

# Press release

16 oktober 2017

## AXA IM Rosenberg Equities maakt begin met integratie van *kunstmatige intelligentie* en *big data* in beleggingsproces

AXA IM Rosenberg Equities, het kwantitatieve beleggingsteam van AXA Investment Managers (AXA IM), gaat geavanceerde modelleringstechnieken, die specifiek gebruikmaken van zelflerende systemen ('machine learning') en neurale netwerken<sup>1</sup>, integreren in het beleggingsproces. Rosenberg Equities bevindt zich in de voorhoede van *quant*-beleggen met aanzienlijke ervaring in het gebruik van machine learning voor klanten. Door deze stap kan de analyse van grote hoeveelheden gegevens (Big Data) sterk worden verbeterd.

Het eerste voorbeeld van deze integratie is de opname van een neuraal-netwerkmodel in de *Sustainable Equity*-strategie, die deel uitmaakt van de productreeks Advanced Factors<sup>2</sup>. Met het nieuwe model wordt een verbetering van de strategie nagestreefd, zodat beter kan worden ingeschat welke aandelen het risico van een extreme koersdaling lopen; zo kan het staartrisiko worden verkleind en het risico-/rendementsprofiel voor klanten worden verbeterd.

**Gideon Smith, CIO voor Europa bij AXA IM Rosenberg Equities:** *"Met de toepassing van neurale netwerkfunctionaliteit en kunstmatige intelligentie in klantportefeuilles zetten we de eerste stap op dit gebied, een voor ons logische vervolgstap gezien de geavanceerde kwantitatieve technieken die we in de afgelopen dertig jaar hebben geïntroduceerd. Volgens ons is dit een weloverwogen stap die goed aansluit op onze beleggingsbenadering van risicomodellering en -beheersing voor onze klanten. Op dit vlak hebben we een schat aan kennis en expertise, en het verheugt ons dat we deze technieken kunnen inzetten teneinde de resultaten voor onze klanten in alle stadia van het beleggingsproces te verbeteren."*

Daarnaast kijkt Rosenberg Equities momenteel naar nieuwe 'ongestructureerde' datasets die een aanvulling kunnen vormen op de traditionele financiële gegevens, waarop beleggers van oudsher focussen om meer inzicht te krijgen in de *fundamentals* van een bedrijf en het beleggerssentiment rond dat bedrijf. Zo ontwikkelt Rosenberg momenteel een taalverwerkingsmodel, waarmee gedeponeerde bedrijfsrapporten en andere tekstbronnen kunnen worden geanalyseerd en nieuwe inzichten worden verkregen in het beleggerssentiment rond een bedrijf.

**Heidi Ridley, CEO van AXA IM Rosenberg Equities:** *"Beide ontwikkelingen illustreren de toepassing van kunstmatige intelligentie en ongestructureerde gegevens als aanvulling op onze*

[www.axa-im.com](http://www.axa-im.com)  

## Press release

---

*bestaande modelleringstechnieken. Dit sterkt ons in onze overtuiging dat innovatief gebruik van gegevens en technologie tot betere inzichten leidt, met uiteindelijk betere resultaten voor onze klanten.”*

- Einde bericht -

### Noot voor de redactie

1. Een kunstmatig neuraal netwerk is een rekenmodelsysteem waarin de verwerking van informatie op soortgelijke wijze plaatsvindt als in een menselijk neuraal netwerk.
2. De *Advanced Factors*-strategie van AXA IM Rosenberg heette voorheen de *AXA IM Smartbeta Equity*-strategie.  
Het begrip Smart Beta wordt algemeen gebruikt door marktpartijen als een overkoepelend begrip om een breed scala aan niet-marketcap-gewogen beleggingsbenaderingen te beschrijven. De hoofdreden voor het besluit om de naam van de strategie te veranderen was een precieze beschrijving van het onderliggende beleggingsproces en het verwachte beleggingsresultaat. 'Advanced Factors' beschrijft onze strategieën beter gezien het feit dat onze benadering wordt geschraagd door twee aandeelfactoren: kwaliteit en lage volatiliteit. Door beide factoren in aanmerking te nemen, kunnen we volgens ons een superieur voor risico gecorrigeerd rendement bieden in vergelijking met benaderingen op basis van één factor.

### Contactpersonen voor de media

Marijn Jongsma Bellier Financial – [marijn.jongsma@bellierfinancial.com](mailto:marijn.jongsma@bellierfinancial.com)

Edwin-Roland Nabbe, Bellier Financial – [edwin.nabbe@bellierfinancial.com](mailto:edwin.nabbe@bellierfinancial.com)

+31 20 419 0901

### AXA IM

AXA Investment Managers (AXA IM) is een actieve, wereldwijd opererende langetermijnbelegger in uiteenlopende activa. We werken met klanten aan de ontwikkeling van oplossingen die hen mede helpen vorm te geven aan een betere toekomst voor hun beleggingen. Tegelijkertijd trachten we een positieve omslag te bewerkstelligen voor de wereld waarin we allen leven. AXA IM heeft een vermogen onder beheer van circa €735 miljard (per eind juni 2017), biedt werk aan ruim 2.450 mensen wereldwijd en heeft 29 vestigingen in 21 landen. AXA IM maakt deel uit van de AXA Groep, een mondiale marktleider op het gebied van financiële bescherming en vermogensbeheer.

Bezoek onze website: [www.axa-im.com](http://www.axa-im.com)

Volg ons op Twitter @AXAIM

Bezoek ons mediacentrum: [www.axa-im.com/en/media-centre](http://www.axa-im.com/en/media-centre)

[www.axa-im.com](http://www.axa-im.com)  

# Press release

AXA Investment Managers UK Limited is op de markt toegelaten door en valt onder het toezicht van de Engelse financiële toezichthouder (Financial Conduct Authority). Dit persbericht geeft de stand van zaken per vandaag. Het is geen financiële promotie, zoals gedefinieerd door de financiële toezichthouder, en is uitsluitend bedoeld ter informatie. De hier gepresenteerde informatie is mogelijk niet geschikt voor particuliere klanten. Dit document is uitsluitend bedoeld voor professionele klanten in de zin van MiFID (2004/39/EC) en dient niet ter beschikking te worden gesteld aan particuliere klanten. Op basis van de verstrekte informatie dienen geen financiële beslissingen te worden genomen. Enige vermelding van een strategie is niet bedoeld ter promotie en duidt evenmin op de beschikbaarheid van een beleggingsinstrument.

Dit persbericht is uitsluitend voor informatieve doeleinden verspreid en vormt geen aanbod tot koop of verkoop van enig product of enige dienst van de groep bedrijven die onder AXA Investment Managers vallen ('de Groep') en dient niet te worden beschouwd als een uitnodiging of een aanbeveling om tot enige beleggingstransactie over te gaan.

Bovendien moet de informatie in dit document vanwege de vereenvoudiging als subjectief worden gezien. De standpunten in onderhavig document zijn geen beleggingsadvies, komen niet per se overeen met de standpunten van enig bedrijf binnen de Groep en kunnen wijzigingen ondergaan zonder voorafgaande kennisgeving, hoewel AXA Investment Managers daartoe niet verplicht is. Ofschoon de grootst mogelijke zorgvuldigheid is betracht, wordt geen garantie gegeven, uitdrukkelijk of stilzwijgend, (inclusief aansprakelijkheid jegens derden) met betrekking tot de nauwkeurigheid, betrouwbaarheid en volledigheid van de hier gepresenteerde informatie.

Onderhavige informatie dient niet te worden verspreid onder het grote publiek.

[www.axa-im.com](http://www.axa-im.com)  