

Auszeichnung als „**Top Fondsmanager**“ für europäische Aktien vom Handelsblatt Research Institute

April 2024

Die europäische Aktienstrategie von Quoniam mit Fondsmanagerin Dr. Lisa Herr wird unter 61 gelisteten Fonds als Top Fondsmanager ausgezeichnet.

Für eine Auszeichnung zum Top Fondsmanager mussten die Kandidatinnen und Kandidaten im Scope-Ranking über drei Jahre eine Top-50-Platzierung aufweisen. Zusätzliche Bedingungen waren gute Bewertungen bei den Fonds-Ratingagenturen Citywire, Morningstar und Scope sowie positive Erwähnungen bei 120 Fondsgesellschaften.



Dr. Lisa Herr
Portfolio Management Equities

„Dieser Fonds bringt unser Alpha-Potenzial am besten auf die Straße. Von Research über Konstruktion bis hin zum Handel.“



Dr. Lisa Herr ist seit Februar 2016 Fondsmanagerin im Bereich Europäische Aktienstrategien. Vor ihrer Tätigkeit bei Quoniam war sie u. a. wissenschaftliche Mitarbeiterin bei der GSI in Darmstadt und Consultant. Lisa absolvierte ihren Bachelor und Master in Physik an der Johann Wolfgang Goethe-Universität. Ihre Promotion in Physik schloss sie an der TU Darmstadt ab.

Strategiebeschreibung

- Aktives Aktien-Investment mit dem Ziel, ein attraktives Alpha gegenüber der Benchmark zu erwirtschaften.
- Alpha-Maximierung durch gezielte Titelselektion auf Grundlage täglicher fundamentaler Unternehmensbewertung des europäischen Aktienuniversums (mehr als 3.000).
- Erhöhtes Renditepotenzial und verbesserte Diversifikation gegenüber der Benchmark durch die Beimischung ausgewählter Small- und Mid-Caps-Titel.
- Marktähnliches Gesamtrisiko durch risikokontrollierte Portfoliokonstruktion.
- Artikel-8-Konformität gemäß OffVO durch Nutzung des Quoniam Enhanced Nachhaltigkeitsansatzes, mit aktivem Fokus auf Steuerung des ESG-Scores sowie CO₂-Reduktion gegenüber der Benchmark.

Über Quoniam

Quoniam bietet institutionellen Kunden weltweit einen Mehrwert durch Innovation und einen wissenschaftlich fundierten, nachhaltigen Investmentansatz in den Assetklassen Aktien, Renten und Multi-Asset. Quoniam wurde 1999 gegründet und die Idee von damals treibt uns bis heute an: die einzigartige Kombination aus wissenschaftlicher Methodik, technologischem Vorsprung und profunder Kapitalmarktexpertise.

Mit unseren eigens entwickelten quantitativen Analysemethoden können wir mehr als 50.000 Finanzinstrumente bewerten und unsere Kunden profitieren von globalen Anlageuniversen. Durch unseren datengetriebenen, systematischen Ansatz können Mandate in Bezug auf Auswahluniversen, Bonitätsklassen, Währungen, Laufzeitbänder, Portfolio- und Risikokennzahlen sowie Nachhaltigkeitskriterien individuell angepasst werden.

QFS SICAV – European Equities EUR I dis

Stand: 30. April 2024

Die quantitative Anlagestrategie European Equities kombiniert die Faktoren Value, Quality und Sentiment mit dem Ziel, ein ausgewogenes Verhältnis von niedrigem Tracking Error und Überrendite zu erreichen. Das Anlageuniversum umfasst mehr als 3.000 europäische Aktien.

Basisinformationen

ISIN	LU1120174377
Anlageklasse	Aktien
Bloomberg	QEUREUI
Region	Europa
Fondswährung	EUR
Ertragsverwendung	Ausschüttend
Auflegungsdatum (Anteilsklasse)	28.11.2014
Währungsgesichert	Nein
Valuta	T+3 (Forward Pricing)

Annualisierte Performance (netto)

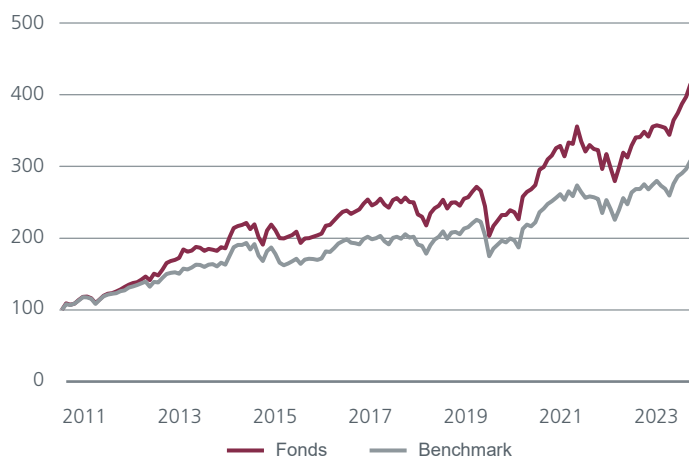
	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	Seit Auflage
Fonds	19,60	11,70	10,46	12,01
MSCI Europe	10,98	8,15	7,80	9,27

Performance-Kennzahlen

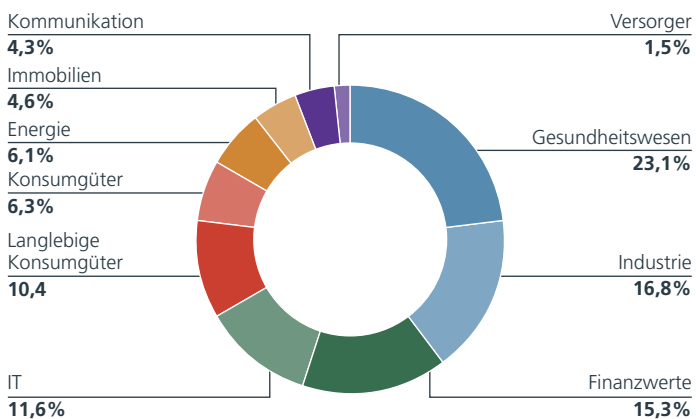
Kennzahl	Fonds
Sharpe Ratio	0,83
Volatilität	14,19
Tracking Error	3,62
Information Ratio	1,01
Beta	1,09
VaR (99%/10)	4,41

Kapitalverwaltungsgesellschaft	Union Investment Luxembourg S. A.
Verwahrstelle	DZ-PRIVATBANK S.A.
Laufende Kosten	0,70 % (30.09.2023)
Verwaltungsvergütung	0,60 % p.a.
Pauschalvergütung	0,12 % p.a.
Zugelassen in	LU, DE, GB, FI, SE, NO, AT, FR, NL
Nachhaltigkeit	Artikel 8 OffVO
Volumen Gesamtfonds	143,80 Mio. in EUR
Anteilspreis	1.833,91 in EUR

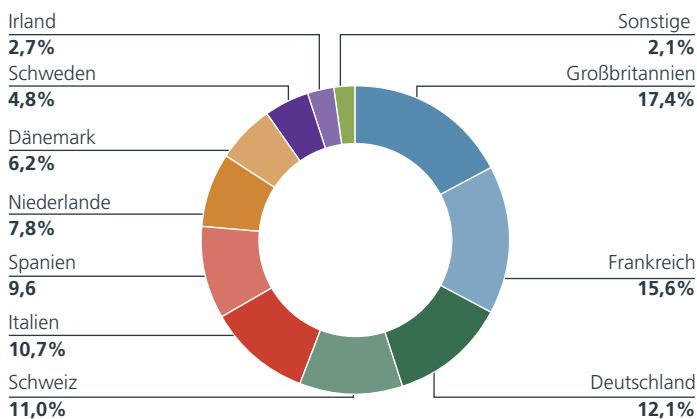
Absolute Performance (netto)



Branchenallokation



Länderallokation



Portfolio-Kennzahlen

Kennzahl	Fonds
Dividendenrendite (%)	3,33
Eigenkapitalrendite (%)	22,05
Kurs/Buchwert	1,59
Kurs/Gewinn	10,58
Marktkapitalisierung (Streubesitz, Mrd.)	77,2
Preis/Cash-Flow	6,99
Anzahl Titel	297

Top 10 Wertpapiere

Name	Gewicht (%)
NOVO NORDISK A/S-B	4,88
NOVARTIS AG-REG	2,84
HSBC HOLDINGS PLC	2,32
SAP SE	2,21
BNP PARIBAS	2,21
UNIPOL GRUPPO SPA	2,10
ABB LTD-REG	2,07
ASML HOLDING NV	2,06
GSK PLC	2,03
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2,02

Rechtlicher Hinweis

Sowohl die Inanspruchnahme von Wertpapierdienstleistungen als auch die Investition in Finanzinstrumente ist mit Risiken verbunden. Ausführliche Informationen und Hinweise zu Chancen und Risiken finden Sie auf www.quoniam.com/risikohinweis

Dieses Dokument wurde von der Quoniam Asset Management GmbH (nachfolgend „Quoniam“) mit größter Sorgfalt und nach bestem Wissen und Gewissen erstellt und dient ausschließlich Informationszwecken und der Nutzung durch den Empfänger. Die geäußerten Meinungen, Einschätzungen oder Informationen sind diejenigen von Quoniam bzw. stammen aus allgemein zugänglichen Quellen. Sie beziehen sich auf den Zeitpunkt der Erstellung und können sich jederzeit und ohne Mitteilung ändern. Für den Inhalt, die Vollständigkeit und die Aktualität der vorstehenden Angaben wird keine Gewähr übernommen.

Dieses Dokument richtet sich ausdrücklich nicht an Privatkunden im Sinne des § 67 Abs. 3 Wertpapierhandelsgesetz. Es handelt sich hierbei grundsätzlich um eine Marketingunterlage, die ausschließlich Werbezwecken dient. Ausgenommen hiervon sind Dokumente, die für Anlageausschusssitzungen oder zur Erfüllung vertraglicher Verpflichtungen (z. B. Reporting) erstellt wurden. Wir weisen ausdrücklich darauf hin, dass es sich hierbei nicht um eine Vermögensaufstellung nach investimentrechtlichen Vorgaben handelt. Dem Empfänger wird empfohlen, sich an die jeweilige Kapitalverwaltungsgesellschaft zu wenden.

Ausführliche produktspezifische Informationen und Hinweise zu Chancen und Risiken für die genannten Fonds entnehmen Sie bitte dem aktuellen Verkaufsprospekt, den Anlagebedingungen, den wesentlichen Anlegerinformationen sowie den Jahres- und Halbjahresberichten, die Sie kostenlos in deutscher und englischer Sprache bei der deutschen Zahl- und Informationsstelle, der DZ BANK AG (Frankfurt am Main), erhalten. Diese Dokumente bilden die allein verbindliche Grundlage für den Kauf der Fonds.

Das Dokument berücksichtigt nicht die persönlichen sowie finanziellen Verhältnisse des Empfängers und stellt weder ein Angebot noch eine Handlungsempfehlung zum Erwerb

oder Verkauf von Finanzinstrumenten oder Wertpapierdienstleistungen dar. Angegebene frühere Wertentwicklungen, Simulationen oder Prognosen sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. In jedem Fall wird dem Empfänger empfohlen, im Rahmen einer individuellen Anlageberatung die Geeignetheit in Bezug auf seine persönlichen Verhältnisse prüfen zu lassen.

Die enthaltenen Informationen und Meinungen sind nicht als unabhängige Finanzanalyse anzusehen, da diese nicht den gesetzlichen Anforderungen zur Gewährleistung der Unvoreingenommenheit und dem Verbot des Handels vor deren Veröffentlichung genügen.

Diese Informationen dürfen weder in Auszügen noch als Ganzes ohne die schriftliche Genehmigung von Quoniam vervielfältigt oder an andere Personen weitergegeben werden. Quoniam verfügt über eine Erlaubnis zum Erbringen von Finanzdienstleistungen und untersteht der Aufsicht der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht.

Quoniam verarbeitet Ihre personenbezogenen Daten, insbesondere Name, Geschlecht, Adresse, Telefonnummer, berufliche Position, ausschließlich im Rahmen der geschäftlichen Korrespondenz. Rechtsgrundlage ist Art. 6 Abs. 1 lit. b) und f) DSGVO. Verantwortliche im Sinne des Art. 4 Nr. 7 DSGVO ist die Quoniam Asset Management GmbH, Westhafenplatz 1, 60327 Frankfurt am Main. Weitergehende Informationen finden Sie in unserem Datenschutzhinweis unter „Rechtliche Hinweise“ auf unserer Webseite. Sie möchten keine weiteren Informationen von Quoniam erhalten? Senden Sie bitte eine kurze E-Mail an dataprotection@quoniam.com

2024 © Quoniam Asset Management GmbH. Alle Rechte vorbehalten.