

GET Capital AG

LEISTUNGSVERSPRECHEN AUCH IN 2020 GEHALTEN

Wendpunkte der Märkte von normaler Volatilität konsequent zu unterscheiden, und dies sowohl nach unten als auch nach oben, gelingt nur wenigen Asset-Management-Konzepten. Von Marco Wunderlich

Aktien sind auf Grund der im Durchschnitt attraktiven Risikoprämie ein wichtiger Bestandteil in den Kapitalanlagen. Regelmäßig kommt es jedoch zu teils erheblichen Korrekturen. Bei fallenden Märkten rechtzeitig nach unten absichern und dann nach oben schnell wieder einsteigen, versprechen viele Asset Manager. Es gelingt nur wenigen. Künstliche Intelligenz (KI) kann helfen, Wendepunkte besser zu erkennen.

Algorithmen sind heute in unserem Leben nicht mehr wegzudenken, von Social Media bis zur industriellen Fertigung. Das gilt auch für die Finanzindustrie, seien es Kreditentscheidungen oder Cash Flow-Planungen im Treasury. Die Liste der KI-Anwendungen ist lang.

Auch Kapitalanleger können von dem Megatrend KI profitieren. Beispielsweise wenn Sie direkt oder über Fonds in KI-Unternehmen investieren. Aber es geht noch mehr.

Warum nicht künstliche Intelligenz für Anlageentscheidungen nutzen? Denn KI ist geradezu prädestiniert für das Asset Management.

Was KI und insbesondere Machine Learning auszeichnet, sind die gleichen Erfolgsfaktoren wie beim Managen von Kapitalanlagen:

- Analyse riesiger Datenmengen
- Rendite-/Risiko-Prognosen
- Optimierungen bei komplexen Nebenbedingungen

Anlageentscheidungen mit KI sind längst Realität, wie z.B. der rein durch Algorithmen gesteuerte GET Capital Quant Global Equity Fonds zeigt. GET Capital hat bereits 2012 eine „Produktionsstraße“ aufgebaut, bei der auf Machine Learning Modellen der KI beruhende Algorithmen vollautomatisiert Portfolien optimieren.



Marco Wunderlich
Head of Client
Development
GET Capital AG

Eine der wichtigsten und gleichzeitig schwierigsten Aufgaben im Portfolio Management ist es, Marktrauschen von Trendwenden zu unterscheiden. Also zu erkennen, wenn es keine normale tägliche Volatilität ist, sondern eine Trendumkehr. Viele Manager tun sich damit schwer, rechtzeitig aus den Märkten aus- und dann rechtzeitig wieder einzusteigen. Das ist GET Capital mit Hilfe der KI im Herbst 2018 und März 2020 zu Beginn der COVID-Krise sehr gut gelungen.

Bei der Titelselektion und Portfoliokonstruktion sowie bei den Returnschätzern bietet KI eine große Unterstützung. Aktives Management mit der Fähigkeit Drawdowns abzumildern, sorgt dafür, von positiven Marktentwicklungen zu partizipieren, aber größere Verluste und schlaflose Nächte zu vermeiden. Vergleichen Sie die Performance im März 2020 in der Abbildung mit anderen Managern und ETFs. Wie würden die Ergebnisse für das Jahr 2020 aussehen, wenn der Drawdown erst im September eingetreten wäre?

Weitere Informationen: www.GET-Capital.de

GET Capital Quant Global Equity

ISIN LU0787633451

Gesamtjahr 2020



www.GET-Capital.de

Leistungsversprechen: Partizipation an positiven Markttrends und Abmilderung von Drawdowns.

- Aktienquote wurde mit der Abwärtsbewegung der Märkte ab Ende Februar 2020 sehr schnell reduziert.
- Der Drawdown 2020 belief sich im Fonds auf -18,4% und -34% im MSCI World.
- Ende März und Mitte April 2020 wurde sehr schnell wieder Exposure aufgebaut.
- Bereits im Juni 2020 erreichte der Fonds den Stand vom Jahresbeginn, dies gelang dem Index erst im August.

Disclaimer: Renditen und Kursverläufe der Vergangenheit sind kein Indikator für die Kursentwicklung in Zukunft.