

### **Research Enhanced Indexing – Jeder Basispunkt zählt**

Wie die Vorteile von aktivem Management und passivem Investieren miteinander kombiniert werden können, um den sich ändernden Bedürfnissen der Anleger gerecht zu werden.

Genau wie passive Fonds bleibt ein Research-Enhanced-Index-Fonds jederzeit nahezu vollständig investiert, wobei die Exposures hinsichtlich Regionen, Sektoren und Stilen im Vergleich zum Index ständig überwacht werden, um einen konstant niedrigen Tracking-Error zu gewährleisten. Im Gegensatz zu passiven Fonds kann ein erweiterter Index nach einer konstanten Alpha-Generierung streben, wobei er sich auf ein hohes Information-Ratio stützen und die besten Ideen eines Teams von Fundamentalresearch-Analysten nutzen kann. Das Ergebnis ist ein Fonds, der in der Lage ist, bei geringem aktivem Risiko positives Alpha zu liefern. Darüber hinaus kann ein aktives Management dazu beitragen, auf die sich ändernden Bedürfnisse der Anleger einzugehen, z. B. durch die Berücksichtigung zusätzlicher ESG-Aspekte.

### **In diesem Workshop werden wir uns mit folgenden Fragen befassen:**

- Wie ist es möglich, bei einer herkömmlichen Anlage in einem Index Alpha zu generieren?
- Welche Auswirkungen kann aktives Management auf das Risikoprofil haben?
- Wie kann die Erweiterung eines Index weitere ESG-Vorteile bringen?

**Christian Preussner**, Managing Director, ist ein Mitglied der US Equity Group und leitet das International Investment Specialist Team. Seit 2004 ist er bei J.P. Morgan Asset Management tätig. Als Produktspezialist für US-Aktien betreute er institutionelle Kunden in der Schweiz, Deutschland und Österreich und unterstützt den Vertrieb an die verschiedenen Vertriebskanäle im deutschsprachigen Raum. Der Absolvent der European Business School, Oestrich Winkel, hält ein Diplom in Business Administrations und ist CFA-Charterholder.

### **Kontaktdaten:**

Kontakt: Ivan Durdevic  
Tel.: +41 44 206 86 26  
E-Mail: [ivan.durdevic@jpmorgan.com](mailto:ivan.durdevic@jpmorgan.com)  
Webseite: [www.jpmorganassetmanagement.ch](http://www.jpmorganassetmanagement.ch)