



Pressemitteilung

Zur sofortigen Veröffentlichung

## **Ossiam gibt Auflegung des ersten risikogewichteten Smart Beta Rohstoff-ETFs bekannt**

Frankfurt, 12. September 2013 - Der Smart Beta- und ETF-Investmentmanager Ossiam, ein Tochterunternehmen von Natixis Global Asset Management (NGAM), gibt heute an der Deutschen Börse (Xetra) die Auflegung eines neuen UCITS-börsengehandelten Fonds (ETF) bekannt. Der neue ETF bildet den *Risk-Weighted Enhanced Commodity Ex-Grains Index TR*<sup>1</sup> nach, der von S&P börsentäglich berechnet und veröffentlicht wird.

Hierbei handelt es sich um den ersten risikogewichteten Smart Beta Rohstoff-ETF weltweit.

Der *Ossiam Risk-Weighted Enhanced Commodity ex-Grains TR UCITS ETF* ermöglicht Investoren ein systematisches, ausschließliches Engagement in Long-Positionen eines diversifizierten Korbes aus 20 Rohstoff-Terminkontrakten (ohne Getreide) mit geringerer Volatilität. Im Vergleich zu Standard-ETFs, die nur Long-Positionen auf breit angelegte Rohstoffindizes beinhalten, bietet der zugrunde liegende Index eine bessere Beteiligung an der Wertentwicklung aller Rohstoffsektoren. Dabei wird besonders die Konzentration auf Rohöl vermieden. Hinsichtlich der Risikoverteilung handelt es sich also um ein effizienteres Portfolio.

**Bruno Poulin, Vorstandsvorsitzender von Ossiam,** kommentiert: *„Die Auflage des neuen Rohstoff-ETFs ist der Beginn einer wichtigen Phase unserer Entwicklung. Dieses Produkt basiert auf unserer langfristig ausgerichteten Strategie bei Ossiam, Investoren eine breit gefächerte, innovative Palette an Smart Beta-Anlageinstrumenten anzubieten. Wir verdeutlichen damit unsere führende Position bei der Entwicklung und Umsetzung von Anlagestrategien mit innovativen Gewichtungsmechanismen, die den Zielen risikobewusster Investoren entsprechen.“*

---

<sup>1</sup> TR steht für Total Return (Gesamtrendite). Die Methode der Indexberechnung berücksichtigt die Verzinsung eines voll besicherten Investments in 3-monatige US-Schatzwechsel.

**Isabelle Bourcier, Head of Business Development von Ossiam:** „Mit diesem neuen ETF erweitern wir die Bandbreite unserer Smart Beta-Investment-Lösungen um eine neue Anlageklasse. Vor allem ist unser neuer ETF für institutionelle Investoren und Fondsmanager geeignet, die ihre globalen Portfolios diversifizieren möchten.“

**Jörg Knaf, Managing Director, Nordeuropa bei NGAM:** „Die aktuelle geopolitische Lage im Nahen Osten widerlegt mehr als deutlich die These, dass verschiedene Assetklassen immer stärker korrelieren. Spätestens jetzt sollte Anlegern klar sein, dass eine Anlage in Rohstoffe nicht nur gegen Inflation schützt, sondern einen Kursverfall abfedert. Zu einer sinnvollen Diversifikation gehören also Rohstoffe in das Portfolio.“

Der Index vereint zwei besondere Merkmale in einer Strategie. Zunächst ermöglicht der Anlageprozess die Allokation auf 20 Rohstoff-Terminkontrakte, die anhand ihrer Volatilität gleich gewichtet werden. Der Index wird monatlich neu angepasst, wobei jeder Rohstoff-Terminkontrakt umgekehrt proportional zur Volatilität gewichtet wird. Das sichert ein solides Risikobudget, indem Rohstoff-Terminkontrakte mit der geringsten Volatilität höher gewichtet werden. Zudem beinhaltet die Strategie automatisch eine verbesserte Fortschreibungsrendite, indem Terminkontrakte nach der Methode des S&P GSCI Enhanced oder Dynamic ausgewählt und in die nächste Fälligkeit gerollt werden, um die Backwardation zu maximieren bzw. das Contango zu minimieren.

*Der Ossiam Risk Weighted Enhanced Commodity ex. Grains TR UCITS ETF 1C (EUR) (Xetra OSXC)* ist Swap-basiert und seine Gesamtkostenquote (TER) liegt bei 45 Basispunkten. Ossiam führt heute ETFs auf denselben Index auch an der London Stock Exchange, der Borsa Italiana und der NYSE Euronext Paris ein.

Das von Ossiam verwaltete Vermögen belief sich per Ende August 2013 auf ein Gesamtvolumen von 911.7 Mio. EUR (1 206.8 Mio. USD).

Der ETF wird in Deutschland von Natixis Global Asset Management vertrieben und vermarktet.

-Ende-

#### **Kontakte für Presseanfragen:**

Für Ossiam

Isabelle Bourcier  
Head of Business Development  
Telefon: +331 78 40 56 75  
Mobiltelefon: +336 29 63 15 42  
E-Mail: [isabelle.bourcier@ossiam.com](mailto:isabelle.bourcier@ossiam.com)

Stockheim Media

Alexandra Zahn  
Telefon: +49 69 133 896-12  
Email: [az@stockheim-media.com](mailto:az@stockheim-media.com)

## **Hinweise für Redakteure:**

Weitere Einzelheiten über die Positionen des Fonds finden Sie unter [www.ossiam.com](http://www.ossiam.com).

Die genannten Fonds sind Unterfonds von OSSIAM LUX, einer von der luxemburgischen Finanzmarktbehörde CSSF zugelassenen SICAV mit Sitz in Luxemburg. NGAM S.A. ist die Verwaltungsgesellschaft und Ossiam der Investment Manager der Fonds.

### **Zu 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.

\* Ossiam war der erste Vermögensverwalter in Europa, der einen ETF auf Basis einer Minimum-Varianz-Strategie auflegte.

\* Ossiam wurde bei den *"Global Investor/ISF Investment Excellence Awards 2012"* als *"ETF-Emittent des Jahres"* ausgezeichnet.

[ossiam.com](http://ossiam.com)

### **Zu Natixis Global Asset Management**

Natixis Global Asset Management ist am verwalteten Vermögen gemessen einer der 15 größten Vermögensverwalter weltweit. Seine verbundenen Vermögensverwaltungsgesellschaften offerieren Anlageprodukte, die darauf abzielen, das Vermögen und die Altersvorsorgeanlagen institutioneller und privater Anleger zu vergrößern und zu schützen. Über sein unternehmenseigenes Vertriebsnetz werden Produkte seiner verbundenen Unternehmen weltweit gebündelt und vertrieben. Natixis Global Asset Management vereint das Fachwissen mehrerer spezialisierter, in Europa, den Vereinigten Staaten und Asien ansässiger Anlageverwalter, die ein breites Spektrum an Aktien-, Renten- und alternativen Anlagestrategien anbieten.

Im *Cerulli Quantitative Update: Global Markets 2013* rangiert Natixis Global Asset Management, S.A. an 15. Stelle der weltweit größten Vermögensverwalter auf Grundlage des zum 31. Dezember 2012 verwalteten Vermögens.

Zum 30. Juni 2013 verwaltete Natixis Global Asset Management mit Sitz in Paris und Boston ein Vermögen von insgesamt € 602.5 Mrd. Natixis Global Asset Management, S.A. verfügt über ein weltweites Netzwerk an Vertriebseinheiten, einschließlich der

NGAM UK Limited, die von der Finanzaufsichtsbehörde des Vereinigten Königreichs (UK Financial Services Authority) zugelassen ist und deren Aufsicht unterstellt ist.

Natixis Global Asset Management ist Teil von Natixis, an der Pariser Börse notiert und eine Tochtergesellschaft von BPCE, dem zweitgrößten Bankenkonzern Frankreichs. Mit Natixis Global Asset Managements verbundene Anlageverwaltungsgesellschaften und Vertriebs- und Service-Konzerne sind namentlich: 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, Loomis, Sayles & Company, Natixis Asset Management, Natixis Multimanager, Ossiam, Reich & Tang Asset Management, Snyder Capital Management und Vaughan Nelson Investment Management.

[ngam.natixis.com](http://ngam.natixis.com)