



Pressemitteilung

Ossiam Shiller Barclays Cape® US Sector Value TR ETF: Volumen überschreitet eine Milliarde US-Dollar

Frankfurt am Main, 24. Juli 2017 – Der vom Investmentmanager Ossiam, eine auf Smart-Beta-Anlagestrategien spezialisierte Tochtergesellschaft von Natixis Global Asset Management, aufgelegte Ossiam Shiller Barclays CAPE® US Sector Value TR ETF hat im Juni, zum zweiten Jahrestag seiner Auflegung, die Marke von einer Milliarde US-Dollar Assets under Management überschritten.

Der über drei Anteilsklassen (US-Dollar, Euro und Euro-hedged) zugängliche ETF mit Notierung an der Frankfurter Börse auf Xetra, der SIX Swiss Exchange, der London Stock Exchange, der Euronext Paris und der Borsa Italiana bildet den Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index ab. Neben dem Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR ETF ist der Ossiam Shiller Barclays CAPE® US Sector Value TR ETF einer der zwei ETFs, die auf den Shiller-Barclays-CAPE®-Sector-Value-Indizes basieren. Die in Zusammenarbeit mit Barclays und dem Ökonomen Professor Robert Shiller entwickelten Indizes nutzen das konjunkturbereinigte Kurs-Gewinn-Verhältnis (KGV) (Cyclically Adjusted Price Earnings, CAPE®) als Bewertungsgröße im Rahmen einer Sektor-Rotations-Strategie. Seit der Lancierung vor zwei Jahren hat sich ein breites Spektrum an Anlegern für ein Investment in diese Strategie entschieden, darunter Versicherungsgesellschaften, Pensionsfonds und diskretionäre Vermögensverwalter in Europa und Lateinamerika.

Die auf Euro und US-Dollar lautenden Anteilsklassen wurden im Juni 2015 aufgelegt. Die Auflegung der in Euro abgesicherten Anteilsklasse erfolgte auf Nachfrage der Anleger im Mai 2017. Seit der Lancierung im Juni 2015 hat der Fonds einen Wertzuwachs von 30,84 Prozent verzeichnet. Zum Vergleich: Der S&P 500 Net TR Index erzielte im selben Zeitraum eine Rendite von 17,67 Prozent (per 30. Juni 2017).

Professor Robert Shiller: *„Der US-Aktienmarkt scheint im Vergleich zum Rest der Welt momentan teuer, wobei dies nicht für alle Sektoren des US-Marktes gilt. Es ist sinnvoll, einen gewissen Teil eines diversifizierten Portfolios mit Value-Bias in den USA zu halten. Dies ist über die Ossiam-Shiller-Barclays-CAPE®-Produkte mit Ausrichtung auf US-Sektoren möglich. Ich danke den Mitarbeitern bei Ossiam und Barclays für ihre sorgfältige Arbeit, mit der sie so vielen Menschen den Zugang zu den CAPE®-Produkten ermöglicht haben.“*

Bruno Poulin, CEO von Ossiam: *„Dieser ETF zählt zu unseren beliebtesten Produkten – ein Umstand, den wir darauf zurückführen, dass der Fonds seit seiner Auflegung unter den unterschiedlichsten Marktbedingungen mit der weithin anerkannten CAPE®-Kennzahl als Bewertungsgrundlage für die Strategie durchweg positive Renditen erzielt hat. Wir sind stolz darauf, dass unsere Zusammenarbeit mit Professor Shiller und der Barclays Bank sich zu einer beständigen Erfolgsgeschichte entwickelt hat.“*

Nicolas Aractingi, Director im Quantitative-Investment-Strategies-Team bei Barclays: *„Wir freuen uns, dass unsere langjährige Zusammenarbeit mit Ossiam solch großen Zuspruch vonseiten der Kunden gefunden hat. Der Erfolg dieser beiden Produkte zeigt, dass die Ossiam-Shiller-Barclays-CAPE®-ETFs sich großer Beliebtheit bei vielen Kunden erfreuen, die Zugang zu dieser Familie von Smart-Beta-Indizes haben möchten.“*

Robert Shiller entwickelte die CAPE®-Kennzahl, auch Shiller KGV genannt, ursprünglich 1981 in Zusammenarbeit mit seinem Doktoranden John Campbell. Mithilfe des häufig genutzten Shiller KGV lässt sich abschätzen, ob der Aktienmarkt über- oder unterbewertet ist. Die Kennzahl vergleicht den aktuellen Marktwert eines Portfolios mit den durchschnittlichen inflationsbereinigten kumulierten Unternehmensgewinnen über einen Zeitraum von zehn Jahren. So können konjunkturzyklische Effekte ausgeblendet werden.

Professor Shiller hat die CAPE®-Kennzahl auf Aktiensektoren ausgeweitet und in Zusammenarbeit mit Barclays eine auf dieser Bewertungsgröße basierte Sektor-Auswahlstrategie entwickelt. Die Strategie verwendet den relativen CAPE®-Indikator, eine normalisierte Version der CAPE®-Kennzahl, und wird durch einen Momentum-Filter ergänzt. So werden überbewertete Sektoren vermieden und potenzielle Value-Fallen eliminiert, um ein Sektor-Portfolio mit Value-Bias zu schaffen, das die Auswahl der richtigen Branchen zum richtigen Zeitpunkt ermöglicht.

Allgemeine Informationen zum Ossiam Shiller Barclays CAPE® US Sector Value TR
UCITS ETF 1C (EUR):

ISIN	LU1079841273
WKN	A116QV
XETRA Symbol	USCP GR
Assets under Management (Stand: 30.06.2017)	1,055 Milliarden US-Dollar (925,23 Millionen Euro)
Gesamtkostenquote (TER) p.a.	0,65 Prozent

- Ende -

Kontakt für Medienanfragen

Kerl & Cie Gesellschaft für Kommunikationsberatung GmbH
Samir Djikic
Telefon: +49 (0)69 870 021 516
E-Mail: s.djikic@kerlundcie.de

Weitere Informationen zu den Investmentfonds sind unter dem Link www.ossiam.com verfügbar.

Bei den erwähnten Fonds handelt es sich um Teilfonds von OSSIAM LUX, einem in Luxemburg domizilierten SICAV mit Zulassung durch die luxemburgische Marktaufsicht CSSF. NGAM S.A. ist die Verwaltungsgesellschaft und Ossiam der Investmentmanager der Fonds.

Über Ossiam

Ossiam ist ein Tochterunternehmen von Natixis Global Asset Management mit Hauptsitz in Paris, Frankreich. Ossiam war der erste auf Smart-Beta-Lösungen spezialisierte Anlageverwalter, der Anlegern über ein auf quantitativen und Fundamentalanalysen basierendes breites Spektrum spezieller börsennotierter Fonds (ETFs) ein Engagement in mehreren Finanzanlageklassen ermöglichte. Das Team von Ossiam verfügt über umfassende Erfahrung in den Bereichen Fondsverwaltung, ETF-Strukturierung, fundamentale und quantitative Analyse sowie im Handel. Per 30.06.2017 hat Ossiam ein Vermögen von insgesamt 2,5 Milliarden Euro verwaltet, darunter ETFs sowie institutionelle Mandate.

- Ossiam war der erste Vermögensverwalter weltweit, der einen ETF auf Basis einer Minimum-Varianz-Strategie auflegte.
- Ossiam war der erste Vermögensverwalter weltweit, der ein risikogewichteten Smart-Beta Rohstoff-basierten ETF auflegte.
- Funds Europe Awards 2014 – Besondere Anerkennung in der Kategorie „ETF Anbieter des Jahres“
- Structured Products Europe Awards 2014 – ETF Anbieter des Jahres
- Global ETF Awards 2015 – Innovativster ETF-Europa (OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® EUROPE SECTOR VALUE TR)
- vwd CASH fund awards 2016 – Best Equity Advanced Europe (OSSIAM STOXX® EUROPE 600 EQUAL WEIGHT NR)

Über Natixis Global Asset Management, S.A.

Natixis Global Asset Management betreut umsichtig agierende Investmentexperten weltweit, indem wir ihnen Möglichkeiten aufzeigen, mit noch mehr Verständnis für die Märkte zu investieren. Mit unserem Durable Portfolio Construction®-Ansatz fokussieren wir uns auf die Risikokontrolle. Dabei helfen wir unseren Kunden dabei, strategisch ausgerichtete Portfolios aufzubauen, die den aktuell unberechenbaren Marktentwicklungen trotzen. Dabei greifen wir auf eine umfassende Investmenterfahrung sowie eine gründliche Kenntnis der jeweiligen Branchen zurück und arbeiten außerdem eng mit unseren Kunden zusammen, damit unsere Investmentgedanken stets auf objektiven Daten basieren.

Natixis zählt zu den größten Vermögensverwaltungsgesellschaften weltweit⁽¹⁾. Durch die Bündelung von mehr als 20 spezialisierten Investmentmanagern aus aller Welt und einem verwalteten Vermögen von 895 Mrd. USD⁽²⁾ können wir für jede strategische Investmentanforderung eine breite Palette von Anlagelösungen anbieten. Von den ersten analytischen Erkenntnissen bis zur letztendlichen Umsetzung der entsprechenden Anlageideen unterstützen wir bei Natixis unsere Kunden bei der Zusammenstellung nachhaltig stabiler Portfolios.

Mit Firmenzentralen in Paris und Boston und AUM von 895 Mrd. USD (Stand 31. März 2017)⁽²⁾ gehört Natixis Global Asset Management, S.A. zu Natixis, einer in Paris börsennotierten Tochtergesellschaft von BPCE, der zweitgrößten Bankengruppe Frankreichs. Zu den mit Natixis Global Asset Management, S.A. verbundenen Investmentmanagement-, Vertriebs- und Dienstleistungsgesellschaften zählen Active Investment Advisors⁽³⁾; AEW Capital Management; AEW Europe; AlphaSimplex Group; Axeltis; Darius Capital Partners; DNCA Investments⁽⁴⁾; Dorval Asset Management⁽⁵⁾; Emerise⁽⁶⁾; Gateway Investment Advisers; H2O Asset Management⁽⁵⁾; Harris Associates; IDFC Asset Management Company; Loomis, Sayles & Company; Managed Portfolio Advisors⁽³⁾; McDonnell Investment Management; Mirova⁽⁵⁾; Natixis Asset Management; Ossiam; Seeyond⁽⁷⁾; Vaughan Nelson Investment Management; Vega Investment Managers sowie Natixis Global Asset Management Private Equity (einschließlich Seventure Partners, Naxicap Partners, Alliance Entrepreneurs, Euro Private Equity, Caspian Private Equity und Eagle Asia Partners). Weitere Informationen finden Sie unter <http://ngam.natixis.com>.

Nicht alle Angebote sind in allen Rechtsräumen verfügbar. Durable Portfolio Construction ist keine Garantie für Gewinne oder Schutz vor Verlusten.

Zu Natixis Global Asset Management, S.A. gehören auch Geschäftsentwicklungseinheiten aus der ganzen Welt. Dazu zählt mit NGAM S.A., Zweigniederlassung Deutschland, eine Niederlassung von NGAM S.A., die von der Commission de Surveillance du Secteur Financier autorisiert ist und von dieser Behörde beaufsichtigt wird. Zu Natixis Global Asset Management, S.A. gehören auch Geschäftsentwicklungseinheiten aus der ganzen Welt. Dazu zählt auch NGAM S.A., Switzerland Sàrl.

(1) Im Rahmen des „Cerulli Quantitative Update: Global Markets 2016“ wurde Natixis Global Asset Management, S.A. auf Basis seines per 31. Dezember 2015 verwalteten Vermögens (AUM von 870.3 Mrd. USD) als Nummer 16 der größten Vermögensverwalter der Welt eingestuft.

(2) Der Nettoinventarwert versteht sich per 31. März 2017. Das verwaltete Kundenvermögen kann auch Anlagegelder umfassen, für die nicht-regulierte Vermögensverwaltungsdienstleistungen erbracht werden. Zu diesen nicht-regulierten Geldern zählen jene Anlagevermögen, auf welche die Definition der SEC von „regulierten Anlagegeldern“ im Sinne von Teil 1 des ADV-Formulars nicht zutrifft.

(3) Eine Abteilung von NGAM Advisors, L.P.

(4) Eine Marke von DNCA Finance.

(5) Eine Tochtergesellschaft von Natixis Asset Management.

(6) Eine Marke von Natixis Asset Management und Natixis Asset Management Asia Limited mit Sitz in Singapur und Paris.

(7) Eine Marke von Natixis Asset Management.