

Quoniam

Quoniam Asset Management GmbH

Adresse: Westhafen Tower, Westhafenplatz 1
60327 Frankfurt am Main

Tel.: +49 (0)69/74 384-0

Website: www.quoniam.com

Teamgröße: 135 Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter
(institutioneller Bereich)

Ansprechpartner für das institutionelle Geschäft:

Thomas Brose
Geschäftsführung
+49 (0)69/74 384-122
thomas.brose@quoniam.com

Andreas Herrmann
Head of Client Relations Deutschland
+49 (0)69/74 384-117
andreas.herrmann@quoniam.com

Unternehmensüberblick/Kurzbeschreibung:

Quoniam ist ein aktiver quantitativer Asset Manager, gegründet in Frankfurt am Main. Seit über 20 Jahren setzen wir unsere Investmentphilosophie erfolgreich um. Unser Ziel ist es, auf Grundlage unseres wissenschaftlichen Ansatzes, unserer technologischen Expertise und Erfahrung erstklassige Performanceergebnisse für unsere institutionellen Anleger weltweit zu generieren. Als partnergeführtes Unternehmen mit mehr als 130 Mitarbeiterinnen und Mitarbeitern in Frankfurt und London managen wir rund 28 Milliarden Euro in Aktien-, Renten- und Multi-Asset-Strategien. Basis unseres Erfolgs ist die effiziente Verarbeitung der zunehmenden Daten- und Informationsmenge an den Kapitalmärkten und deren Überführung in belastbare Anlageentscheidungen. Wir operieren unabhängig und schaffen so den notwendigen Freiraum für innovative Lösungen. Durch unsere Zugehörigkeit zur Union Investment Gruppe ruhen unsere unternehmerischen Freiheiten gleichzeitig auf einem soliden finanziellen Fundament. Wir möchten Mehrwert für unsere Kundinnen und Kunden schaffen und einen positiven Beitrag für die Gesellschaft leisten. Quoniam bekennt sich zu den Principles for Responsible Investment und hat das Ziel, die Akzeptanz nachhaltigen Investierens global zu stärken.

Im deutschsprachigen Markt aktiv seit: 1999

Mitgliedschaften in Verbänden:

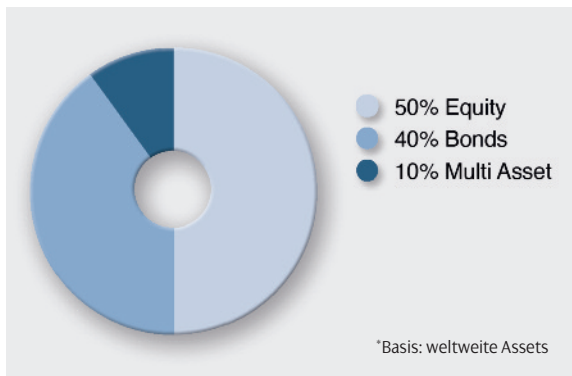
- BVI BAI EFAMA
 Andere: UN PRI, The Investment Association (UK)

Assets under Management in Zahlen (in Mio. Euro):

27.657 AuM weltweit
26.706 AuM europäische Kunden
22.492 AuM deutsche Kunden
22.492 AuM institutionelle Kunden Deutschland

(Daten zum 30. November 2021)

Assets under Management nach Assetklassen* (in %):



Angebote Investmentvehikel:

- Spezialfonds/Segmentfonds
 Publikumsfonds (OGAW/UCITS)
 Strukturen/Zertifikate
 Closed-End-Funds

Services:

- Advisory/Sub-Advisory
 Master-KVG/KVG
 Depotbank Operations
 Asset Allocation (SAA/TAA/GTAA)
 Research
 Overlay Management
 Liability Management
 Risk Management
 Andere: Finanzportfolioverwaltung

Performancemessung/-verifizierung:

- Intern Extern: GIPS

Angebotene Assetklassen:

1. Equity

Style	Regionen	Global	Europe	Germany	U.S.	Japan	Asia, Pacific	Emerging Markets	Andere
Aktiv / Passiv (auch ETFs)		X/-	X/-	X/-	X/-	X/-	X/-	X/-	-/-
Quantitativ/Qualitativ		X/-	X/-	X/-	X/-	X/-	X/-	X/-	-/-
Small Cap Large Cap		X/X	X/X	X/X	X/X	X/X	X/X	X/X	-/-
Growth/ Value		-/-	-/-	-/-	-/-	-/-	-/-	-/-	-/-
Absolute/ Relative Return		-/X	-/X	-/X	-/X	-/X	-/X	-/X	-/-
Factor Investing		X	X	X	X	X	X	X	-
ESG-Ansatz/ Impact Investing		X/-	X/-	X/-	X/-	X/-	X/-	X/-	-/-
Andere: Multi Factor Investing		X	X	X	X	X	X	X	-

2. Bonds

Style	Regionen	Global	Europe	Germany	U.S.	Japan	Asia, Pacific	Emerging Markets	Andere
Staatsanleihen		X	X	X	X	X	X	X	-
Corporate Bonds		X	X	X	X	X	X	X	-
High Yield		X	X	X	X	X	X	X	-
Convertible Bonds		-	-	-	-	-	-	-	-
Absolute Return Strategien		X	X	X	X	X	X	X	-
Inflation Linked Strategien		-	-	-	-	-	-	-	-
Geldmarktstrategien		-	-	-	-	-	-	-	-
ESG-Ansatz bzw. Impact Investing		X	X	X	X	X	X	X	-
Andere: Multi Factor Investing		X	X	X	X	X	X	X	-

3. Alternative Investmentlösungen

- Balanced (Outperformance gegenüber gemischter Aktien- und Renten-Benchmark)
- Global Risk Premia (Investments in globale Risikoprämien/Betas)
- MinRisk Protect (Wertsicherungskonzept mit Aktien und Renten)
- Multi-Asset Global Data Sentiment (Generierung von Makro-Prognosen mit alternativen Daten)
- Tactical Asset Allocation (Steuerung der Aktien- und Rentenquote nach einem proprietären Bewertungsmodell)

Erläuterung zu den angegebenen Produkten bzw. Strategien:

Neue Ertragsquellen und Stildiversifikation spielen für institutionelle Anleger eine immer größere Rolle. Quoniam verbindet Wissenschaft und Technologie, um diversifizierende Anlegestile zu bieten. Unsere Mandate und Portfoliolösungen berücksichtigen die spezifischen Richtlinien professioneller Investoren – zu Investmentuniversum, Risikobudgets und der Umsetzung von ESG-Kriterien.

In unseren Aktien-Strategien kombinieren wir Faktorstile wie Value, Qualität und Momentum. Dabei stehen die mittel- und langfristige Diversifikation und Ausgewogenheit im Vordergrund. Unser Ansatz zielt auf Aktien, die hohe Qualität mit einem attraktiven Preis verbinden. Auch bei Anleihen bietet unser Multifaktor-Ansatz eine größere Diversifikation im Vergleich zu traditionellen fundamentalen Managern – in Bezug auf das Universum sowie das Risiko- und Ertragsprofil. Dank unserer über 15-jährigen Erfahrung spiegelt unser Fixed Income Factor Investing die Lernkurve über verschiedene Marktzyklen wider.

Bei unseren individuellen Lösungen im Bereich Multi-Asset reicht das Spektrum von Wertsicherungsmandaten über Anlagen gemäß Solvency II bis hin zu Total-Return-Strategien basierend auf unstrukturierten Daten.

Erläuterungen zu Research/Investmentprozess:

Hinter allen Quoniam-Strategien steht unser modellbasierter quantitativer Investmentprozess. Er ermöglicht es uns, Risiken und Renditequellen für alle Portfoliobestandteile auf Basis von Faktoren zu berechnen. Für alle Aktien, Anleihen und Derivate hat Quoniam regional spezialisierte Prognosemodule entwickelt, anhand derer täglich die Erträge und Risiken für über 50.000 Titel ermittelt werden.

Die Prognosen berücksichtigen Faktoren, die ökonomisch plausibel und in ihrer Wirkung auf die Preisbildung statistisch signifikant sind. Alle Portfolios werden anhand eigener Risiko- und Ertragsprognosen in der Portfoliokonstruktion regelmäßig optimiert. So vermeiden wir Extreme und kontrollieren das Risiko.

Unsere Investment Professionals forschen täglich anhand von datengestützten Methoden nach neuen Ertragsquellen und wandeln sie in individuelle Lösungen für professionelle Anleger um. Dabei nutzen wir innovative Research-Technologien wie Machine Learning und Textanalyse.

Welche Rolle spielen ESG-Ansätze und -Faktoren in den Investmentansätzen?

Bei Quoniam sehen wir es als unsere Verantwortung an, Nachhaltigkeit mitzugestalten, weiterzuentwickeln und Socially Responsible Investing (SRI) auf einem hohen Standard zu erfüllen. Die Nachhaltigkeitsmodule Screening, Integration und Engagement ermöglichen es Investoren, ein ihren Anlagerichtlinien entsprechendes Portfolio nach nachhaltigen Kriterien aufzubauen und von Quoniam mit quantitativen Methoden aktiv verwalten zu lassen. Insgesamt managen wir rund 45 Prozent der Assets unter Berücksichtigung nachhaltiger Kriterien für unsere Kunden.

Welche Ziele stehen bei Ihnen 2022 im Vordergrund?

Im Jahr 2022 konzentrieren wir uns weiterhin auf die Erzielung verlässlicher Performanceergebnisse für unsere institutionellen Anleger und das Wachstum der Assets under Management. Einen weiteren Fokus legen wir auf die Weiterentwicklung unserer Nachhaltigkeitsstrategie und die kontinuierliche Steigerung der nachhaltig gemanagten Assets. Um diese Ziele zu erreichen, sind stetige Innovation, moderne Technologie und wissenschaftliche Expertise unabdingbar. Die kontinuierliche Förderung aller drei Aspekte in verschiedenen Projekten und Initiativen hat bei Quoniam auch 2022 höchste Priorität.

