



Fünf Jahre Global Data Sentiment: Quoniam aktualisiert KI-Sentiment-Modell und startet neuen Podcast "Generation Data"

- **Fünf Jahre Global Data Sentiment (GDS): Die Multi-Asset-Strategie überzeugt mit starkem Track Record und deutlicher Outperformance im Jahr 2025.**
- **GDS erhält neues KI-gestütztes Modell: Weiterentwickelte Analyse von Markterwartungen durch kontext- und zukunftsbezogene Auswertung von Nachrichten.**
- **Quoniam startet den Podcast „Generation Data“ und gibt Einblicke in systematisches Investieren und KI im Asset Management.**

Frankfurt am Main, 26. Februar 2026 – Quoniam Asset Management verbindet fünf Jahre erfolgreiche Global-Data-Sentiment-Strategie (GDS) mit dem Start des neuen Podcasts „Generation Data“ und einem weiteren Innovationsschritt: der Einführung eines optimierten KI-gestützten Sentiment-Modells.

Mit „Generation Data“ schafft Quoniam eine Plattform für den Dialog über systematisches Investieren und KI im Asset Management. Der Podcast gibt Einblicke, wie aus der Analyse großer Datenmengen robuste Investmentstrategien entstehen. Die erste Folge zeigt, wie moderne KI-Systeme marktbewegende Erwartungen aus Nachrichten erkennen und Fakten von Erwartungen trennen, bevor diese sich in Preisen widerspiegeln. Genau diese Signale fließen in die GDS-Strategie ein.

AI-Sentiment-Strategie: Fünf Jahre GDS und der nächste Innovationsschritt

Parallel zum Podcast-Start feiert die Multi-Asset-Strategie Global Data Sentiment (GDS) im Februar 2026 ihr fünfjähriges Track-Record-Jubiläum. Seit ihrer Auflegung kombiniert die Strategie klassische Kapitalmarktfaktoren mit datengetriebenen Sentiment-Signalen über mehrere Assetklassen hinweg.

Im Jahr 2025 erzielte GDS eine Rendite von +13,37 %. Mit einer Sharpe Ratio (Überschussrendite pro Einheit Risiko) von 1,12 fielen diese Erträge risikoadjustiert sehr überzeugend aus und lagen deutlich über relevanten Vergleichsindizes zur Messung von CTA-Strategien (siehe Tabelle 1). In einem Umfeld, das von starken Narrativen, abrupten Regimewechseln und erhöhter Unsicherheit geprägt war, profitierte die Strategie insbesondere von:

- frühzeitiger Signalgenerierung aus dem Nachrichtenfluss
- schneller Regimeerkennung
- dynamischer Multi-Asset-Allokation

Während viele preisbasierte Trendfolgestrategien verzögert reagierten, konnte GDS Stimmungs- und Erwartungsverschiebungen frühzeitig systematisch erfassen. „2025 war ein Jahr schneller Regimewechsel – mit dem Liberation Day und dem US Shutdown, um nur zwei Beispiele zu nennen. Unsere Stärke liegt darin, solche Erwartungsverschiebungen systematisch zu erkennen und sie diszipliniert in Portfolioentscheidungen zu übersetzen,“ sagt Dr. Markus Ebner, Head of Multi-Asset bei Quoniam.

Modellupdate: KI ersetzt reine Wortzählung

Anlässlich des Jubiläums wurde die Strategie technologisch weiterentwickelt. Ein neues KI-gestütztes Sentiment-Modell ersetzt klassische Wortzählansätze und ermöglicht eine deutlich präzisere Analyse von Kontext, Zukunftsbezug, semantischen Mustern und impliziten Markterwartungen. Die Datenbasis wurde erweitert und die Integration der Signale über Assetklassen hinweg weiter optimiert.

„Die Weiterentwicklung unseres Sentiment-Modells ist ein logischer nächster Schritt. Moderne KI ermöglicht es uns, Kontext und Zukunftsbezug von Nachrichten deutlich präziser zu analysieren als klassische Ansätze,“ betont Dr. Markus Ebner.

Tabelle 1: GDS-Kennzahlen im Vergleich zu CTAs im Jahr 2025

Strategie / Index	Rendite	Sharpe Ratio
Global Data Sentiment (GDS)	13,37 %	1,12
SocGen CTA Trend Index	3,04 %	0,30
SocGen CTA Index	0,56 %	0,07

Zeitraum: 30.12.2024 – 31.12.2025, Quelle: Bloomberg

[Hier](#) geht es zum Podcast „Generation Data“.

Weitere Informationen zu GDS finden Sie [hier](#).

[Pressefoto Dr. Markus Ebner](#)

Über Quoniam

Als führender aktiver, systematischer Asset Manager verwaltet Quoniam rund 24 Milliarden Euro, beschäftigt über 120 Mitarbeiter und unterhält Niederlassungen in Frankfurt und London. Quoniam ist nicht nur systematisch, sondern auch wissenschaftlich fundiert. Wir bieten professionellen Anlegern weltweit intelligentes Alpha und durchdachte Anlagestrategien, die in einer komplexen Welt für Klarheit und Präzision sorgen. Mehr Informationen unter: www.quoniam.com

Pressekontakt

Corporate Communications, Katja Höger, +49 69 74384 184, press@quoniam.com
Quoniam Asset Management GmbH, Westhafenplatz 1, 60327 Frankfurt am Main