

Presse-Information
Bayerische Vermögen AG

München

19. April 2016

Die Bayerische Vermögen AG schließt mit der Deutschen Asset Management Subadvisor-Vereinbarung für neue Multi-Asset-ETF-Strategie Global Multi Asset Index (GMAX)

Die Bayerische Vermögen AG hat mit der Deutschen Asset Management (Deutsche AM) einen Subadvisor-Vertrag für den vermögensverwaltenden Investmentfonds D3RS Welt AMI¹ geschlossen. Die Deutsche AM berät, vorbehaltlich der Genehmigung und Prospekteintragung der Kapitalverwaltungsgesellschaft des Fonds, im Rahmen des Mandats den bayerischen Vermögensverwalter bei der Entwicklung und Umsetzung einer global aufgestellten Multi-Asset-ETF-Strategie. „Wir freuen uns, mit der Deutschen AM einen renommierten Partner für unsere neue Anlagestrategie Global Multi Asset Index (GMAX) gewonnen zu haben“, sagt Thomas Drabek, Portfoliomanager der GMAX-Strategie. „Über das Mandat greifen wir sowohl auf die globalen Research- und Analysekapazitäten der Deutschen AM als auch auf eine Vielzahl von quantitativen Modellberechnungen zurück“, erläutert Drabek die Vorteile der Kooperation.

Die Bayerische Vermögen AG richtet mit der Anlagestrategie den vermögensverwaltenden Investmentfonds D3RS Welt AMI neu aus. Mit dem neuen Multi-Asset-Ansatz wird weltweit in alle Vermögensklassen investiert und das ausschließlich über börsennotierte Indexfonds (Exchange Traded Funds, ETFs). Mit ETFs lassen sich Indizes einfach, transparent und flexibel abbilden. Zudem kann das Investment über ETFs preiswert, breit diversifiziert und weltweit in alle Anlageklassen erfolgen. Durch eine optimale Kombination aller Anlageklassen wird eine Balance zwischen Rendite und Risiko erzielt. „Im Gegensatz zu vielen anderen Marktteilnehmern rebalancieren wir in der GMAX-Strategie nicht nach den ursprünglichen Gewichtungen der Anlageklassen, sondern nach der Volatilität“, erklärt Drabek.

Auch aufgrund des Niedrigzinsumfelds setzen Anleger immer häufiger auf Multi-Asset-Produkte. Schätzungen gehen davon aus, dass sich das weltweit verwaltete Vermögen von 3,5 Bio. US-Dollar in 2013 um über 80 Prozent auf über 6 Bio. US-Dollar in 2018 erhöhen wird². Der europäische Multi-Asset-Markt hat sich zwischen 2009 und 2014 um fast 50 Prozent vergrößert.³

¹ Vgl. A1C4DR

² Morgan Stanley Schätzungen, ICI, Lipper FERI, Casey Quirk „Life after Benchmarks“ Studie, November 2013

³ EFAMA October 2014, Kumulative Neugelder seit 2009, Europäischer Multi-Asset-Markt

Quantitatives Portfolio mit angestrebter Zielvolatilität

Die Bayerische Vermögen AG wird künftig ein quantitatives ETF Modellportfolio nutzen. Hier werden die Investmentziele und das Rendite-Risiko-Profil in Form einer angestrebten Zielvolatilität auf Basis eines quantitativen Ansatzes realisiert. Damit ist sowohl eine hohe Transparenz insbesondere der Portfoliowertpapiere als auch der Investmentstrategie gegeben. Die finale Investmententscheidung und konkrete Implementierung verbleiben beim Vermögensverwalter.

Die Bayerische Vermögen AG

Die Bayerische Vermögen AG gehört zum Kreis der führenden unabhängigen Asset Manager für anspruchsvolle Investoren. Die Bayerische Vermögen Asset Management bündelt die Kompetenzen im Bereich Kapitalmarktforschung, Fonds- und Anlageklassenanalyse und Vertrieb für institutionelle Anleger.

Die Bayerische Vermögen betreut seit 1998 Stiftungsvermögen und große Privatvermögen. Mit einem verwalteten Vermögen von über einer Milliarde Euro belegt das Unternehmen in der ersten Liga der bankenunabhängigen Vermögensverwalter im deutschsprachigen Raum einen der vorderen Plätze. Zahlreiche Auszeichnungen und Spitzenplätze bei Fondswettbewerben untermauern die Stellung der Bayerische Vermögen.

Anleger erwarten von ihrem Vermögensverwalter Verantwortungsbewusstsein, Orientierung sowie nachvollziehbare und transparente Investitionsentscheidungen. Sie streben nach Mehrwert, Nachhaltigkeit sowie langfristiger Vermögensmehrung und wollen an den Überlegungen des Verwalters teilhaben. Wir sind überzeugt, dass diese Erwartungen nur durch eine breite Diversifikation eines Portfolios unter Nutzung des gesamten Anlageuniversums erfüllt werden können.

Kontakt

Thomas Drabek
Bayerische Vermögen AG
Arnulfstraße 39
80636 München

Telefon 089 / 179 246 510
Telefax 089 / 179 246 511

muenchen@bv-vermoegen.de
www.gmax-welt.de