

DAS INVESTIERTE KAPITAL IST RISIKEN AUSGESETZT UND EIN ANLEGER ERHÄLT DEN VON IHM ANGELEGTE BETRAG MÖGLICHERWEISE NICHT ZURÜCK.

PRESSEMITTEILUNG

(Nicht zur Veröffentlichung in den Vereinigten Staaten von Amerika)

SOURCE UND ROTHSCCHILD FÜHREN ERSTEN EQUAL-RISK-ETF IN EUROPA EIN

London, den 20. Januar 2015: Die Investmentgesellschaft Source, einer der führenden Anbieter von Exchange Trades Products („ETPs“) in Europa, und Risk Based Investment Solutions („RBIS“), eine hundertprozentige Tochtergesellschaft von Rothschild, legen den europaweit ersten Equal-Risk-ETF auf: den Source R Equal-Risk European Equity UCITS ETF.

Hierbei handelt es sich um das erste Produkt von Rothschild, das über eine ETF-Struktur angeboten wird. Der Fonds zielt darauf ab, ein breites Engagement in europäischen Aktien zu ermöglichen, das eine geringere Volatilität aufweist als traditionelle, nach Marktkapitalisierung gewichtete Anlagen.

„Während es unzählige Möglichkeiten gibt, Portfoliopositionen und deren Gewichtung zu bestimmen, ist bei den meisten traditionellen Methoden das Anlagerisiko letztlich nur ein zufälliges Ergebnis dieses Auswahlprozesses“, erklärt Herve Foucault, Managing Director, Business and Product Development bei RBIS. „Indem das Risiko als Input verwendet wird, stellt der R Risk-Based European Equity Index diesen Prozess gewissermaßen auf den Kopf.“

Zur Konstruktion des Index werden sowohl die jeweilige Volatilität der 250 größten Aktien aus 18 europäischen Ländern als auch die Korrelation zwischen Aktien bewertet, um die riskantesten 50 Prozent der Aktien systematisch zu eliminieren.¹ Die verbleibenden 125 Aktien werden so gewichtet, dass jede Aktie einen gleich großen Risikobeitrag leistet. Der Index wird vierteljährlich überprüft und monatlich umgeschichtet.

„Smart-Beta-Fonds stoßen auf ein zunehmendes Interesse, da die Anleger an alternativen Renditequellen und Investmentchancen interessiert sind, um ihre Portfoliorisiken zu reduzieren“, sagt Michael John Lytle, Chief Development Officer bei Source. „Wir sind hoch erfreut, mit Rothschild bei diesem Vorreiterprodukt zusammenarbeiten zu können. Diese Art der Risikoreduktion ist der nächste Schritt, der den bestehenden Volatility Target- und Minimum Variance-Strategien folgt. Gemäß Simulationen von RBIS erzielte der R

¹ Die Hälfte der Aktien, welche die höchste Risikobewertung aufweisen, wird aus dem Index ausgeschlossen.

Equal-Risk European Equity Index in den vergangenen fünf Jahren eine bessere risikobereinigte Performance als die breiten europäischen Aktienindizes.“

Der ETF ist in EUR an der Deutschen Börse (XETRA) und in GBP an der London Stock Exchange erhältlich.

PRODUKTMERKMALE

| | | |
|----------------------------------|---|--------------|
| Produktname | Source R Equal-Risk European Equity UCITS ETF | |
| Benchmark | R Risk-Based European Equity Index | |
| Börsennotierung | London Stock Exchange | Xetra |
| ISIN-Code | DE000A13PG83 | DE000A13PG75 |
| Basis- und Handelswährung | EUR/GBP | EUR/EUR |
| Bloomberg (Ticker) | REQR LN | REQR GY |
| Reuters (Ticker) | REQR.L | SOREQR.DE |
| Verwaltungsgebühr | 0,48 % p.a. | |
| Fondsdomizil | Irland | |

Wichtige Informationen:

Emissionsprospekte und begleitende Dokumentationen, welche die Produktdetails, Risiken und Kosten von Source-Produkten erläutern, sind für die Landesregionen, in denen die Produkte zum Verkauf zugelassen sind, unter www.source.info abrufbar.

Die in dieser Publikation beschriebenen Produkte sind nicht für jedermann geeignet. Das Kapital der Investoren ist Risiken ausgesetzt, und sie erhalten möglicherweise weniger zurück, als sie eingesetzt haben. Anleger sollten nicht in diese Produkte investieren, wenn sie ihr Wesen und das Risiko nicht verstehen. Der Wert dieser Produkte kann sowohl fallen als auch steigen aufgrund von Faktoren wie Preisänderungen des Basiswertes und/oder Schwankungen der Zinssätze. Es wird empfohlen, dass potenzielle Investoren die relevanten Produktprospekte lesen, bevor Sie investieren.

ENDE

Für weitere Informationen:

Source

Sascha Specketer

Tel: +44 20 3370 1108

sascha.specketer@source.info

RBIS

Herve Foucault

Tel: +44 20 7280 5670

herve.foucault@rothschild.com

ergo Kommunikation

Thomas Luther

Tel: +49 221 912 887 21

thomas.luther@ergo-komm.de

Über Source

Source zählt mit einem verwalteten Vermögen von circa 18 Milliarden US-Dollar zu den führenden Anbietern von Exchange Traded Products (ETPs) in Europa. Seit dem Markteintritt im Jahr 2009 ist es das Ziel von Source, europäischen Investoren ETFs und andere ETPs anzubieten, die ihnen durch eine Kombination aus innovativen Indizes, starken Partnerschaften, verbesserten Strukturen und aktivem Handel einen Mehrwert bieten. Aus diesem Grunde sieht es Source als seine Verpflichtung an, ETPs auf den Markt zu bringen, die einzigartig sind – mit hoher Liquidität, hohen Transparenzstandards und reduziertem Kontrahentenrisiko. Die Produktpalette von Source umfasst derzeit fast 80 Exchange Traded Funds (ETFs) und Exchange Traded Commodities (ETCs) aus den Asset-Klassen Aktien, Fixed Income, Alternatives und Rohstoffe. Weitere Informationen über Source finden Sie unter www.source.info.

Über Rothschild

Rothschild ist eines der weltweit größten unabhängigen Corporate Finance Beratungshäuser und beschäftigt rund 2.800 Mitarbeiter in 40 Ländern. Die Rothschild Gruppe umfasst vier wesentliche Geschäftsbereiche: Global Financial Advisory, Wealth Management & Trust, Merchant Banking und Institutional Asset Management, das die Risk Based Investment Solutions Ltd („RBIS“) einschließt.

Rothschild ist familiengeführt und unabhängig und ist seit über 200 Jahren im Zentrum des Geschehens an den weltweiten Finanzmärkten aktiv. Ausgehend von den historischen Wurzeln in Europa hat Rothschild eine einzigartige globale Aufstellung entwickelt. Heute verfügt Rothschild über ein umfassendes globales Beratungsgeschäft, unter anderem mit von lokalen Mitarbeitern besetzten Büros in China, Brasilien, Indien, den Vereinigten Staaten von Amerika, dem Mittleren Osten und der Asien-Pazifik-Region. Insgesamt verwaltet die Rothschild Gruppe Vermögenswerte von mehr als 42 Milliarden Euro.