



Pressemitteilung

23. Oktober 2012

Ossiam nimmt globale Aktien in Minimum-Varianz-Strategien auf

Frankfurt, 23. Oktober 2012 - Der Smart Beta¹- und ETF-Investmentmanager Ossiam, ein Tochterunternehmen von Natixis Global Asset Management (NGAM), hat heute die Auflegung seines neuesten Exchange Traded Fund (ETF) bekannt gegeben. Der neue ETF wird Zugriff auf Ossiams Minimum-Varianz-Strategie bieten, die auf global entwickelte Aktienmärkte angewandt wird.

Der neue Fonds, Ossiam ETF World Minimum Variance NR, bildet die Performance des Ossiam World Minimum Variance Index NR nach. Der Index verfolgt das Ziel, die Netto-Total-Return-Performance einer Auswahl der liquidesten Aktien des S&P Global 1200® Index NR² zu erreichen, und diese so zu gewichten, dass das Risiko des Portfolios insgesamt minimiert wird. Der Index wird von Standard & Poor's³ in Echtzeit und zum Tagesende berechnet und veröffentlicht.

Der Fonds ist ab dem 22. Oktober 2012 an der Deutschen Börse Xetra, der NYSE Euronext Paris, der Borsa Italiana und ab dem 29. Oktober 2012 an der London Stock Exchange notiert.

In Deutschland werden die neuen ETFs (Xetra OSXA) in EUR notieren und von der NGAM S.A. Zweigniederlassung Deutschland vertrieben und vermarktet. Die Gesamtkostenquote beträgt 0,65 %.

Dank des robusten Rahmenwerks der Minimum-Varianz-Anlagestrategie von Ossiam konnten andere Investmentprodukte des Unternehmens, bei denen diese Strategie zum Einsatz kommt, ihr Ziel der Risikoreduzierung erreichen, wie auf der nächsten Seite gezeigt wird.

Bruno Poulin, CEO von Ossiam: *„Durch den Erfolg der Minimum-Varianz-Strategie bei anderen Produkten eröffnet Ossiam Anlegern die Möglichkeit in ein globales Aktienportfolio zu investieren, das auf die Reduzierung der Volatilität abzielt. Die Minimum-Varianz-ETFs von Ossiam bieten Zugang zu diversifizierten Portfolios, deren Entwicklung im Vergleich zum Aktienmarkt eine im Durchschnitt 30%⁴ geringere Volatilität und geringeren maximalen Kursrückgang durch den systematischen Ansatz aufweist.“*

Dieser Erfolg hat institutionelle sowie Groß- und Privatanleger bestärkt, seit der Auflegung im Juni 2011 weiterhin regelmäßig in die Strategien und ETFs von Ossiam zu investieren. Zum 30. September 2012 betrug das von Ossiam verwaltete Vermögen 525,5 Mio. EUR, einschließlich 264,4 Mio. USD im Ossiam ETF US Minimum Variance NR, 137,3 Mio. EUR im Ossiam ETF iSTOXX Europe Minimum Variance NR, und 64,1 Mio. USD im Ossiam ETF Emerging Markets Minimum Variance NR.

Hervé Guinamant, President und Chief Executive Officer von NGAM International Distribution, sagte: *„Die Volatilität wird bleiben, und ebenso wird es auch weiterhin Strategien zu deren Management geben. Unsere kürzlich durchgeführte globale Umfrage⁵ ergab, dass es die überwiegende Mehrheit der institutionellen Anleger schwierig findet, die Auswirkung der Marktvolatilität auf ihre Portfolios zu verringern. Doch ein noch größerer Anteil von ihnen sieht in der Marktvolatilität eine Anlagechance. Die Strategien und Fonds von Ossiam sind in der Lage, den volatilen Märkten von heute die Stirn zu bieten*



und Anlegern dabei zu helfen, ihre Renditeziele zu erreichen. Dadurch werden unsere Produkte beim Aufbau widerstandsfähigerer Portfolios zu einer wichtigen Komponente.“

Die folgende Tabelle zeigt die Performance von ETFs von Ossiam, die bereits an europäischen Börsen notiert sind und vor mehr als einem Jahr aufgelegt wurden:

ETFs und Indizes	Performance (%)	Differenz (%) ggü. Anlageuniversum	Volatilität (%)	Differenz (%) ggü. Anlageuniversum	Tracking Error ⁶ (%)
<i>Ossiam ETF US Minimum Variance NR (USD)</i> (Seit Fondsauflegung 07.06.2011 bis 28.09.2012)	18,43	4,01	14,54	-7,02	0,05
Anlageuniversum: S&P 500 Index NR	14,42	-	21,56	-	
<i>Ossiam ETF iSTOXX Europe Minimum Variance NR (EUR)</i> (Seit Fondsauflegung 21.06.2012 bis 28.09.2012)	12,36	8,83	12,65	-8,93	0,07
Anlageuniversum: STOXX Europe 600 NR	3,53	-	21,58	-	

Datenquelle: Bloomberg – Kalkulation durch Ossiam

Frühere Performance ist kein zuverlässiger Indikator für zukünftige Performance. Performances von Ossiam ETFs sind Nettoangaben (nach Gebühren und reinvestierten Dividenden). Performances für das Anlageuniversum sind ebenfalls Nettoangaben.

Die genannten Fonds sind Teilfonds von OSSIAM LUX, einer in Luxemburg ansässigen, durch die CSSF genehmigte SICAV. NGAM S.A. ist die Verwaltungsgesellschaft und Ossiam der Investmentmanager der Fonds.

-Ende-

Kontakt für Medienanfragen:

Ossiam
Isabelle Bourcier
Telefon: +33 (0)1 7840 5675
Email: isabelle.bourcier@ossiam.com

Natixis Global Asset Management S.A.
Billie Clarricoats
Telefon: +44 (0)203 405 2179
Email: billie.clarricoats@ngam.natixis.com



Hinweise für Redakteure:

¹ „Smart beta“ bezieht sich auf systematisch verwaltete, nicht nach der Marktkapitalisierung gewichtete Strategien für beliebige Asset-Klassen.

² Der S&P Global 1200® Index NR ist ein nach der Marktkapitalisierung gewichteter Index, der 31 Länder und ca. 70 % der globalen Aktienmarktkapitalisierung umfasst.

Die Renditen der Strategie werden mit Reinvestition der Netto-Dividenden berechnet (Bloomberg Ticker: OWMVNR Index).

³ Zur Minimierung möglicher Konflikte, die durch die Tatsache verursacht werden können, dass Ossiam die Gewichtung der Indexkomponenten an jedem Neugewichtungsdatum festlegt und als Vermögensverwalter agiert, hat Ossiam ein nicht verbundenes Drittunternehmen, S&P, mit der Berechnung und Veröffentlichung des Index beauftragt.

⁴ Gemäß Berechnungen, die Ossiam am 28.9.12 anhand von Backtest-Daten durchgeführt hat, die STOXX Ltd (Daten vor dem 14.06.2011 für den iSTOXX™ Europe Minimum Variance NR Index), Standard & Poor's (Daten vor dem 06.06.2011 für den Ossiam US Minimum Variance NR Index) bereitgestellt haben. Performance-Ergebnisse, die dem Backtesting unterzogen wurden, sind rein hypothetisch und repräsentieren nicht die Performance tatsächlicher Transaktionen unter Verwendung von Kundenvermögen, sondern werden durch die rückwirkende Anwendung eines Modells erzielt. Dieses Modell geht von der Reinvestition von Netto-Dividenden aus. Die in der Vergangenheit erzielte Performance ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Performance.

⁵ Siehe dazu die Highlights der Studie von Natixis Global Asset Management zu institutionellen Investoren aus Deutschland und der Schweiz, die vom Durable Portfolio Construction Research Center von Natixis Global Asset Management durchgeführt wurde. Die telefonische Umfrage wurde von Juni bis Juli 2012 durch OnResearch durchgeführt. OnResearch befragte jeweils 30 institutionelle Investoren aus Deutschland und der Schweiz, 60 insgesamt, die Unternehmenspensionskassen, öffentliche Pensionskassen, Dachfonds, Staatsfonds, Deckungsstock- und Stiftungsvermögen verwalten. Die Studie in Deutschland und der Schweiz ist Teil einer globalen Umfrage unter 482 institutionellen Investoren in 13 Ländern in Europa, Asien, dem Mittleren Osten sowie den USA und in Großbritannien. Eine Kopie der globalen Studie finden Sie unter:

http://download.stockheim-media.com/NGAM_Global_Institutional_Survey_Highlights.pdf

http://download.stockheim-media.com/NGAM_Institutional_Executive_Summary.pdf

⁶ Der Tracking-Error wird als Standardabweichung der Differenz zwischen der Performance eines Index-Fonds und der seines Referenz-Index definiert (gemäß Definition der Autorité des Marchés Financiers – der französischen Marktaufsichtsbehörde); die Berechnung erfolgt über einen Zeitraum von 52 Wochen.

Weitere Einzelheiten unter www.ossiam.com

Über Ossiam

Ossiam ist ein Tochterunternehmen von Natixis Global Asset Management. Die Zentrale von Ossiam befindet sich in Paris. Ossiam war das erste ETF-Unternehmen in Europa, das über ein breites Spektrum an Spezial-ETFs und -Fonds auf Grundlage einer quantitativen und Fundamentalanalyse Zugriff auf mehrere Finanzanlageklassen geboten hat. Das Team von Ossiam verfügt über umfassende Erfahrung in den Bereichen Fondsverwaltung, ETF-Strukturierung, fundamentale und quantitative Research und Trading.

Im Rahmen der diesjährigen Global Investor/ISF Investment Excellence Awards 2012 wurde Ossiam mit dem *ETF Issuer of the Year Award* ausgezeichnet.

www.ossiam.com

Über Natixis Global Asset Management, S.A.

Natixis Global Asset Management zählt in Bezug auf das verwaltete Vermögen zu den 15 größten Asset Management-Gesellschaften weltweit. NGAM bietet über spezialisierte Asset Manager Investmentprodukte an, welche das Vermögen und die Rücklagen für die Altersvorsorge sowohl von institutionellen Investoren als auch von Privatkunden vermehren und schützen sollen. Über sein unternehmenseigenes Vertriebsnetz werden Produkte seiner verbundenen Unternehmen weltweit gebündelt und vertrieben. NGAM führt die Expertise ihrer vielfach spezialisierten Manager in Europa, den



USA und Asiens zusammen, um so eine breite Palette von Aktien-, Anleihen- und alternativen Anlagestrategien weltweit zu vertreiben.

Mit Firmenzentralen in Paris und Boston verwaltete Natixis Global Asset Management per 30. Juni 2012 US-Dollar 711 Mrd. (EUR 560 Mrd).** Natixis Global Asset Management gehört zu Natixis, der an der Pariser Börse notierten Tochtergesellschaft von BPCE, der zweitgrößten Bankengruppe Frankreichs. Zu Natixis Global Asset Management gehören unter anderem folgende Kapitalanlagegesellschaften, Vertriebs- und Dienstleistungsunternehmen: Absolute Asia Asset Management, AEW Capital Management, AEW Europe, AlphaSimplex Group, Aurora Investment Management, Capital Growth Management, Caspian Capital Management, Darius Capital Partners, Gateway Investment Advisers, H2O Asset Management, Hansberger Global Investors, Harris Associates, IDFC, Loomis, Sayles & Company, Natixis Asset Management, Natixis Global Associates, Natixis Multimanager, McDonnell Investment Management, Ossiam, Reich & Tang Asset Management, Snyder Capital Management, und Vaughan Nelson Investment Management.

Natixis Global Asset Management ist durch ein weltweites Vertriebsnetz vertreten, einschließlich NGAM S.A., einer durch die CSSF zugelassene Luxemburger Verwaltungsgesellschaft und einer Zweigniederlassung in Deutschland, NGAM S.A. (HRB-Nummer 88541, Im Trutz Frankfurt 55, Westend Carrée, 7. Stock, 60322 Frankfurt am Main).

** Cerulli Quantitative Update: Global Markets 2012, am 31. Dezember 2011 mit 706 Mrd. USD unter Verwaltung auf Platz 13.*

*** Assets under management (AUM) may include assets for which non-regulatory AUM services are provided. Non-regulatory AUM includes assets which do not fall within the SEC's definition of 'regulatory AUM' in Form ADV, Part 1.*

<http://ngam.natixis.com>