

Pressemitteilung

Catana Capital lanciert Data Intelligence Fund

- ◆ Kombination aus Big-Data-Analyse und Künstlicher Intelligenz bildet Grundlage für Anlageentscheidung
- ◆ Selektive Anlage in europäischen Large Cap-Aktien
- ◆ Attraktives Chance-/Risikoprofil durch Steuerung des Investitionsgrads mittels Index-Futures

Frankfurt am Main, 04. Dezember. Der Frankfurter Asset Manager Catana Capital startet mit dem **Data Intelligence Fund** (DE000A2H9A68) einen innovativen UCITS-Fonds auf, der vollständig auf Big Data und künstliche Intelligenz (KI) setzt. Dabei werden als Basis für jede Anlageentscheidung in sieben Ländern und in drei Sprachen Internetdaten zu Wertpapieren und Finanzmärkten automatisiert gesammelt, gefiltert, gewichtet und analysiert. Pro Tag werden so in Echtzeit knapp zwei Millionen kapitalmarktbezogene Nachrichten ausgewertet. Mit Hilfe eines Algorithmus werden in einem rein datenbasierten Prozess Kauf- und Verkaufsempfehlungen für europäische Large Cap Aktien und Index-Futures erzeugt. „Ziel des Fonds ist die Erzielung einer positiven Rendite, die im langjährigen Durchschnitt die Rendite des DAX übertrifft. Gleichzeitig wird angestrebt keine negativen Jahresrenditen zu realisieren“, so Bastian Lechner, Geschäftsführer von Catana Capital. Zielgruppe sind sowohl professionelle als auch private Investoren.

Mit dieser Big-Data-Analyse werden in Echtzeit mehr als 45.000 Titel beobachtet. „Die Schlüsselfrage bei uns lautet: Wer sagt was zu welcher Aktie? Im ersten Schritt werden monatlich über 5 Terrabyte an Informationen gesammelt. Das sind mehr als 21 Nachrichten pro Sekunde. Im zweiten Schritt analysiert der Algorithmus dann die Daten“, so Lechner. Das System gibt jedem Titel auf Basis der gesammelten Daten ein vorläufiges positives oder negatives Signal. Bevor daraus eine Handelsentscheidung entsteht, analysiert es im Sinne der künstlichen Intelligenz, wie sich die Aktie in der Vergangenheit nach einem positiven oder negativen Signal entwickelt hat. Stuft die KI die Erfolgswahrscheinlichkeit auf Basis der aktuellen Nachrichtenlage als besonders hoch ein, generiert sie ein Handelssignal. Die getroffenen Entscheidungen und ihre Ergebnisse fließen in künftige Anlageempfehlungen mit ein – das System lernt damit automatisiert dazu.

„Der Ansatz der Aktienselektion wird um eine Asset Allocation-Komponente ergänzt. Sollte die grundsätzliche Einschätzung zum Aktienmarkt negativ ausfallen, so wird das Risiko mittel Index-Futures reduziert und kann sogar netto short sein.“, sagt Lechner. „Vor allem in Phasen von Korrekturen und Einbrüchen am Aktienmarkt hat der Algorithmus seine Stärke gezeigt und frühzeitig Risiken reduziert. Als Resultat erzielen wir einen hohen Diversifikationseffekt, grenzen die Risiken und die Abhängigkeit von den volatilen Kapitalmärkten ein und können auch in einem herausfordernden Umfeld attraktive Ergebnisse erzielen“, erläutert Lechner.

DIE FONSDATEN AUF EINEN BLICK

Fondsname	Data Intelligence Fund	
Fonds-Berater	Catana Capital GmbH	
Kapitalverwaltungsgesellschaft	Ampega Investment GmbH	
Verwahrstelle	Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG	
Fondswährung	EUR	
Ertragsverwendung	Thesaurierend	
Anteilklassen	P (Retail)	I (Institutionell)
WKN / ISIN	A2H9A6 / DE000A2H9A68	A2H9A7 / DE000A2H9A76
Verwaltungsvergütung	1,88%	1,35%
Laufende Kosten (Schätzung)	2,12 %	1,59 %
Mindestanlage	-	1.000.000 EUR
Ausgabeaufschlag	Bis zu 5,25 %	Bis zu 1,25%
Erfolgsabhängige Vergütung	20 % des Betrags, um den der Fondspreis am Ende einer Abrechnungsperiode den Fondspreis am Bewertungsstichtag der letzten 5 Jahre („High-Water Mark“) übersteigt, jedoch insgesamt höchstens bis zu 15 % des Durchschnittswerts des Fonds in der Abrechnungsperiode	

ÜBER CATANA CAPITAL

Die Catana Capital GmbH ist ein nach § 32 KWG lizenziertes Finanzdienstleistungsinstitut mit Sitz in Frankfurt am Main. Die Catana Capital GmbH wurde im August 2015 gegründet und verwaltet den Data Intelligence Fund, einen vollständig auf Big Data und künstlicher Intelligenz basierten Publikumsfonds.

Weitere Informationen unter www.catanacapital.de

Press release

Catana Capital launches Data Intelligence Fund

- ◆ Combination of Big Data analysis and Artificial Intelligence forms basis of investment decision
- ◆ Selective investment in European Large Cap stocks
- ◆ Attractive risk-return profile due to management of exposure level via index futures

Frankfurt am Main, 04. December. The Frankfurt based Asset Manager Catana Capital launches the **Data Intelligence Fund** (DE000A2H9A68), an innovative UCITS fund, that relies entirely on Big Data and Artificial Intelligence (AI).

For the investment decisions, internet data on securities and financial markets are automatically collected, filtered, weighted and analysed in seven countries and in three languages. In this way, almost two million capital market-related news items are evaluated in real time every day. Using this algorithm, buy and sell recommendations for European large cap stocks and index futures are generated in a purely data-based process. "The aim of the fund is to achieve a positive return that exceeds the long-term average return of the DAX index. At the same time, the aim is not to generate negative annual returns," says Bastian Lechner, Managing Director of Catana Capital. The target group includes both professional and private investors.

Via the Big Data analysis more than 45.000 securities are covered in real-time. „The key question is: Who says what to which security? In a first more than 5 terabyte of information are collected per month. This is more than 21 messages per second. In a second step, the algorithm evaluates the information“, Lechner continues. The system assigns to every security a preliminary positive or negative signal based on the collected information. Though, before a final trading signal is generated, the AI analyses how a security has performed in the past after such a positive or negative signal. Only with a high success probability, a trading signal is generated. The new decision and its performance result are added to the database and therefore included for future trading signals going forward – the system is self-learning on an automated basis.

"The stock selection approach is supplemented by an asset allocation component. If the overall assessment of the equity market is negative, the risk is reduced by index futures and can even be net short," says Lechner. "Especially in phases of corrections and downturns in equity markets, the algorithm has shown its strength and reduced risks at an early stage. As a result, we achieve a high diversification effect, limit risks and dependence on volatile capital markets and can achieve attractive results even in a challenging environment," explains Lechner.

FUND INFORMATION AT A GLANCE

Fund name	Data Intelligence Fund	
Advisor	Catana Capital GmbH	
Administrator	Ampega Investment GmbH	
Custodian	Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG	
Currency	EUR	
Dividend type	Accumulating	
Share classes	P (Retail)	I (Institutional)
WKN / ISIN	A2H9A6 / DE000A2H9A68	A2H9A7 / DE000A2H9A76
Management Fee	1.88%	1.35%
TER (estimate)	2.12 %	1.59 %
Minimum investment	-	1,000,000 EUR
Up-front charge	up to 5.25 %	up to 1.25%
Performance fee	20% of the amount by which the fund price at the end of a settlement period exceeds the fund price on the valuation date of the last 5 years ("high water mark"), but not more than a total of 15% of the average value of the fund in the settlement period.	

ABOUT CATANA CAPITAL

Catana Capital GmbH is a financial institution, licensed according to section 32 German Banking Act and domiciled in Frankfurt, Germany. Catana Capital GmbH was founded in August 2015 and manages the Data Intelligence Fund, an exclusively Big Data- and A.I.-based public UCITS fund.

More information on www.catanacapital.de