



Ossiam bringt ESG-konforme und CO₂-reduzierte Version der Shiller Barclays CAPE® Sector Value-Strategie auf den Markt

Frankfurt am Main, 30. Mai 2018 – Der Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE®¹ US Sector UCITS ETF des Smart-Beta Investmentmanagers Ossiam, einer Tochtergesellschaft von Natixis Investment Managers mit Sitz in Paris, ist seit heute neu auf Xetra, der elektronischen Handelsplattform der Frankfurter Wertpapierbörse, gelistet. Bei diesem ETF handelt es sich um eine Version des bestehenden Ossiam Shiller Barclays CAPE® US Sector Value ETF mit Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) und einer Reduzierung des CO₂-Ausstoßes.

Der Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF ist darauf ausgerichtet, ein mit dem bestehenden Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Index vergleichbares Risiko- und Ertragsprofil zu erreichen, allerdings bei deutlich geringerem CO₂-Ausstoß und einem besseren ESG-Profil.

Ossiam hat die optimierte Strategie in Reaktion auf Rückmeldungen von bestehenden Anlegern entwickelt, die Klimaschutz- und ESG-bewusster investieren möchten. Die ursprüngliche Ossiam Shiller Barclays CAPE® US Sector Value-Strategie umfasst derzeit ein verwaltetes Vermögen von 1,22 Mrd. Euro per Ende April 2018.

ESG-Kriterien nehmen bei den von Anlegern geforderten Anlagelösungen sowie als Maßstab für die Wirtschaftspolitik einen immer größeren Stellenwert ein. Im Frühjahr lancierte die Europäische Kommission ihren Aktionsplan Finanzierung nachhaltigen Wachstums², bei dem die ESG-Faktoren von zentraler Bedeutung sind.

Der ETF, der auf physische Replikation setzt, weist eine Gesamtkostenquote (TER) von 0,85 Prozent auf und ist der erste Ossiam-ETF mit ICAV-Struktur (Irish Collective Asset Management Vehicle).

Bruno Poulin, CEO von Ossiam: *„Wir erweitern unseren bestehenden ETF um die Kriterien ESG und niedriger CO₂-Ausstoß, da diese wesentlich zur langfristigen Steigerung des Eigenkapitalwerts und höheren Wirksamkeit der CAPE®-Kennzahl von Shiller beitragen können. Wir gehen davon aus, dass die überarbeitete Strategie nachhaltige positive Renditen liefern und die gestiegene Nachfrage nach ethischen Investmentfonds bedienen wird.“*

Professor Robert J. Shiller: „ESG-Anlagen müssen nicht mehr unbedingt bedeuten, dass für einen moralischen Zweck ein Opfer gebracht wird. Dieser neue Fonds ist sowohl als Kernbestandteil eines Portfolios als auch als Anlage in Unternehmen mit positivem gesellschaftlichen Einfluss geeignet.“

Nicolas Aractingi, Director im Quantitative Investment Strategies Origination-Team bei Barclays: *„Wir freuen uns über die weitere Intensivierung der erfolgreichen Zusammenarbeit mit Ossiam und dem renommierten Autor und Yale-Ökonomen Robert Shiller. Diese Produkteinführung ist ein Beleg für unser Streben, ethische Anlagemöglichkeiten anzubieten. Damit werden wir dem Wunsch unserer Kunden gerecht, die verantwortungsbewusster anlegen wollen und ein umweltfreundliches und nachhaltiges Portfolio anstreben.“*

Im Rahmen der optimierten Strategie werden zunächst Unternehmen mit bestimmten Geschäftsaktivitäten, etwa in den Bereichen umstrittene Waffen, Tabak und Kohle, anderweitig kontrovers diskutierte Unternehmen sowie Unternehmen, die sich nicht an die zehn Prinzipien des UN Global Compact³ halten, aussortiert. Die Strategie stützt sich dabei auf öffentlich verfügbare Ausschlusslisten, die von großen, renommierten institutionellen Anlegern aus Skandinavien geführt werden. Sämtliche Filter sorgen für eine Optimierung des ESG-Profiles im Rahmen der Strategie.

Aus den verbleibenden Aktien wird gemäß der Strategie ein Portfolio zusammengestellt, das die finanziellen Merkmale des Barclays Shiller CAPE® US Sector Value Net TR Index nachbildet und den erwarteten Tracking Error minimiert. Anschließend wird das Portfolio klimafreundlicher gestaltet, ohne jedoch vom Sektor-Exposure des ursprünglichen Index abzuweichen. Die Verbesserung des CO₂-Fußabdrucks erfolgt in dreierlei Hinsicht: Reduzierung der gesamten Treibhausgasemissionen um 40 Prozent, Reduzierung der potenziellen Treibhausgasemissionen aus Reserven (d. h. der Treibhausgasemissionen aus nachgewiesenen fossilen Reserven, die zu einem späteren Zeitpunkt nach deren Förderung verbrannt werden) um 40 Prozent sowie Reduzierung der Kohlenstoffintensität der Strategie um 40 Prozent im Vergleich zum ursprünglichen Index.

Der ETF steht in einer thesaurierenden EUR-Anteilsklasse 1A (EUR) auf Xetra zur Verfügung (ISIN-Code: IE00BF92LV92, WKN: A2JFY7, Xetra-Symbol: 5HEEGY). Die thesaurierende Anteilsklasse 1A in US-Dollar (ISIN-Code: IE00BF92LR56; WKN: A2JFY6) wird im Laufe des Juni zum Handel zugelassen.

Kontakt für Medienanfragen:

Kerl & Cie Gesellschaft für Kommunikationsberatung GmbH

Samir Djikic

Telefon: +49 (0)69 870 021 516

E-Mail: s.djikic@kerlundcie.de

Hinweis für die Redaktionen:

Ossiam ist Unterzeichner der von den Vereinten Nationen unterstützten Grundsätze für verantwortungsbewusstes Investieren (*Principles for Responsible Investment*).

1. CAPE®-Kennzahl: Konjunkturbereinigtes Kurs-Gewinn-Verhältnis (*cyclically-adjusted price-earnings ratio*), 1981 von Robert Shiller in Zusammenarbeit mit seinem Doktoranden John Campbell entwickelt. Die von Barclays und dem Ökonomen Robert Shiller gemeinsam entwickelten Shiller Barclays CAPE® Sector Indizes nutzen die CAPE®-Kennzahl als Bewertungsgröße im Rahmen einer Sektor-Rotations-Strategie.
2. Link zum [Aktionsplan der Europäischen Kommission](#): *Finanzierung nachhaltigen Wachstums* (8. März 2018)
3. Link zu den [zehn Prinzipien](#) des UN Global Compact für unternehmerische Nachhaltigkeit.



Über Ossiam

Ossiam ist ein spezialisierter Anlageverwalter, der auf der Grundlage systematischer Investmentprozesse Investmentfonds, einschließlich börsengehandelter Indexfonds (Exchange Traded Funds, ETFs), entwickelt und verwaltet. Die Fonds von Ossiam basieren auf alternativ gewichteten Indizes – Stichwort Alternative Beta oder Smart Beta – für verschiedene Anlageklassen. ETFs von Ossiam sind seit 2011 an den wichtigen europäischen Börsen gelistet, u. a. an der Deutschen Börse, der Borsa Italiana, der London Stock Exchange, der NYSE Euronext und der SIX Swiss Exchange. Das Team bei Ossiam verfügt über umfangreiche Erfahrung in den Bereichen quantitatives Research und Produktentwicklung, Fondsmanagement, Handel und Risikomanagement.

Ossiam hat seinen Hauptsitz in Paris, Frankreich, und ist eine Tochtergesellschaft von Natixis Investment Managers. Die Investmentgesellschaft unterliegt der französischen Finanzmarktaufsicht (*Autorité des Marchés Financiers* (AMF)).

* Erster Vermögensverwalter, der einen ETF auf Basis einer Minimum-Varianz-Strategie aufgelegt hat

* Erster Vermögensverwalter, der einen risikogewichteten Smart-Beta-Rohstoff-ETF aufgelegt hat

Weitere Informationen sind erhältlich unter: www.ossiam.de.



Über Barclays

Barclays ist eine transatlantische Bank mit starker Präsenz in den beiden Heimatmärkten in Großbritannien und den USA, die Finanzprodukte und -dienstleistungen im Privat- und Firmenkundengeschäft, Investmentbanking, Kreditkartenwesen und Wealth Management anbietet.

Mit Erfahrung und Expertise aus über 325 Jahren im Bankgeschäft agiert Barclays in mehr als 40 Ländern mit rund 80.000 Mitarbeitern. Barclays transferiert, leiht, investiert und sichert Geld für Privat- und Geschäftskunden weltweit.

Weitere Informationen zu Barclays finden Sie auf der Webseite <https://www.home.barclays/>.



Über Natixis Investment Managers

Natixis Investment Managers unterstützt professionelle Investoren bei der Konstruktion ihrer Portfolios mittels neuester, interessanter Methoden. Basierend auf dem Know-How unserer 26 spezialisierten Investment Managern auf der ganzen Welt verfolgen wir unseren „Active ThinkingSM“-Ansatz und stellen so proaktive Lösungen zur Verfügung, die es unseren Kunden ermöglichen ihre Zielsetzungen unabhängig von aktuellen Marktbedingungen zu erreichen. Natixis zählt mit EUR 818,1 Mrd. verwaltetem Vermögen² zu den weltweit größten Asset Managern¹. Natixis Investment Managers, dessen Hauptsitze sich in Paris und Boston befinden, ist Bestandteil von Natixis. Natixis ist an der Pariser Börse notiert und ist eine Tochtergesellschaft von BPCE, der zweitgrößten Bankengruppe Frankreichs. Weitere Informationen sind unter dem folgenden Link verfügbar: ngam.natixis.com.

1 Im Rahmen des Cerulli Quantitative Update: Global Markets 2017 stuft Natixis Investment Managers, früher Natixis Global Asset Management, auf Basis des verwalteten Vermögens per 31. Dezember 2016 als die Nr. 15 unter den größten Vermögensverwaltern der Welt ein.

2 Nettoinventarwert per 31. März 2018.

Haftungsausschluss

Die Informationen in diesem Dokument stellen weder eine Steuer-, Rechts- oder Anlageberatung dar noch sind sie als Empfehlung für den Kauf oder Verkauf von Wertpapieren gedacht. Ossiam und alle anderen in diesem Dokument erwähnten Unternehmen übernehmen keine Haftung für Folgen aus Handlungen auf der Grundlage von Meinungen oder Aussagen in diesem Dokument oder für Informationslücken.