

„Quant IP Global Innovation Leaders Fund“ erfolgreich gestartet

- Quant IP startet ersten Investmentfonds mit einem Anlagevolumen von über 3 Millionen Euro.
- Der *Quant IP Global Innovation Leaders Fund* investiert weltweit in Unternehmen mit der höchsten Innovationskraft
- Die regelbasierte Aktienauswahl erfolgt auf Basis des Quant IP Innovation Score
- White Paper in Kooperation mit US-Asset Manager O'Shaugnessy zeigt die Überlegenheit des Ansatzes mit Backtests bis zum Jahr 1990

München, 22. Juli 2019. Das Münchner Start-up Quant IP hat seinen ersten Investmentfonds gestartet. Der *Global Innovation Leaders Fund* investiert weltweit in Aktien von Unternehmen mit besonders hoher Innovationskraft, die auf Basis des von Quant IP entwickelten Quant IP Innovation Score ermittelt wird. Die Auswahl der Aktien und die Zusammenstellung des Fondsportfolios erfolgen rein regelbasiert. Grundlage ist eine Big-Data-Analyse von weltweit mehr als 130 Millionen Patentdokumenten.

„Patentdaten bieten Einblick in die technologischen Entwicklungen von morgen und die Zukunftsfelder, in die Unternehmen rund um den Globus investieren“, sagt Lucas von Reuss, Mitgründer und Geschäftsführer von Quant IP. „Uns ist es gelungen, auf Basis dieser Informationen eine regelbasierte Investmentstrategie zu entwickeln, die eine deutliche Outperformance gegenüber ihrem Vergleichsindex, dem MSCI World, zeigt. Mit unserem Fonds machen wir diese Strategie einem breiteren Investorenkreis zugänglich.“

In einem Backtest über 15 Jahre hat die Strategie vor Kosten im Schnitt jährlich über 3 Prozentpunkte mehr Rendite erwirtschaftet als der MSCI World. Auch risikoadjustiert hat sie signifikant bessere Werte erzielt als der Vergleichsindex.

Das Portfolio

Der Fonds investiert in Branchen, in denen die Unternehmen stark auf Forschung, Entwicklung und den Schutz der Innovationen durch Patente setzen. Das Universum reicht von der Chip- und Softwareindustrie über Pharmakonzerne bis hin zu klassischem Maschinenbau und dem Automobilsektor. Innerhalb dieser Branchen wird die relative Innovationskraft der einzelnen Unternehmen ermittelt. Für das Fondsportfolio werden schließlich diejenigen Aktien aus jeder Branche gekauft, die gemessen an ihrer Innovationskraft am attraktivsten bewertet sind. So ergibt sich derzeit ein Portfolio aus bis zu 120 Innovationsführern mit mindestens 5 Milliarden Dollar Marktkapitalisierung und einem Schwerpunkt in den Sektoren IT und Healthcare. Der regelbasierte Auswahlprozess wird vierteljährlich wiederholt und das Portfolio angepasst.

Fonds-Fakten:

Name: Quant IP Global Innovation Leaders Fund
ISIN: DE000A1J3AN1/ WKN: A1J3AN
Verwaltungsgebühr 1,05 Prozent pro Jahr
Mindestorder 500.000 Euro
Kapitalverwaltungsgesellschaft: Ampega
Verwahrstelle: Berenberg
Haftungsdach: Steinbeis & Häcker Vermögensverwaltung
Vertriebskooperation: GS&P Institutional Management GmbH

Das White Paper

Parallel zum Fondsstart veröffentlicht Quant IP ein White Paper, das in Zusammenarbeit mit der renommierten quantitativen US-Investmentgesellschaft [O'Shaughnessy Asset Management](#) entstanden ist. Backtests bis ins Jahr 1990 zeigen, dass Aktien patent-aktiver Unternehmen den Aktienmarkt risikoadjustiert outperformen. Das Paper arbeitet auch heraus, wie dieser Effekt mit dem Einsatz klassischer Faktoren noch gesteigert werden kann.

[Link zum Download](#)

Das Unternehmen

Die [Quant IP GmbH](#), Fondsiniciator des *Quant IP Global Innovation Leaders Fund*, ist ein Start-up aus München, das Innovationskraft quantifizierbar, vergleichbar und so für Investoren und Asset Manager nutzbar macht. Der proprietär entwickelte Quant IP Innovation Score zur Bewertung von Aktien hinsichtlich Ihrer Patent- und Innovationstätigkeit ist Basis des *Quant IP Global Innovation Leaders Fund*, wird für die Erstellung von Indizes lizenziert und Asset Managern zur Verfügung gestellt. Zum Gründerkreis gehören Patentanwalt Axel Stellbrink, Lucas von Reuss, ehemals Chefredakteur des *€uro Magazins*, und Professor Stefan Mittnik, Lehrstuhlinhaber für Finanzökonomie an der LMU München und Mitgründer des digitalen Vermögensverwalters Scalable Capital.