



Investment

## **Kurzvorstellung ART AI EUROPE – MARKET NEUTRAL**

Dezember 2020

# Annualisierte Bruttorendite 2020 von 1.8% bei einer Volatilität von 5.9%

YTD Performance bis 30. November 2020



1.6%	1.8%	5.9%
0.1%	0.1%	5.9%
Rendite	Ann. Rendite	Volatilität

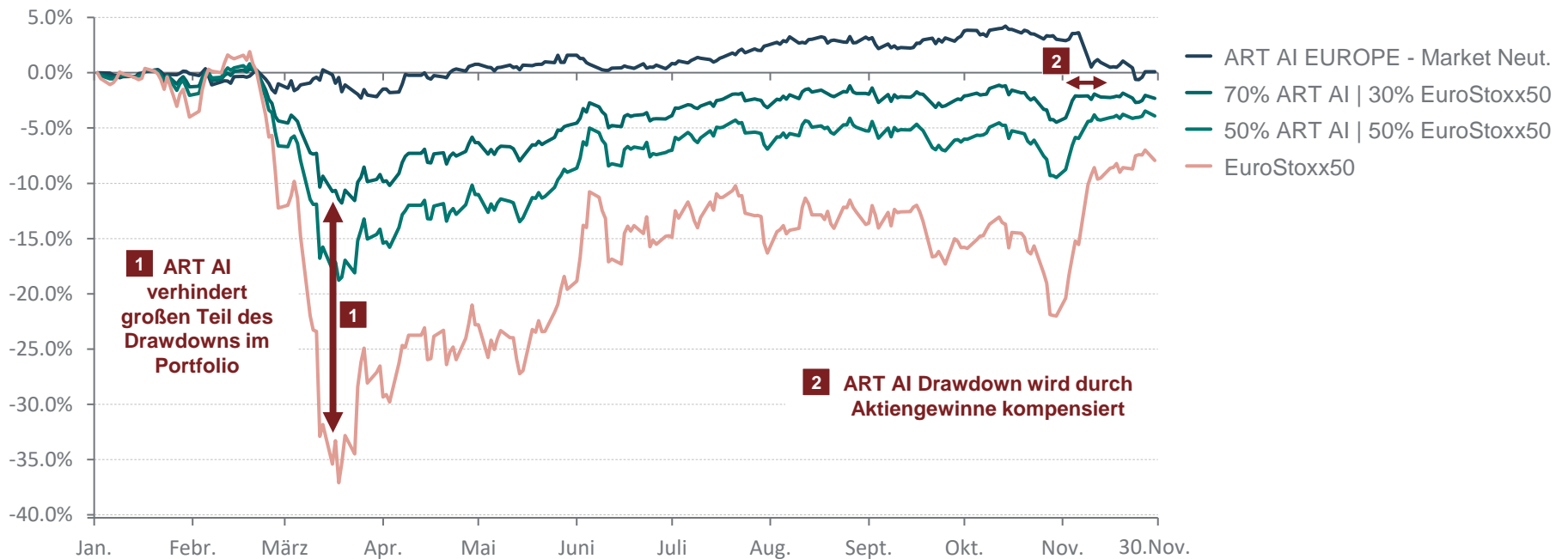
- **Renditestärke:** positive Erträge auch in Krisen-Phasen
- **Stabilität:** niedrige Volatilität bleibt auch in turbulenten Marktphasen bestehen
- **Unkorreliertheit:** markt-unabhängige Renditen stärken die Portfolio-Diversifizierung

Year-to-Date (YTD) Kennzahlen sind berechnet vom ersten Handelstag des Jahres 2020 bis zum letzten Handelstag des Monats November 2020

# Im Portfoliokontext hat der ART AI eine stark stabilisierende Wirkung

Portfolios als Kombination des ART AI mit dem EuroStoxx50

## ART AI EUROPE – MARKET NEUTRAL im Portfolio Kontext mit dem EuroStoxx50 (YTD kumulative Rendite)

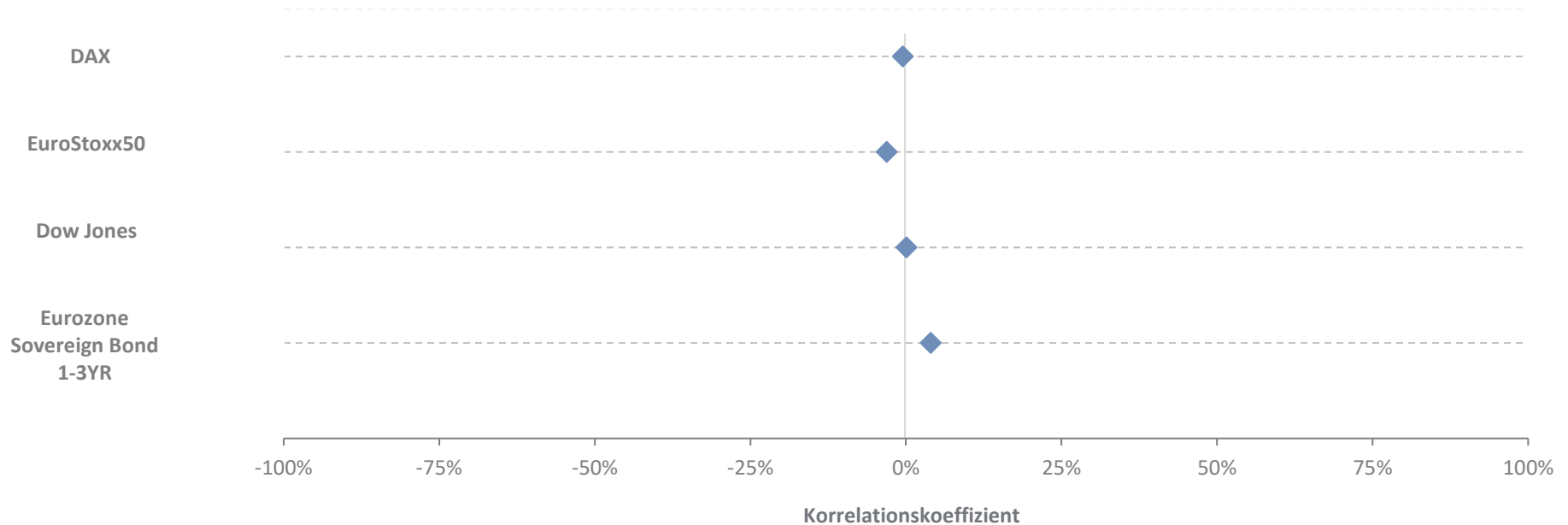


Mischportfolio fing über 30% Aktien-Verluste auf und blieb auf durchgehend stabilem Kurs

# ART AI unkorreliert mit Aktien- und Rentenmärkten

Korrelationskoeffizient des ART AI mit anderen Assetklassen

## ART AI EUROPE – MARKET NEUTRAL | Korrelation mit Aktien- und Rentenindizes

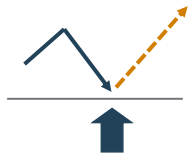


# Marktneutrale Strategie als Weg aus dem Niedrigzinsumfeld

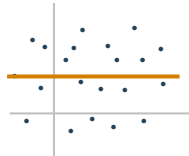
Strategie Highlights des ART AI EUROPE - MARKET NEUTRAL



**Aktienselektion** basiert auf **systematisch-quantitativen Ansatz**, der eine simultane Analyse eines großen Aktienuniversums erlaubt



**Marktneutrale Positionierung** über **Indexhedge**, um die Risiken von Marktschwankungen und Market Timing abzumildern



Gezielte Absicherungen ermöglichen **stabile** und **zum Markt unkorrelierte Renditen**, auch in extrem volatilen Marktphasen

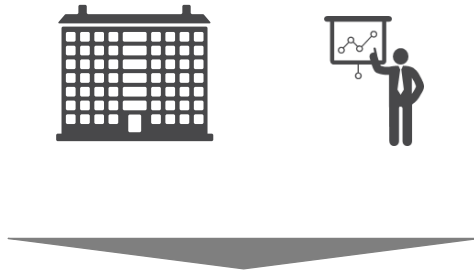


Fokus auf **liquide europäische Titel** stellt permanente Umsetzbarkeit der Strategie selbst bei hohen Investmentvolumina sicher

# Zeitnahe Erfassung fundamentaler Veränderungen durch neue Datenquellen

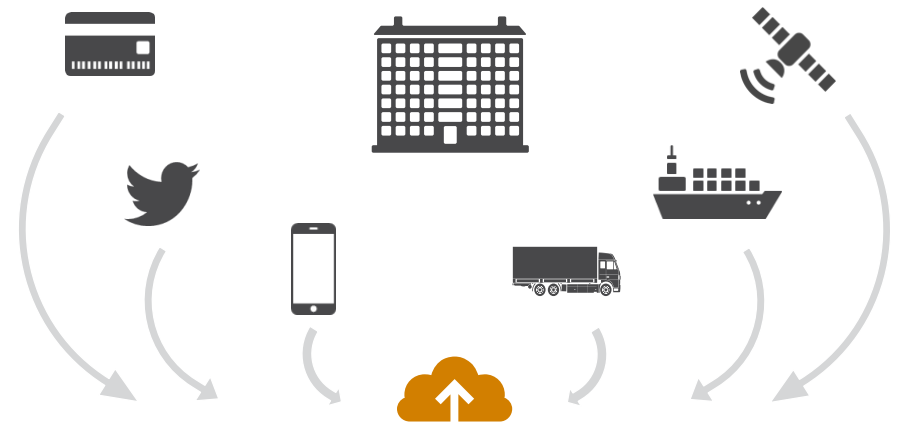
Traditionelle und neu entstehende Datenquellen im Investmentprozess

## Daten der traditionellen Finanzanalyse



- **Management** kommuniziert vom Unternehmen **aggregierte** und **oft subjektiv aufbereitete** Daten
- Kommunikation meist nur **quartalsweise** und an **breite Investorenbasis**

## Fokus: Daten aus alternativen Quellen



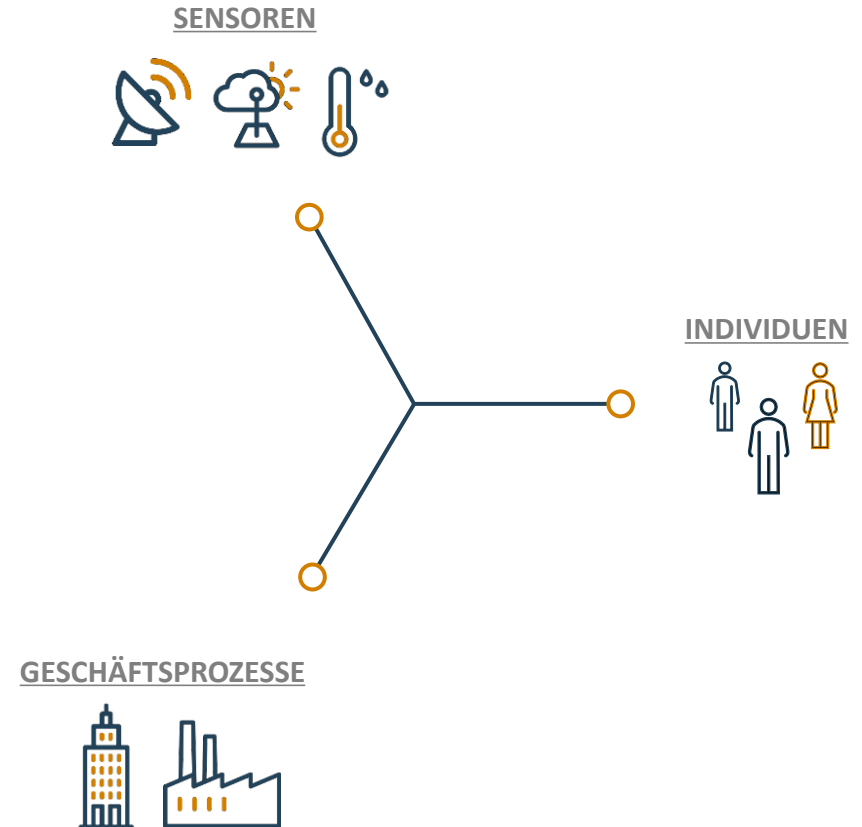
- **Unabhängig vom Management** hinterlassen Firmen eine **Vielzahl** an Daten durch ihre Geschäftstätigkeit
- Daten sind in **Echtzeit** verfügbar und werden **objektiv** von **Spezialisten** beurteilt

# Alternative Daten sind der digitale Fußabdruck von Unternehmen

## Klassifizierung von alternativen Datenquellen nach ihrer Herkunft

### Quellen Alternativer Daten

- Durch die zunehmende Technologisierung und Vernetzung unserer Welt hinterlassen **Unternehmen** verstärkt einen **digitalen Fußabdruck** und begünstigen die Entstehung von alternativen Daten
- Aber auch **Konsumenten** und **technische Meßprozesse**, die in einem Bezug mit dem Unternehmen stehen, stellen eine wertvolle Informationsgrundlage
- Grundsätzlich unterscheidet man deshalb **drei Quellen** von **alternativen Daten**:
  1. Unternehmensprozesse
  2. Individuen
  3. Sensoren
- Diese Daten können **gesammelt**, **strukturiert aufbereitet** und **analysiert** werden



# Fondsdetails des ART AI EUROPE – MARKET NEUTRAL

Darstellung der beiden Anteilklassen

## ART AI EUROPE – MARKET NEUTRAL: OGAW Sondervermögen mit Sitz in Deutschland

Fondswährung	Euro (EUR)	
Ertragsverwendung	Ausschüttend	
KVG	Universal-Investment Gesellschaft mbH	
Verwahrstelle	Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG	
Anteilklassen	I (Institutionell)	R (Retail)
ISIN / WKN	DE000A2PB6X2 / A2PB6X	DE000A2PB6Y0 / A2PB6Y
Mindestanlage	€ 100 000	keine
Management Gebühr	1.50% jährlich	1.80% jährlich
Erfolgsabh. Vergütung	15% auf Performance über Hurdle Rate und High Watermark	
Hurdle Rate	1.50%	
High Watermark	5 Jahre High Watermark	



## Ihre Ansprechpartner

---



**Dr. Axel Stahmer**

**QI Investment Advisory GmbH**  
*Geschäftsführer*

*Tel.: +49 (89) 122 936 65*  
*axel.stahmer@qi-investment.com*



**Dr. Christoph Wagner**

**QI Investment Advisory GmbH**  
*Geschäftsführer*

*Tel.: +49 (89) 326 389 30*  
*christoph.wagner@qi-investment.com*



## Disclaimer - Impressum

---

Bitte beachten Sie, dass es sich bei diesem Dokument nicht um eine Kundeninformation im Sinne des § 63 Abs. 6 Wertpapierhandelsgesetz handelt. Diese Unterlage darf nicht an Kunden im Sinne des § 67 WpHG gegeben werden. Die Unterlage richtet sich ausschließlich an Finanzanlagenvermittler (nach §34f/h GewO), Finanzdienstleister/Banken/Kreditinstitute im Sinne des Kreditwesengesetzes oder an sonstige durch die BaFin beaufsichtigte Institute/Unternehmen.

Die aufgeführten Informationen beziehen sich ausschließlich auf den Zeitpunkt der Erstellung, eine Garantie für die Aktualität und fortgeltende Richtigkeit kann nicht übernommen werden. Der vorstehende Inhalt gibt ausschließlich die Meinungen des Verfassers wieder, eine Änderung dieser Meinung ist jederzeit möglich, ohne dass es publiziert wird. Das vorliegende Dokument ist urheberrechtlich geschützt, jede Vervielfältigung und die gewerbliche Verwendung sind nicht gestattet.

Datum: 07. Dezember 2020 Herausgeber: QI Investment Advisory GmbH, Dachauer Straße 65 in 80335 München handelnd als vertraglich gebundener Vermittler (§ 2 Abs. 10 KWG) im Auftrag, im Namen, für Rechnung und unter der Haftung des verantwortlichen Haftungsträgers BN & Partners Capital AG, Steinstraße 33, 50374 Erftstadt. Die BN & Partners Capital AG besitzt für die die Erbringung der Anlageberatung gemäß § 1 Abs. 1a Nr. 1a KWG und der Anlagevermittlung gemäß § 1 Abs. 1a Nr. 1 KWG eine entsprechende Erlaubnis der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht gemäß § 32 KWG.