iMGP DBi Managed Futures**, un nuevo subfondo de la SICAV UCITS domiciliada en Luxemburgo, iMGP.

Andrew Beer, de Dynamic Beta investments, Cogestor del fondo, ha declarado: "Los futuros gestionados (Managed Futures) - podría decirse que ofrece mayores ventajas de diversificación que las acciones y los bonos que la renta variable privada, el crédito privado, el sector inmobiliario, las materias primas y muchos otros diversificadores habituales. Con este fondo, pretendemos cambiar esta situación".

iM Global Partner lanzó esta estrategia hace 3 años para el mercado estadounidense, que se ha convertido en el mayor ETF de futuros gestionados del sector en términos de activos bajo gestión (fuente: etfdb.com a 30 de enero de 2023).

El DBMF, con sede en EE.UU., experimentó un crecimiento extraordinario en 2022, aumentando sus activos bajo gestión, de 60 millones de USD en 2021, a cerca de 1.000 millones de USD a finales de 2022 - registrando una rentabilidad a un año del 23,1% frente al -18,1% del índice MSCI World (fuente Morningstar, rentabilidad total basada en el valor liquidativo).

Las rentabilidades pasadas no predicen las rentabilidades futuras. La rentabilidad puede aumentar o disminuir como consecuencia de las fluctuaciones monetarias. Todas las cifras a 31 de diciembre de 2022. Fuente iM Global Partner salvo indicación contraria.

El iMGP DBi Managed Futures Fund

El nuevo fondo trata de replicar la rentabilidad antes de comisiones y costes de negociación de 20 de los principales hedge funds de futuros gestionados en el marco de un UCITS. Al centrarse en el rendimiento de una cartera de hedge funds, dividida entre diferentes subestrategias, pretende minimizar el riesgo de un único gestor.

El fondo trata de igualar las exposiciones a los factores básicos de los hedge funds seleccionados con una cartera de contratos de futuros líquidos ajustada dinámicamente.

El fondo iMGP DBi Managed Futures no invierte directamente en hedge funds. En su lugar, el subgestor, DBi, utiliza modelos cuantitativos para estimar las ponderaciones factoriales actuales de los “hedge funds objetivo” e invierte en futuros sobre índices para tratar de obtener exposiciones similares. La cartera se reequilibra semanalmente.

Acerca de iM Global Partner

iM Global Partner es una red mundial de gestión de activos. Seleccionamos y establecemos relaciones a largo plazo con empresas de gestión de activos independientes y con talento, a través de la propiedad directa de capital. Estamos presentes en 11 lugares de Europa y Estados Unidos y proporcionamos a nuestros clientes acceso a las mejores estrategias de inversión de nuestros socios. Tenemos más de 35.000 millones de USD de activos bajo gestión a finales de diciembre de 2022.

Socios con iM Global Partner

Polen Capital - renta variable growth (estadounidense y mundial), socio desde 2015

Dolan McEniry - Crédito estadounidense, socio desde 2016

Sirios - Renta variable long/short estadounidense, crédito estadounidense, Socio desde 2018

Dynamic Beta investments - Alternativas líquidas, Socio desde 2018

Scharf Investments - renta variable value estadounidense, socio desde 2019

Zadig Asset Management - Renta variable europea, Socio desde 2020

Richard Bernstein Advisors - Asignación global de activos, Socio desde julio de 2021

Asset Preservation Advisors - Bonos municipales estadounidenses, Socio desde septiembre de 2021

Berkshire Asset Management - Renta variable estadounidense centrada en dividendos, Socio desde diciembre de 2022

imgp.com

Acerca de la gama de fondos iMGP UCITS

La gama de fondos iMGP pretende acercar estrategias de inversión de alta calidad de gestores de carteras con talento de todo el mundo a asesores financieros, consultores, clientes institucionales e inversores particulares. La misión de iM Global Partner es encontrar estrategias diferenciadas en clases de activos que, en su opinión, ofrezcan la mejor oportunidad de añadir valor a través de la gestión activa. En la mayoría de los casos, las estrategias que iM Global Partner aporta al mercado no están disponibles a través de ningún otro fondo gestionado. La gama iMGP es una SICAV OICVM con múltiples subfondos y está regulada por la CSSF. La SICAV está gestionada por iM Global Partner Asset Management, con el objetivo de designar a los mejores gestores de fondos para ofrecer estrategias de alta calidad a través de 18 subfondos iMGP.

Acerca de las inversiones en Beta Dinámica

DBi fue fundada en Nueva York en 2012 por Andrew Beer y Mathias Mamou-Mani y tiene uno de los historiales más largos en el espacio de replicación de fondos de cobertura, con el lanzamiento de su primer producto en 2007. En la actualidad, DBi gestiona tres estrategias principales que buscan replicar el rendimiento antes de comisiones de carteras de hedge funds en las categorías de futuros gestionados, renta variable a largo/corto plazo y multiestrategia (renta variable a largo/corto plazo, valor relativo y Event-Driven). iM Global Partner adquirió una participación no mayoritaria en DBi en septiembre de 2018. Las inversiones de Dynamic Beta contaban con más de 2.100 millones de USD en activos gestionados a finales de diciembre de 2022.

www.dynamicbeta.com

Contacto con los medios de comunicación

Justine Trueman

media@imgp.com

Teléfono: +33 1 88 40 75 16

Descargo de responsabilidad

Esta es una comunicación de marketing. No es un documento contractual vinculante ni un documento informativo exigido por ley. La información contenida en este documento no constituye una oferta o recomendación de compra o venta de participaciones del fondo y no es suficiente para tomar una decisión de inversión. Le rogamos que consulte el folleto y el documento de datos fundamentales del fondo antes de tomar una decisión de inversión definitiva. Estos documentos, que contienen información completa sobre los riesgos asociados a la inversión, están disponibles en inglés en www.imgp.com.

La inversión se refiere a la adquisición de participaciones o acciones en un fondo y no en un activo subyacente determinado.