

PRESSEMITTEILUNG

Neue Managed Volatility-Strategie ermöglicht renditestarke, risikoreduzierte Aktieninvestments

KÖLN, 12. MAI 2009

- *Höherer Aktienanteil für institutionelle Anleger mit Value-at-Risk-gesteuerten Anlagekonzepten möglich*
- *Signifikante Renditesteigerung durch Anreichern des konventionellen Minimum-Varianz-Ansatzes mit prognosebasierter Aktienselektion*

Die Oppenheim Kapitalanlagegesellschaft mbH (Oppenheim KAG) erweitert ihr Fondsangebot für institutionelle Anleger um einen Aktienfonds, der nach der Managed Volatility-Strategie gesteuert wird. Die Strategie basiert auf einem seit über zehn Jahren erfolgreichen Investmentprozess. Zurzeit existiert eine hohe Nachfrage nach risikoreduzierten Aktieninvestments, insbesondere bei Versicherungen und Pensionskassen. Als Investmentkandidaten werden zunächst mit einem quantitativen Prognosemodell Aktien ausgewählt, die ein überdurchschnittliches Renditepotenzial versprechen. Aus diesem Aktienuniversum wird das Portfolio mit dem geringsten zu erwartenden Risiko (Volatility) gebildet.

„Untersuchungen haben gezeigt, dass unsere um Richtungsprognosen erweiterte Strategie die Rendite des klassischen Minimum-Varianz-Ansatzes bei nahezu gleichem Risiko signifikant übertroffen hat“, kommentiert Frank Kosiolek, Abteilungsleiter „Active Quant Products“, die Ausrichtung des Fondskonzepts. Die deutliche Reduzierung des absoluten Risikos ermöglicht es Anlegern, die Value-at-Risk-gesteuerte Anlagekonzepte verfolgen, einen höheren Anteil an Aktien in ihrem Portfolio zu halten.

DIVERSIFIKATION DER MANAGEMENTANSÄTZE IM AKTIENBEREICH

Bei der von der Oppenheim KAG verfolgten Managed Volatility-Strategie wird besonderer Wert auf einen hohen Diversifikationsgrad gelegt, indem die Gewichtungen einzelner Aktien begrenzt und somit Klumpenrisiken vermieden werden. Die Auswirkungen von starken Einzelwertschwankungen auf das Gesamtportfolio

Seite 1 von 2

SAL. OPPENHEIM

werden so reduziert. Der Total Return-Ansatz eignet sich hervorragend zur Diversifikation der Managementansätze im Aktienbereich eines Investors. In der letzten Dekade entwickelte sich die Strategie wesentlich besser als die marktüblichen Benchmarks.

(Ende der Pressemitteilung)

Ergänzende Informationen und Grafiken erhalten Sie auf Anfrage.

KONTAKT

Thomas Stein

Stockheim Media

Telefon: +49 221 420 75-15

Telefax: +49 221 420 75-59

Mobil: +49 173 692 86 35

E-Mail ts@stockheim-media.com