

KI im Fondsmanagement: Intelligente Outperformance?

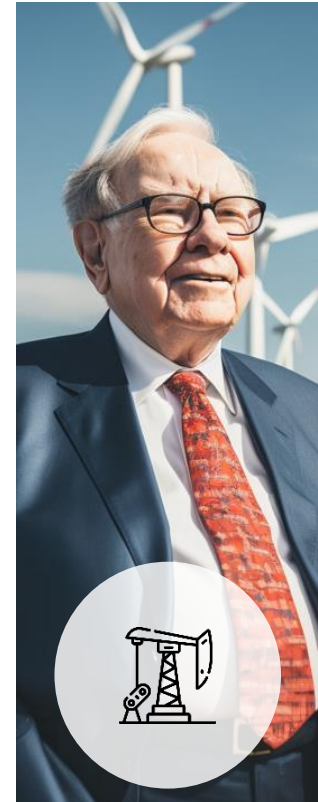
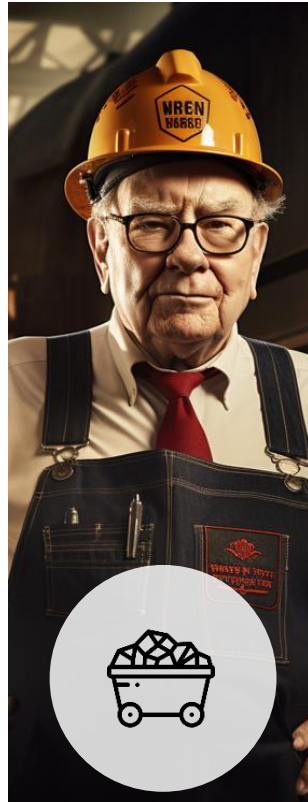
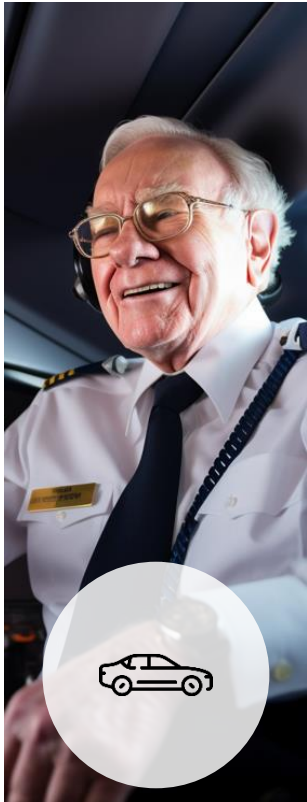
Kevin Ender, Leiter Quantitatives Portfoliomanagement
ACATIS Investment KVG mbH
4. Dezember 2023

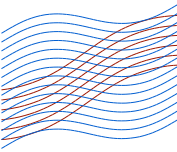
ACATIS

Marketingunterlage

Bitte lesen Sie den Prospekt des OGAW und das KID, bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen.

Wir haben für jeden Sektor einen künstlichen Warren Buffett zur Unternehmensanalyse





Unsere KI nutzt zwei Datensets: Zahlen aus Geschäftsberichten

Gewinn und Verlustrechnung

Kennzahl	Zeitreihe
Umsatz	
Kosten	
EBIT	
Zinszahlungen	
Gewinn	

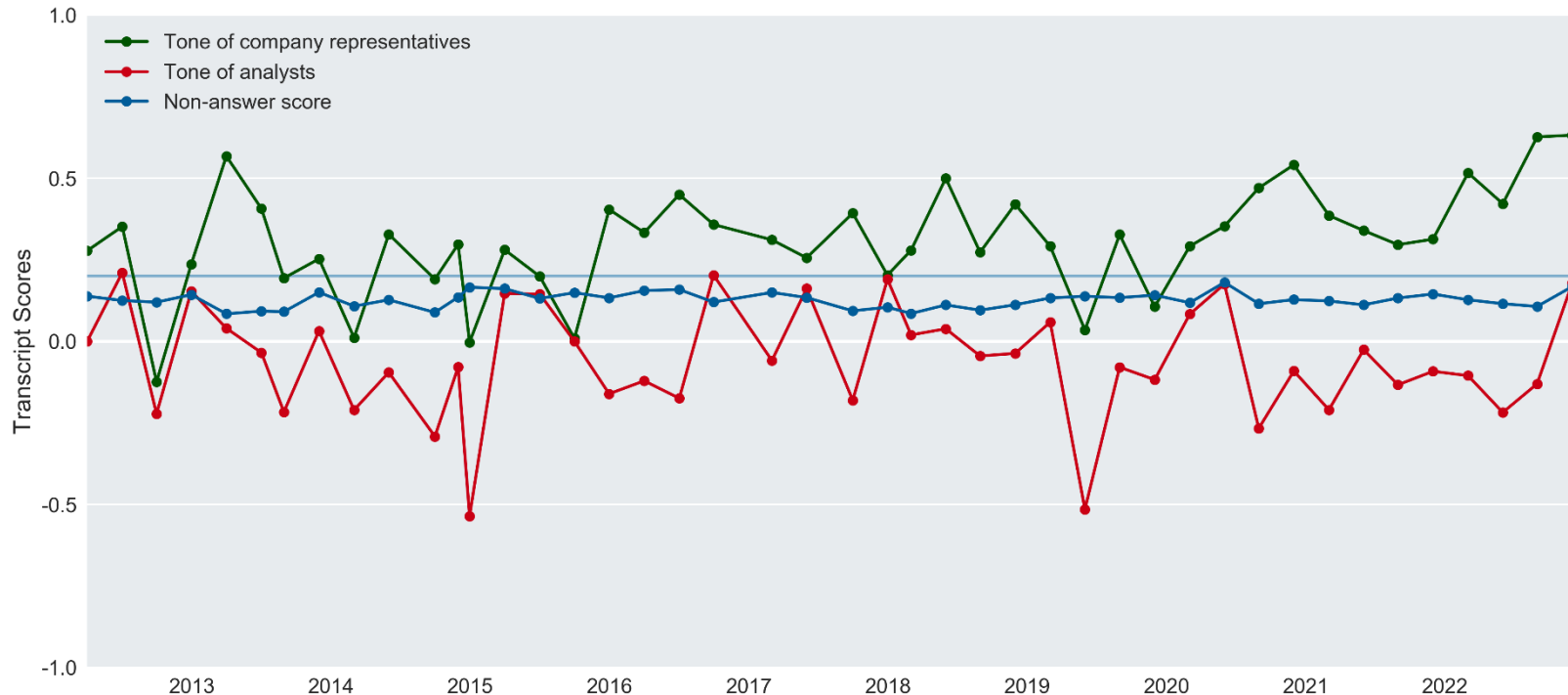
Bilanz

Kennzahl	Zeitreihe
Vermögenswerte	
Kasse	
Verbindlichkeiten	
Langfristige Schulden	
Eigenkapital	

Cashflow Statement

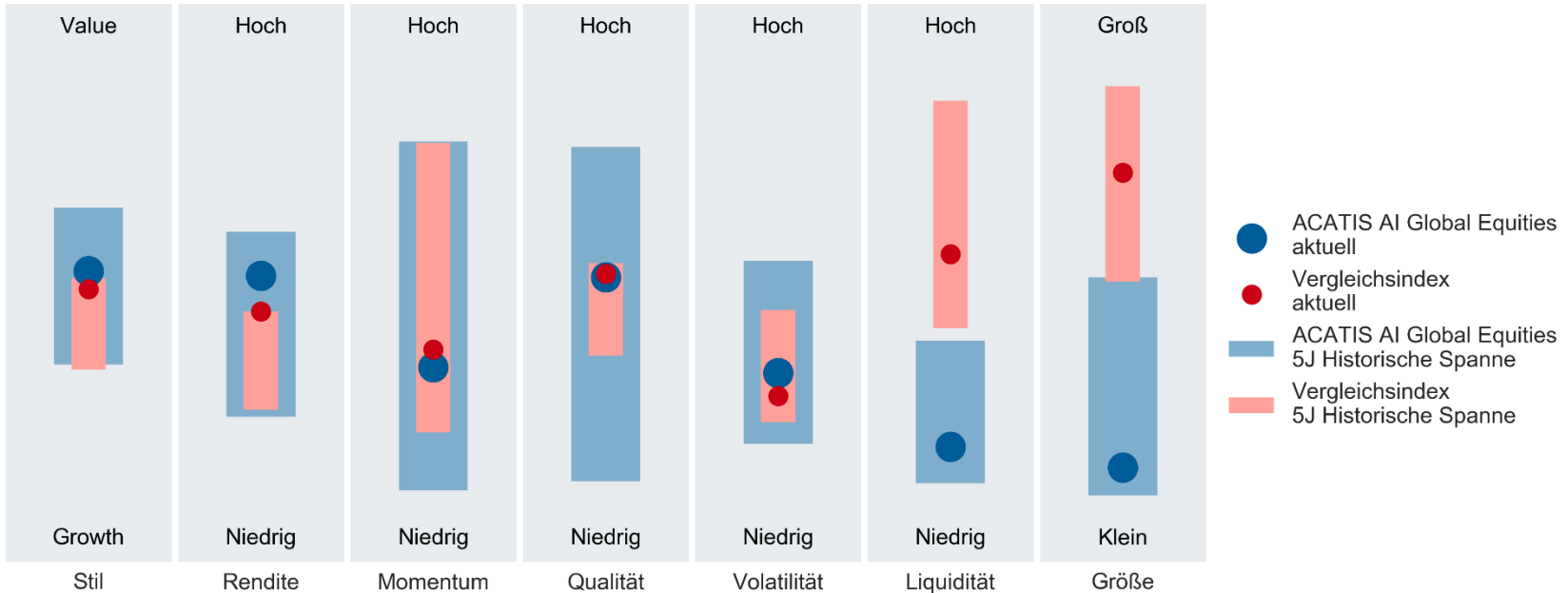
Kennzahl	Zeitreihe
Operativer Cashflow	
Umlaufvermögen	
Investitions-Cashflow	
Dividenden	
Finanzierungs-Cashflow	

Texte in Form von Managementgesprächen mit Analysten



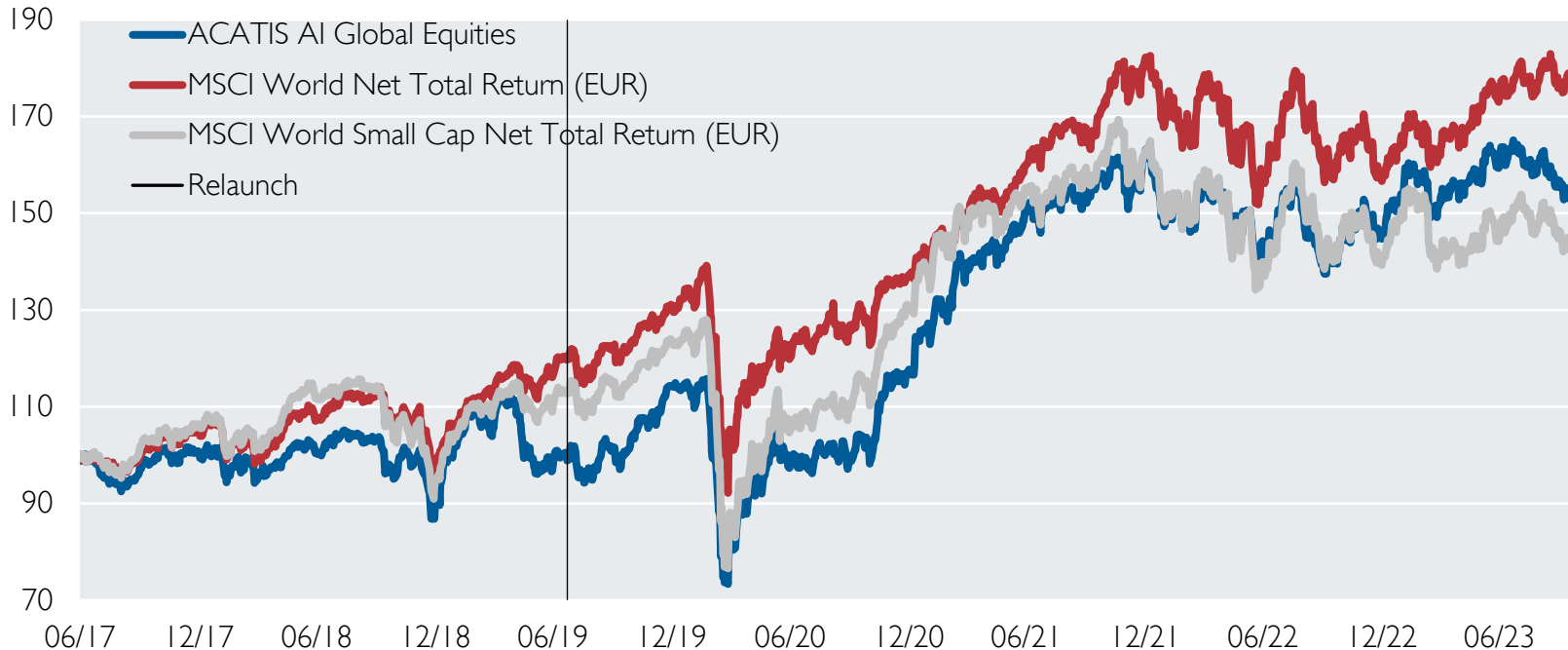
Unsere KI präferiert kleine und mittelgroße Unternehmen

Faktor Exposure des ACATIS AI Global Equities vs Vergleichsindex



Relaunch des ACATIS AI Global Equities zwei Jahre nach Auflage des Fonds

Performance des ACATIS AI Global Equities (B) vs MSCI World Index und MSCI World Small Cap Index
 Zeitraum 28.06.2017 bis 31.10.2023

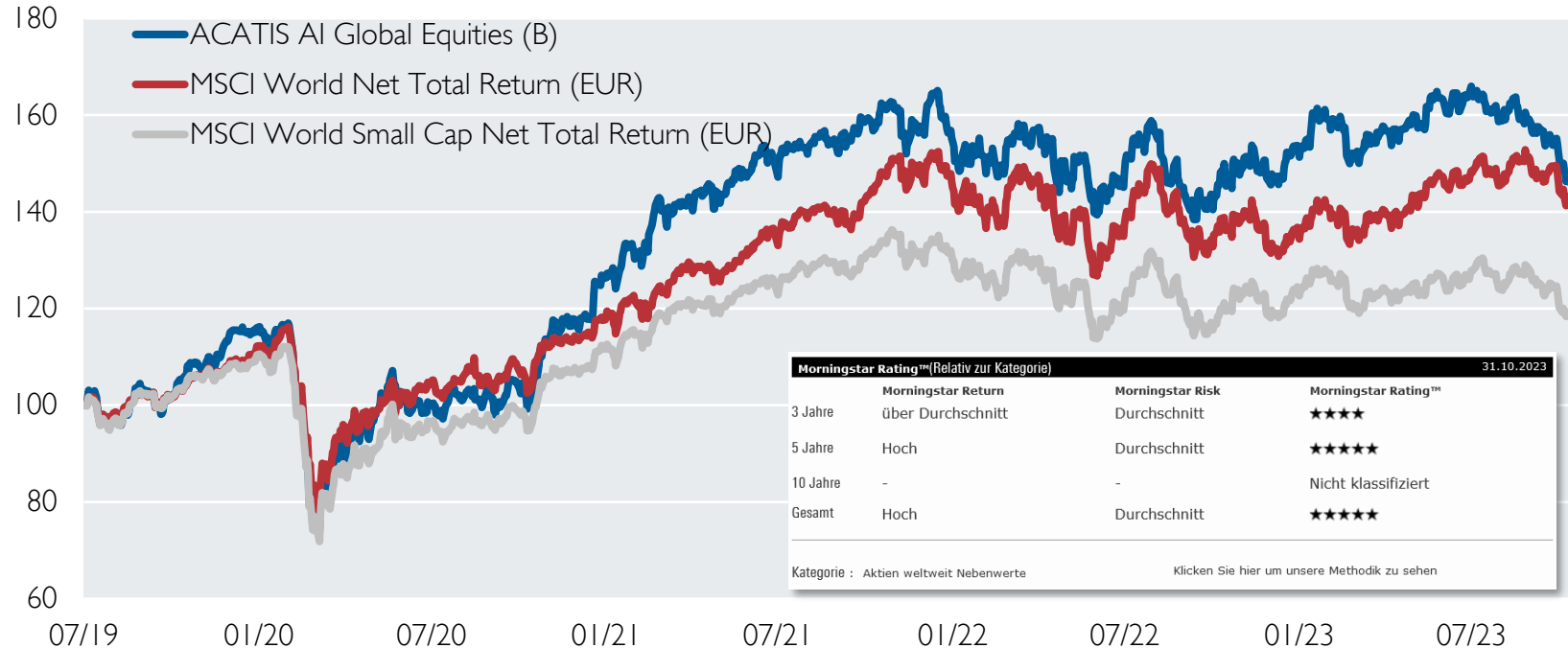


Quelle: Bloomberg, die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Indikator für zukünftige Erträge. Mindestanlage Anteilklasse B sind 50 TEUR.

Marketingunterlage

Seit Strategie Relaunch im Juli 2019 +4% bzw. +28% Outperformance

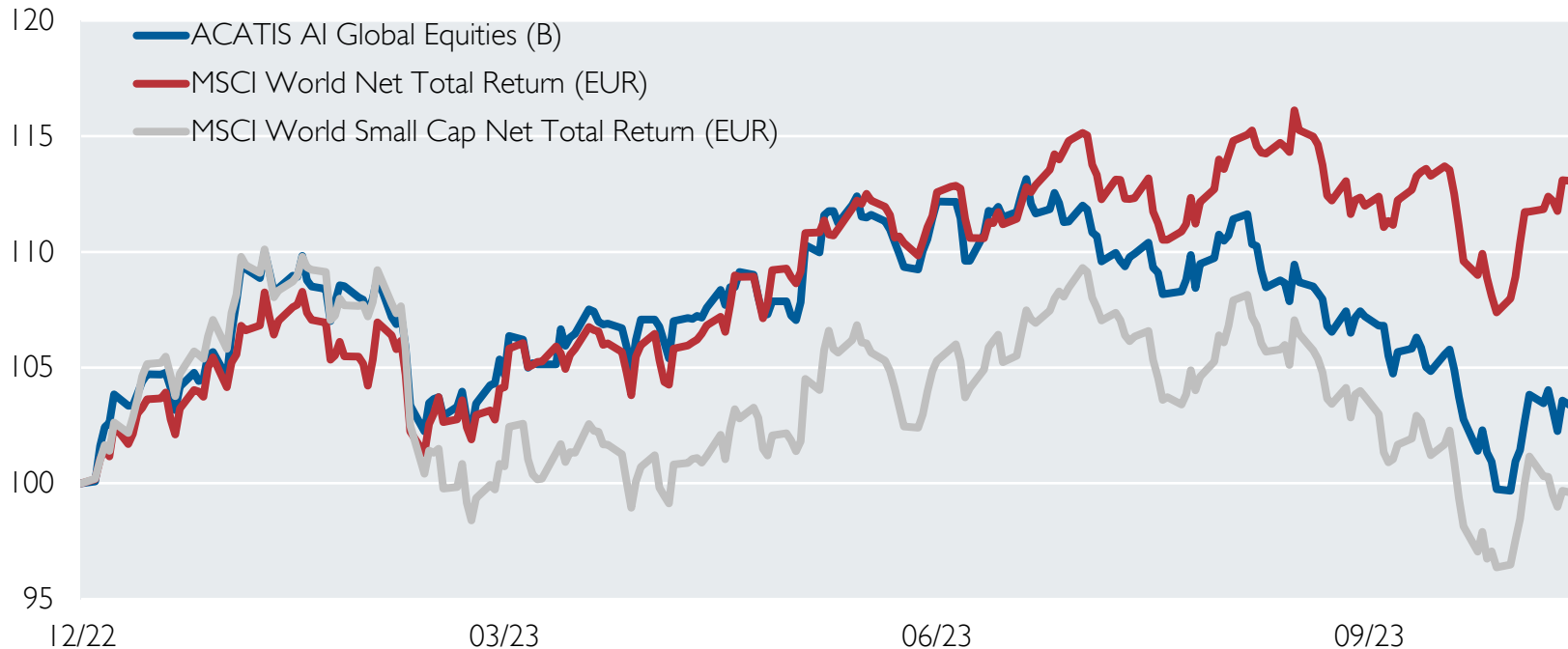
Performance des ACATIS AI Global Equities (B) vs MSCI World Index und MSCI World Small Cap Index
 Zeitraum 19.07.2019 bis 31.10.2023



Quelle: Bloomberg, Morningstar, die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Indikator für zukünftige Erträge. Mindestanlage Anteilklasse B sind 50 TEUR.

Dieses Jahr ist kein gutes Umfeld für kleine Firmen

Performance des ACATIS AI Global Equities (B) vs MSCI World Index und MSCI World Small Cap Index
Zeitraum 31.12.2022 bis 14.11.2023



Quelle: Bloomberg, die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Indikator für zukünftige Erträge. Mindestanlage Anteilklasse B sind 50 TEUR.

Marketingunterlage

Produktdaten des ACATIS AI Global Equities

Anteilklasse	ISIN	Währung	Anteilklasse	Laufende Kosten	Auflegedatum	Mindestanlage	Ertragsverwendung
A	DE000A2DR2L2	EUR	Retail	1,86%	23.11.2017	keine	Ausschüttend
B	DE000A2DMV73	EUR	Institutionell	1,12%	28.06.2017	50.000 EUR	Ausschüttend
C	DE000A2DMV81	EUR	Institutionell	0,93%	27.06.2017	2.000.000 EUR	Ausschüttend

Kontaktdaten

- **ACATIS**
Investment Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH
Deutschland

- Adresse
 - mainBuilding
 - Taunusanlage 18
 - D-60325 Frankfurt
 - Tel: +49-69-97 58 37-77
 - Fax: +49-69-97 58 37-99
 - Webseite: www.acatis.de

- **ACATIS**
Service GmbH
Schweiz

- Adresse
 - Gütli 166
 - CH-9428 Walzenhausen
 - Tel: +41-71-886 45-51



Disclaimer

- Diese Unterlage richtet sich ausschließlich an professionelle Kunden bzw. geeignete Gegenparteien im Sinne des WpHG und ist nicht für Privatkunden bestimmt. Die Unterlage ist zudem kein Angebot an Personen, an die sie aus Rechtsgründen nicht abgegeben werden darf.
- Die Unterlage dient nur der Information und ist keine Anlageempfehlung oder Aufforderung zum Fondskauf. Die dargestellte Anlagemöglichkeit kann für bestimmte Anleger wegen ihrer speziellen Anlageziele und finanziellen Situation ungeeignet sein.
- Abgegebene Meinungen gelten zum Zeitpunkt der Veröffentlichung und können sich ändern, ebenso die Fondszusammensetzung und Allokationen. Bisherige Wertentwicklungen sind keine Garantie für künftige Erträge. ACATIS übernimmt keine Gewähr für die Erreichung der Marktprognosen.
- Trotz sorgfältig ausgewählter Quellen kann die Richtigkeit, Vollständigkeit oder Genauigkeit der Informationen nicht garantiert werden. Die Informationen dürfen weder reproduziert noch weiterverteilt werden.
- Die Vertriebszulassungen der ACATIS-Fonds in einzelnen Ländern und zugehörige Dienstleistungen können unterschiedlich sein. ACATIS stellt die Verkaufsprospekte, Basisinformationsblätter (BIB), Jahres- und Halbjahresberichte ihrer Fonds kostenlos auf Deutsch bereit (<http://www.acatis.de>).
- Die ACATIS Investment KVG mbH hat ihren Hauptsitz in Frankfurt a.M., Deutschland, und wird von der BaFin, Marie-Curie-Straße 24-28, in 60439 Frankfurt, beaufsichtigt.
- ACATIS Investment Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH, mainBuilding, Taunusanlage 18, D-60325 Frankfurt am Main, Tel.: +49/ 69/ 97 58 37-77, Fax: +49/ 69/ 97 58 37-99, E-Mail: anfragen@acatis.de, <http://www.acatis.de>.