

## MEDIENMITTEILUNG

London, 9 Juli 2024

### **Lombard Odier Investment Managers lanciert marktneutrale DataEdge-Strategie**

*Strategie nutzt Big Data zu Verbrauchertrends, um Gewinnüberraschungen zu erkennen und Alphanpotenzial auszuschöpfen*

---

Lombard Odier Investment Managers („LOIM“) gibt heute die Lancierung der DataEdge-Strategie bekannt. Die marktneutrale Alternatives-Strategie kombiniert die Analyse grosser Datenmengen mit systematischer Anlageerfahrung, um Trends im Verbraucherverhalten und deren Auswirkungen auf die Gewinnprognosen von Unternehmen zu erkennen. Ziel ist es, für die Anlegerinnen und Anleger Alpha-Chancen zu nutzen.

DataEdge von LOIM ist eine marktneutrale Aktien-Strategie mit differenziertem Anlagerahmen, die Alpha-Potenzial mithilfe eines „Informationsvorsprungs“ bei der Aktienauswahl aufspürt.

Die vor drei Jahren aufgelegte Strategie ist nun erstmals in Form eines UCITS für externe Anlegerinnen und Anleger zugänglich.

Sie setzt auf die Analyse alternativer Datenpunkte über mehrere Regionen, Sektoren und Quellen hinweg. Dazu zählen Kreditkartentransaktionen, digitale Belege, Internetverkehr, Aktivitäten in Apps sowie Geolokalisierungsdienste. Durch Strukturierung und Filterung dieser Daten ist es möglich, Trends im Verbraucherverhalten in Echtzeit zu erkennen.

Systematische und quantitative Analysemethoden sollen helfen vorherzusagen, wie bestimmte Muster die Leistungskennzahlen (KPI) börsenkotierter Unternehmen – wie etwa Umsatz, Einnahmen und Neukunden – beeinflussen könnten. Darüber hinaus sollen sie die Verfolgung von Wendepunkten in den KPI-Trends über mehrere Quartale ermöglichen. Dieser „Informationsvorsprung“ erlaubt eine bessere Prognose der Unternehmensergebnisse, um Gewinnüberraschungen besser vorhersagen und Alpha-Potenzial nutzen zu können.

Das Anlageuniversum konzentriert sich aktuell auf die USA. Schwerpunkte sind vor allem Small- und Mid Cap-Unternehmen aus den Sektoren Konsumgüter, Technologie, Industrie und Gesundheitswesen. Die Strategie überwacht täglich fast 700 Unternehmen, um ein konträres, diversifiziertes Portfolio mit 200 bis 250 aktiven Aktienpositionen zu erstellen. Bei diesen Titeln halten wir Abweichungen der Unternehmensergebnisse von den Markterwartungen für sehr gut möglich, sodass Alpha-Potenzial besteht.



## LOMBARD ODIER

INVESTMENT MANAGERS

Verantwortlich für die DataEdge-Strategie sind die Co-Lead Portfolio Manager Laurent Joué und Marc Pellaud, die gemeinsam 36 Jahre Erfahrung mit systematischen Alternatives-Strategien besitzen. Sie arbeiten eng mit den 21 Experten des quantitativen Anlageteams von LOIM zusammen, die ein Anlagevermögen von insgesamt über USD 10 Mrd. verwalten.

**Jean-Pascal Porcherot, Co-Head von LOIM und Managing Partner bei Lombard Odier:** „Die DataEdge-Strategie ist eine wichtige Ergänzung der Hedge Fund-Strategien von LOIM. Sie hebt die umfassenden Fähigkeiten und das Know-how hervor, die in unser systematisches Angebot einfließen. Sie zeigt auch, dass wir fortlaufend nach neuen Möglichkeiten Ausschau halten, in den verschiedenen Anlageklassen Alpha zu generieren. In der DataEdge-Strategie verbinden wir bewährte, disziplinierte Anlageprozesse mit neuen Datenquellen, um Anlegerinnen und Anlegern eine differenzierte, marktneutrale Strategie und attraktive potenzielle Erträge zu bieten.“



### Über Lombard Odier IM

Lombard Odier Investment Managers (LOIM) ist die Vermögensverwaltungssparte der Lombard Odier Gruppe, die sich seit 1796 im alleinigen Besitz ihrer Teilhabenden befindet.

Wir bieten einer vielfältigen Gruppe langfristig orientierter Kundinnen und Kunden eine Reihe von Anlagelösungen an. Wir blicken auf eine langjährige Geschichte zurück und vereinen das Beste aus konservativer Einstellung und Innovation. Damit sind wir gut aufgestellt, um beständige Werte für unsere Kundinnen und Kunden zu schaffen. Unsere Anlagekompetenz umfasst Anleihen, Wandelanleihen, Aktien, Multi-Asset-Anlagen und alternative Anlagen. Nachhaltigkeit ist ein zentraler Aspekt unserer Anlagephilosophie. Sie ist für uns die Grundlage langfristiger Wirtschafts- und Anlageergebnisse und wird auf lange Sicht die Renditen bestimmen.

Mit 209 Anlageexpertinnen und -experten sind wir ein globales Unternehmen mit einem Netzwerk von 13 Niederlassungen in Europa, Asien und Nordamerika. Wir verfügen über ein verwaltetes Vermögen von USD 70 Mrd. (Stand: 31. Dezember 2023).

Weitere Informationen finden Sie unter: [www.lombardodier.com/de](http://www.lombardodier.com/de)

**Celeste Herriger**

Head of PR, Lombard Odier Investment Managers

+41 (0) 44 214 1426

[C.Herriger@lombardodier.com](mailto:C.Herriger@lombardodier.com)



# LOMBARD ODIER

INVESTMENT MANAGERS

## Wichtige Informationen:

Dieses Dokument wird von Lombard Odier Asset Management (Europe) Limited herausgegeben, einer von der britischen Finanzaufsichtsbehörde FCA zugelassenen und regulierten Gesellschaft. Diese ist unter der Registernummer 515393 im FCA-Register eingetragen.

Lombard Odier Investment Managers („LOIM“) ist ein Markenname.

Dieses Dokument dient ausschliesslich Informationszwecken und stellt weder ein Angebot noch eine Empfehlung zum Kauf oder Verkauf eines Wertpapiers oder einer Dienstleistung dar. Es ist nicht für die Weitergabe, Veröffentlichung oder Verwendung in Rechtsordnungen bestimmt, in denen eine solche Weitergabe, Veröffentlichung oder Verwendung rechtswidrig wäre. Dieses Dokument enthält keine personalisierten Empfehlungen oder personalisierte Beratung und ersetzt keinesfalls eine professionelle Beratung zu Anlagen in Finanzprodukten. Anlegerinnen und Anleger sollten vor Abschluss eines Geschäfts die Eignung einer Transaktion für ihre besonderen Umstände sorgfältig prüfen. Falls erforderlich, sollten sie zudem unabhängigen professionellen Rat in Bezug auf Risiken sowie auf etwaige rechtliche, regulatorische, kreditrechtliche, steuerliche und buchhalterische Konsequenzen einholen. Dieses Dokument ist Eigentum von LOIM und wird den Empfängern ausschliesslich zum persönlichen Gebrauch überlassen. Ohne vorherige schriftliche Genehmigung von LOIM darf es weder ganz noch teilweise vervielfältigt, übermittelt, verändert oder zu anderen Zwecken verwendet werden. Dieses Dokument gibt die Einschätzungen von LOIM zum Datum seiner Veröffentlichung wieder.

Weder das vorliegende Dokument noch Kopien davon dürfen in die USA, in die Gebiete unter der Hoheitsgewalt der USA oder in die der Rechtsprechung der USA unterstehenden Gebiete versandt, dorthin mitgenommen, dort verteilt oder an US-Personen bzw. zu deren Gunsten abgegeben werden. Als US-Person gelten zu diesem Zweck alle Personen, die US-Bürger oder -Staatsangehörige sind oder ihren Wohnsitz in den USA haben, alle Personengesellschaften, die in einem Bundesstaat oder Gebiet unter der Hoheitsgewalt der USA organisiert sind oder bestehen, alle Kapitalgesellschaften, die nach US-amerikanischem Recht oder dem Recht eines Bundesstaates oder Gebiets, das unter der Hoheitsgewalt der USA steht, organisiert sind, sowie alle in den USA ertragsteuerpflichtigen Vermögensmassen oder Trusts, ungeachtet des Ursprungs ihrer Erträge.

Quelle der Zahlen: Sofern nicht anders angegeben, wurden die Zahlen von LOIM erstellt.

Bestimmte Informationen stammen zwar aus öffentlichen Quellen, die als zuverlässig angesehen werden. Ohne eine unabhängige Überprüfung können wir die Richtigkeit oder Vollständigkeit aller aus öffentlichen Quellen verfügbaren Informationen jedoch nicht garantieren.

Die hierin geäusserten Ansichten und Einschätzungen dienen ausschliesslich Informationszwecken und stellen keine Empfehlung von LOIM zum Kauf, Verkauf oder Halten von Wertpapieren dar. Die Ansichten und Einschätzungen entsprechen dem Stand zum Zeitpunkt dieses Dokuments und können sich ändern. Sie sind nicht als Anlageberatung auszulegen.

Dieses Dokument darf ohne vorherige Genehmigung von Lombard Odier Asset Management (Europe) Limited weder vollständig noch auszugsweise (i) kopiert, fotokopiert oder in irgendeiner Form oder mit irgendwelchen Mitteln vervielfältigt oder (ii) an Personen weitergegeben werden, die nicht Mitarbeitende, leitende Angestellte, Verwaltungsratsmitglieder oder bevollmächtigte Vertreter des Empfängers sind. Im Vereinigten Königreich gilt dieses Dokument als Marketingmaterial und wurde durch Lombard Odier Asset Management (Europe) Limited genehmigt, die von der Financial Conduct Authority zugelassen ist und von dieser beaufsichtigt wird.

©2024 Lombard Odier IM. Alle Rechte vorbehalten.