

Presseinformation

NORD/LB AM setzt auf quantitatives Management.

Hannover, 26.10.2016 – Ein NORD/LB AM Spezialisten-Team hat eine auf Mustererkennungsverfahren beruhende „regimebasierte Asset Allocation“ entwickelt. Sie bietet einen risikobewussten, stringenten und regelgebundenen Pfad auch durch strukturell instabile Kapitalmärkte. Seit Juli wird das Modell im NORD/LB AM Opti Top eingesetzt, einem Publikumsfonds für institutionelle Anleger. Kern der neuen Strategie ist ein selbstlernender Algorithmus, der Marktmuster erkennt und Regimen zuordnet. Die hieraus resultierenden Regimecharakteristika bezüglich Return, Volatilität und Korrelation stellen sich flexibel auf grundsätzliche Veränderungen im Kapitalmarktumfeld ein.

Anlageziel ist ein ertrags- und risikokontrolliertes Investment in liquide europäische Aktien und Bundesanleihen mit ein- bis dreijähriger beziehungsweise sieben- bis zehnjähriger Laufzeit. Aktienseitig speist sich das Anlagespektrum aus dividendenstarken Titeln des EuroStoxx 50, wie sie auch im Publikumsfond NORD/LB AM Top 35 abgebildet sind.

Herzstück des Fonds ist ein Algorithmus, welcher Marktstrukturen aus vergangenen Ereignissen erkennt und selbstlernend antizipiert. Die der Allokationsstrategie zugrundeliegenden Kriterien setzen sich deutlich von im Markt befindlichen Produkten ab. „Wir können hier von einer echten Marktneuheit sprechen,“ sagt Carsten Schmeding, Vorstandsvorsitzender der NORD/LB AM. „Das automatisierte Lernen und das Verarbeiten von Marktmustern ist in dieser Komplexität und Vielfalt einmalig“, so Schmeding weiter. „Den Investmententscheidungen liegen klare quantitative Regeln zugrunde.“

Angepasst an das Rendite - Risikoprofil kann die Aktienquote variieren. Derivate auf Aktienmärkte und deutsche Bundesanleihen komplettieren das Anlageuniversum dieser stringenten und regelgebundenen Allokationsstrategie. Während die Regimeüberwachung auf täglicher

Pressekontakt

NORD/LB Asset Management
Delphine Hertel
Marketing
Prinzenstraße 12
30159 Hannover

Tel: 0511-12354-140
Fax: 0511-12354-141
delphine.hertel@nordlb-am.de
www.nordlb-am.de

insignis Agentur für Kommunikation
GmbH (GPRA)
Raik Packeiser & Steffen Maltzan
Luisenstraße 5
30159 Hannover

Tel. 0511-13 22 14-13
Fax 0511-13 22 14-99
raik.packaiser@insignis.de
steffen.maltzan@insignis.de
www.insignis.de

Basis stattfindet, erfolgt die Allokation automatisiert in einem 30-tägigen Zyklus.

Vor dem Hintergrund des auch langfristig anhaltenden niedrigen Zinsniveaus, der vergleichsweise hohen Attraktivität von Dividentiteln und der zunehmenden Absolute-Return-Orientierung von Investmentanlagen gewinnen regelbasierte Strategien an Bedeutung. Mit dem vorliegenden Modell entwickelt die NORD/LB AM bereits bestehende Ansätze weiter. Mittlerweile ist das regimebasierte Overlay auf nachhaltige Aktieninvestments auf Basis des NORD/LB AM Global Challenges Index-Publikumsfonds erfolgreich ausgeweitet worden. Geplant ist, das Anlagespektrum auf internationale Immobilienaktien (REITs) in Kombination mit Bundes- oder Unternehmensanleihen zu erweitern.

Unser Allokationsmodell wählt dabei eine optimale Gewichtung von drei regionalen Immobilienaktienindices (America, Asia Pacific und EMEA) sowie kurz- und langlaufenden Bundesanleihen.

Bezogen auf den Zeitraum der letzten 16 Jahre erzielt die Strategie eine Rendite vergleichbar mit der Rendite auf dem Niveau des besten Marktes von Immobilienaktien (REITs America), während sich das Portfoliorisiko nahezu halbiert.

NORD/LB Asset Management AG

Die NORD/LB Asset Management AG wurde 1999 gegründet und beschäftigt an ihrem Unternehmenssitz Hannover 100 Mitarbeiter. Das Dienstleistungsangebot reicht vom passiven bis zum individuell gestalteten Aktien- und Rentenfondsmanagement. Neben den Produktvarianten Publikumsfonds und Spezial-AIF werden auch umfassende Master-KVG-Lösungen offeriert. Studien und Markterhebungen bescheinigen der NORD/LB Asset Management AG besondere Effizienz bei der flexiblen Umsetzung individueller Kundenanforderungen. Außerdem zählt die Gesellschaft zu den Vorreitern im Bereich nachhaltiger Investments.

Pressekontakt

NORD/LB Asset Management
Delphine Hertel
Marketing
Prinzenstraße 12
30159 Hannover

Tel: 0511-12354-140
Fax: 0511-12354-141
delphine.hertel@nordlb-am.de
www.nordlb-am.de

insignis Agentur für Kommunikation
GmbH (GPRA)
Raik Packeiser & Steffen Maltzan
Luisenstraße 5
30159 Hannover

Tel. 0511-13 22 14-13
Fax 0511-13 22 14-99
raik.packaiser@insignis.de
steffen.maltzan@insignis.de
www.insignis.de