



## Quantitative Strategien

### Marktführer bei quantitativen Anlagen

Robeco hat europaweit eines der größten auf quantitative Strategien spezialisierten Teams und ist im Bereich quantitative Anlagen marktführend, da die Gesellschaft bereits seit den 1990er Jahren Portfolios ausschließlich mittels quantitativer Modelle verwaltet. Robeco Quantitative Strategies, das eng mit Akademikern und Analysten zusammenarbeitet, ist eine Gruppe von Experten aus den Bereichen Ökonometrie, Mathematik, Wirtschaft und Physik. Quantitative Modelle werden in enger Zusammenarbeit mit unseren Anlageteams entwickelt und ständig verbessert. Robeco verwaltet derzeit über 15,4 Mrd. EUR mittels quantitativer Strategien, wovon mehr als 12 Mrd. EUR auf quantitative Aktienstrategien und 3,4 Mrd. EUR auf quantitative Durationsstrategien entfallen (Stand: 31. März 2010).

### Aktiv gemanagte quantitative Aktienstrategien

Die quantitativen Aktienstrategien von Robeco verwenden proprietäre Aktienauswahlmodelle, die sich systematische Verhaltensmuster zunutze machen, indem sie in Industrie- und Schwellenländern Ineffizienzen auf dem Markt ausnutzen. Diese objektiven Tools trennen die besten von den schlechtesten Aktien anhand von verschiedenen Kriterien wie Bewertung, Momentum und Risiko. Robeco hat verschiedene innovative, auf diesen Modellen beruhende Strategien wie Active Quant Emerging Markets und Conservative Equity entwickelt.

### Aktiv gemanagte, festverzinsliche, quantitative Wertpapier-Strategien mit Durationsmanagement

Robecos festverzinsliche, quantitative Wertpapier-Strategien beruhen auf einem proprietären Durationsmodell, das die Zinsentwicklung auf den globalen Rentenmärkten vorhersagt. Robeco bietet auf Grundlage dieses Modells sowohl eine auf eine absolute Rendite als auch eine auf eine relative Rendite abzielende quantitative Durationsstrategie. Das Modell erzielt eine Outperformance mittels Durationspositionen, die Marktentwicklungen voraussehen, indem es rasch auf Veränderungen der Zinssätze und Marktbedingungen reagiert.

### Robeco Deutschland

Taunusanlage 17

60325 Frankfurt

**T** +49 (0)69 9590859

**F** +49 (0)69 9590850

**E** [service@robeco.de](mailto:service@robeco.de)

Quantitative Strategien sind ein Bereich der Robeco's Investment Strategies.