

## Pressemitteilung

### Künstliche Intelligenz – ACATIS Investment legt mit Universal-Investment den Aktienfonds ACATIS AI Global Equities auf

Frankfurt am Main, 5. Juli 2017

Im März 2017 legte ACATIS Investment für einen begrenzten Anlegerkreis den ersten in Deutschland zugelassenen globalen Publikumsfonds auf, dessen Aktienauswahl und Portfoliozusammensetzung zu 100 Prozent durch künstliche Intelligenz, also Artificial Intelligence (AI) erfolgen. Die Performance des Fonds seit Start lag gleichauf mit der des MSCI World bei einer leicht erhöhten Volatilität. Um diese innovative Anlagestrategie künftig auch ausländischen und privaten Investoren anbieten zu können, startet ACATIS zusammen mit Universal-Investment einen weiteren künstliche Intelligenz Fonds, den **ACATIS AI Global Equities** (ISIN DE000A2DMV73).

Der ACATIS AI Global Equities ist ein weltweit in Einzeltitel investierender Aktienfonds. Die Vorgaben und die Daten für die Investmentstrategie stammen von ACATIS. Die darauf aufbauende Aktienselektion, -gewichtung und -umschichtung basieren auf Deep-Learning-Modellen, die inspiriert sind durch die Funktionsweise des menschlichen Gehirns.

Das für den ACATIS AI Global Equities genutzte Modell basiert auf der Arbeit von Prof. Dr. Jürgen Schmidhuber, Miterfinder der Long-Short-Term-Memory-Neuronen (LSTM) und einer der Pioniere im Bereich des Deep Learning. Die eingesetzten Deep-Learning Modelle können in der Vergangenheit gelernte Muster und Ereignisse speichern und zu gegebener Zeit wieder aufrufen. Das selbstlernende Modell passt sich in der Zeit voranschreitend dem Marktumfeld an und hat einen langfristigen Horizont.

Die Modelle wurden vom AI-Spezialisten NNAISENSE für das mit ACATIS eingegangene 50/50-Joint-Venture Quantenstein entwickelt. Sie suchen sich selbst die Zusammenhänge, und die Neuronen in neuronalen Netzen spezialisieren sich auf die Erkennung bestimmter Details. Im Zusammenspiel aller Neuronen entsteht das Gesamtmodell. Die Modelle basieren auf 232 Fundamentaldaten wie zum Beispiel Umsatz, EBIT und Gewinn. Die Fundamentaldaten stammen aus der umfangreichen Unternehmensdatenbank, die ACATIS seit 15 Jahren aufbaut und stetig erweitert. Die Daten reichen bis in das Jahr 1986 zurück. Innerhalb des angewandten Modells werden mehrere end-to-end-optimierte Submodelle eingesetzt. Der Fondsmanager stellt bei der Portfoliokonstruktion nur noch die Umsetzung im Fonds sicher.

#### **Ziel: Drei Prozent Outperformance p.a. gegenüber MSCI World Index**

Der ACATIS AI Global Equities selektiert aus einem Investmentuniversum von ca. 4.000 globalen Aktien bis zu 50 Aktien aus entwickelten Ländern und schichtet halbjährlich um. Die Marktkapitalisierung der Aktien liegt im Wesentlichen bei über einer Milliarde Euro. Ziel des risikooptimierten Portfolios ist eine nachhaltige Outperformance von jährlich mindestens drei Prozent gegenüber dem MSCI World Index®. Dieses Ziel wurde in neun von elf Jahren in einem Walk-Forward-Test deutlich übertroffen. Kursrückschläge wurden dabei schneller aufgeholt als vom MSCI World Index® selbst.

## Die Daten zum ACATIS AI Global Equities auf einen Blick

Fondsname	ACATIS AI Global Equities
Fondspartner	ACATIS Investment GmbH, Frankfurt am Main
Kapitalverwaltungsgesellschaft	Universal-Investment-Gesellschaft mbH, Frankfurt am Main
Verwahrstelle	Hauck & Aufhäuser Privatbankiers, Frankfurt am Main
WKN / ISIN	Anteilklasse B: A2DMV7 / DE000A2DMV73 Anteilklasse C: A2DMV8 / DE000A2DMV81
Fondskategorie	Aktienfonds
Fondswährung	EUR
Ertragsverwendung	Ausschüttend
Vergleichsindex	MSCI World Index NTR in EUR (Bloomberg Ticker: MSDEWIN Index)
Laufende Kosten (Schätzung)	Anteilklasse B: 0,9 % Anteilklasse C: 0,8 %
Ausgabeaufschlag	Bis zu 5 %
Erfolgsabhängige Vergütung	25 % (Höchstbetrag) des Betrages, um den die Anteilwertentwicklung die Entwicklung des Vergleichsindex zuzüglich 3 % p. a. am Ende einer Abrechnungsperiode übersteigt, höchstens jedoch bis zu 5 % des Durchschnittswertes des Fonds in der Abrechnungsperiode.

### Über ACATIS Investment GmbH

Die ACATIS Investment GmbH, gegründet 1994, ist ein bankunabhängiger, selbstständiger Vermögensverwalter, dessen Kernkompetenz das Value Investing ist. ACATIS betreut heute mehrere Investmentfonds, darunter Aktien-, Misch- und Rentenfonds sowie Mandate. Drei Fonds verfolgen zudem den Aspekt der Nachhaltigkeit. Der Flaggschiffonds ACATIS Aktien Global Fonds UI wurde bereits 1997 aufgelegt. Neben den klassischen Value-Fonds bietet ACATIS unter dem Namen „Modulor“ zudem Smart-Beta-Produkte an, die Value-Anomalien mit quantitativen Erkenntnissen kombinieren. Seit einigen Jahren befasst sich ACATIS auch mit Künstlicher Intelligenz (KI) und ihrer Anwendung im Portfoliomanagement.

Mehr Informationen unter [www.acatis.de](http://www.acatis.de)

### Über Universal-Investment

Universal-Investment ist mit einem verwalteten Vermögen von 312 Milliarden Euro, davon rund 260 Milliarden Euro in eigenen Vehikeln sowie etwa 50 Milliarden Euro u. a. im Insourcing, weit über 1.000 Publikums- und Spezialfondsmandaten und mehr als 650 Mitarbeitern die größte unabhängige Investmentgesellschaft im deutschsprachigen Raum. Das Unternehmen konzentriert sich mit den drei Leistungsbereichen Administration, Insourcing und Risk Management auf die effiziente und risikoorientierte Verwaltung von Fonds, Wertpapieren, alternativen Investments und Immobilien. Die Investmentgesellschaft ist die zentrale Plattform für unabhängiges Asset Management und vereint das Investment-Know-how von Vermögensverwaltern, Privatbanken, Asset Managem und Investmentboutiquen. Die 1968 gegründete Universal-Investment-Gruppe mit Sitz in Frankfurt am Main sowie Töchtern und Beteiligungen in Luxemburg und Österreich gehört zu den Pionieren in der Investmentbranche und ist heute Marktführerin in den Bereichen Master-KVG und Private-Label-Fonds. In Luxemburg zählt das Unternehmen zu den größten AIFM- und Third-Party-ManCos. (Stand: 31. Mai 2017)

Weitere Informationen unter [www.universal-investment.com](http://www.universal-investment.com)

Ihre Ansprechpartner für Presseanfragen:

ACATIS Investment GmbH  
Dr. Claudia Giani-Leber  
Marketing & Kommunikation  
+49 69 975837-77  
[giani-leber@acatis.de](mailto:giani-leber@acatis.de)

Universal-Investment-Gesellschaft mbH  
Bernd Obergfell  
Pressesprecher  
+49 69 71043-575  
[bernd.obergfell@universal-investment.com](mailto:bernd.obergfell@universal-investment.com)