

# Wie KI das Asset Management der Zukunft prägt

Fachtagung Performancemessung und GIPS 2024

—

2024 – Kerstin Manthey, Felix Schmidt, Benedikt Höck



# Agenda

## Inhalte

1	Begrüßung und Zielsetzung
2	Impulsvortrag zu KI im Asset Management: Use Cases und Live Demos
3	Vertiefung: Projektbeispiel Kursvalidierung bei Union Investment
4	Workshop: KI erfolgreich umsetzen
5	Ausblick: KI im Asset Management der Zukunft

**01**

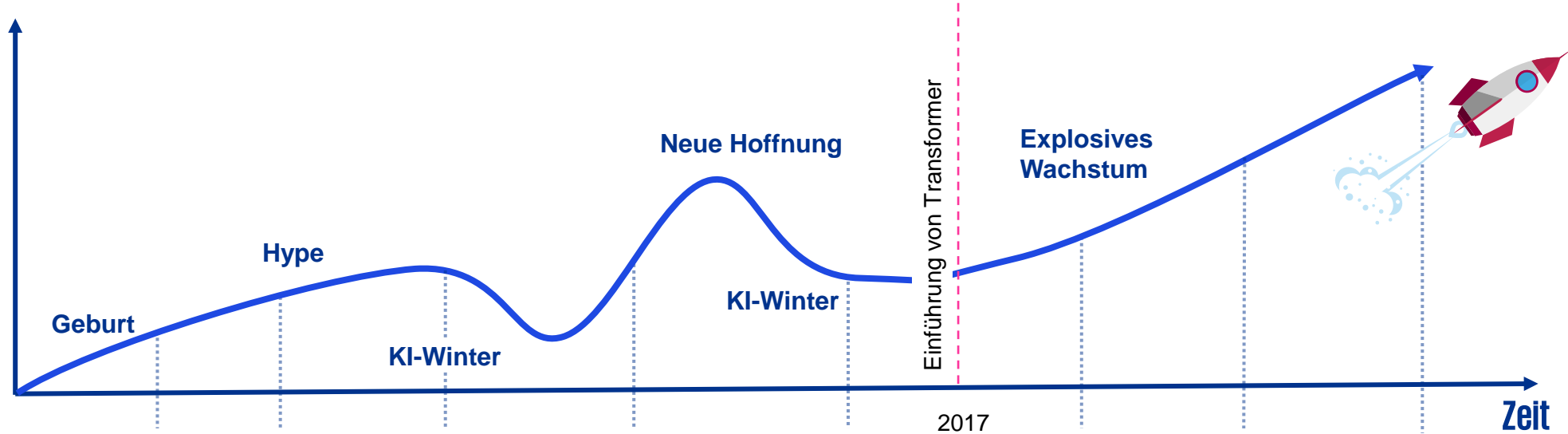
# **Begrüßung und Zielsetzung**

**02**

# **Impulsvortrag zu KI im Asset Management: Use Cases und Live Demos**

# Entwicklung von KI im Laufe der Zeit

Entwicklung



**Turing-Test:**  
Test zur  
Feststellung,  
welcher von zwei  
Agenten der  
Computer war

Frank Rosenblatt  
entwickelt den  
ersten Computer,  
**der lernen kann**

Erste Unter-  
haltung eines  
**Chatbot**

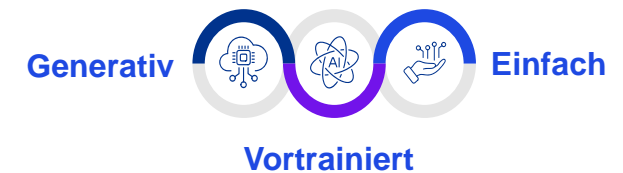
**Deep Blue** besiegt  
Gary Kasparov im  
Schach

**AlphaGo** gewinnt 4  
von 5 Go-Duellen  
gegen Lee Sedol

**GPT-2/3** kann  
selbständig  
englischsprachige  
Texte verfassen

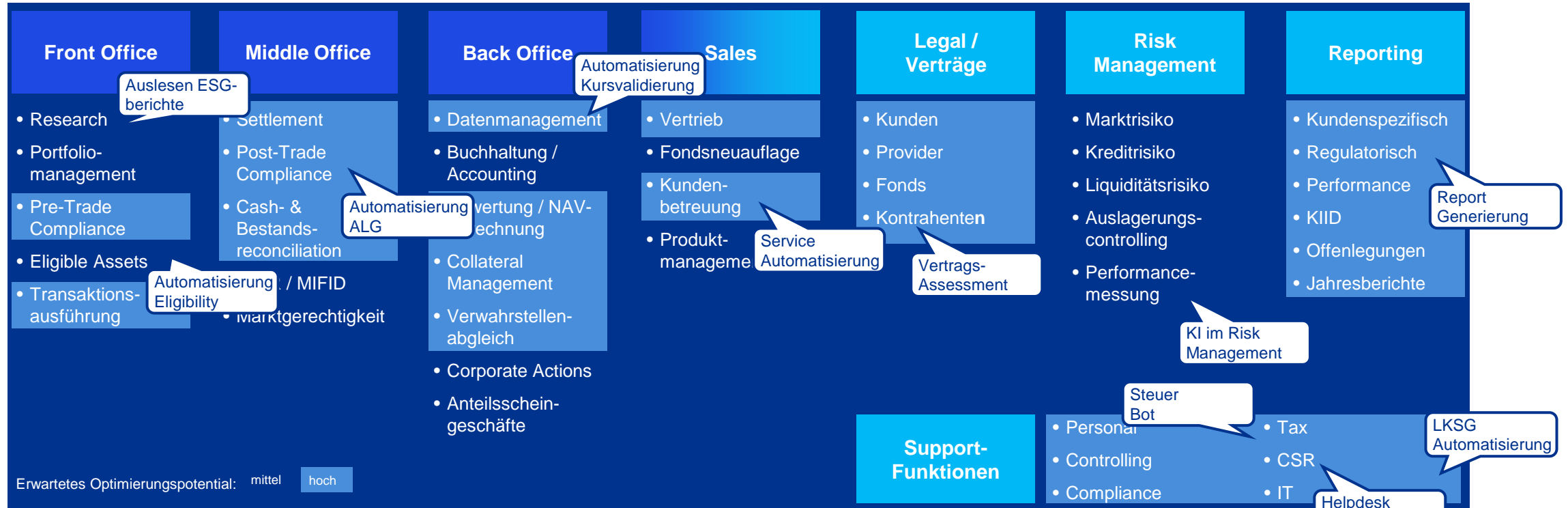
**ChatGPT** erobert die  
Welt und besteht  
Abschlussprüfungen

**GPT-4o** Multimodales  
Modell, das auf  
Testdatensätzen 40%  
besser ist als sein Vorgänger



# Use Cases entlang der AM-Wertschöpfungskette

Use Cases ergeben sich entlang der gesamten Wertschöpfungskette: Zur Prozessautomatisierung (oben) und zur Steigerung der individuellen Produktivität (unten).



**Produktivität: Intelligente Assistenten / Copiloten zur Unterstützung individueller Aufgaben**

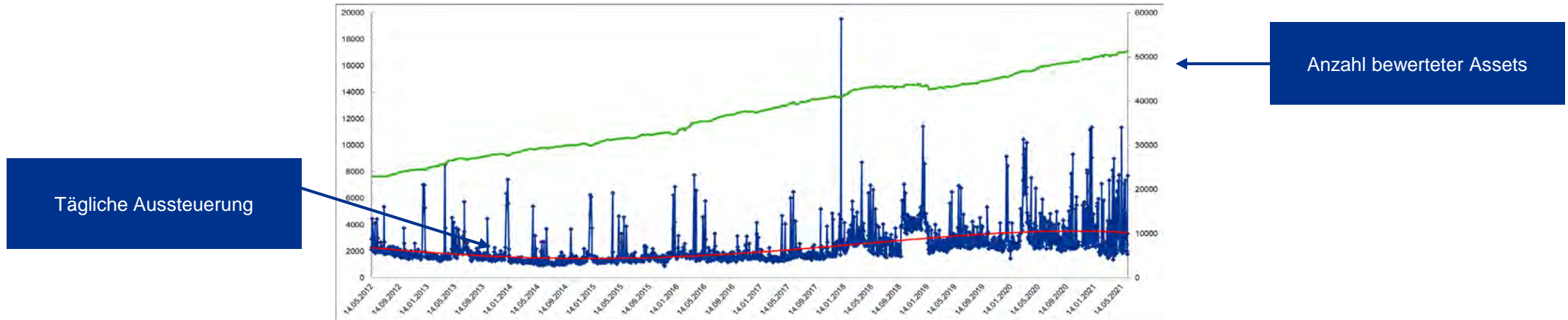


**03**

# **Vertiefung: Projektbeispiel Kursvalidierung bei Union Investment**



# Identifizierte Herausforderungen



Täglich werden in der Kursvalidierung über 50.000 Assets qualitätsgesichert und an verschiedene Abnehmersysteme weitergeleitet.

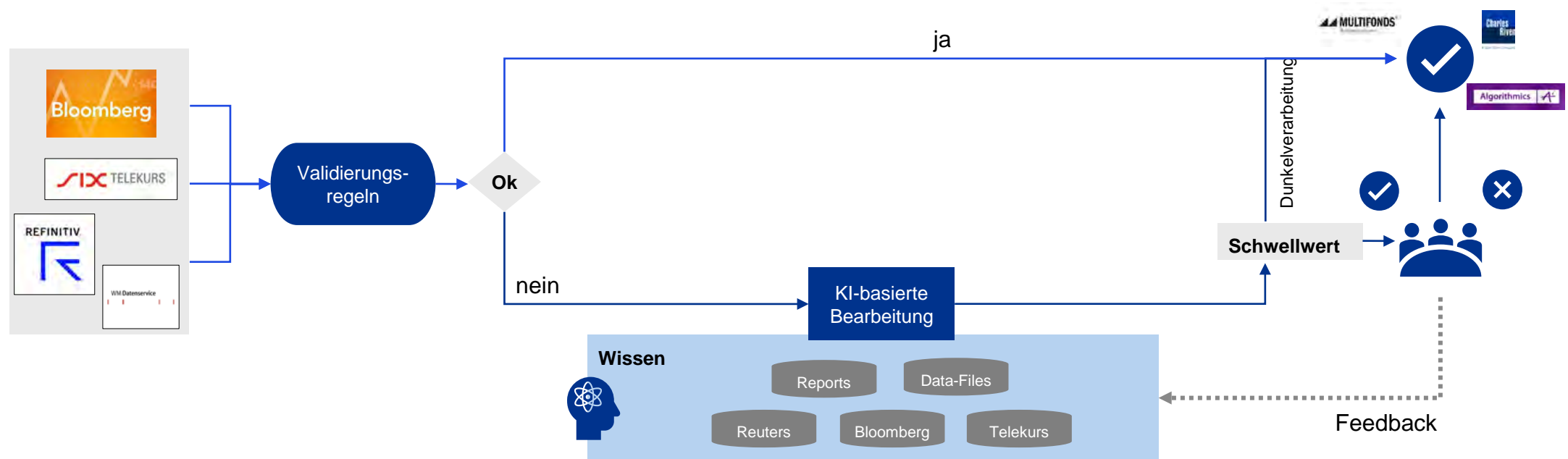


Im Schnitt werden 3.700 dieser Kurse täglich zur manuellen Nachbearbeitung ausgesteuert und anschließend manuell nachbearbeitet.



In den letzten 9 Jahren hat sich die Anzahl der zu bewertenden Assets um ca. 8 Prozent pro Jahr erhöht, sodass auch der manuelle Aufwand stark gestiegen ist.

# Zielbild und Umsetzung



Künftig werden Aussteuerungen zunächst von der KI bearbeitet. Die Mitarbeitenden agieren im Zielbild als Feedbackinstanz für die KI und verbessern die Qualität nachhaltig.



Im Rahmen eines pragmatischen Prototyps konnte bereits ein hohes Automatisierungspotenzial bestätigt werden. In der produktiven Umsetzung werden aktuell täglich etwa 40 % der an die KI gesendeten Assets validiert.

# Herausforderungen und potentiell mitigierende Lösungen

## Herausforderungen



## Lösungen



Assets die von KI nie (korrekt) validiert werden können

Ausschlussliste



Kontinuierliches Tracking der KI

Tableau Dashboard



KI trifft an einem Tag öfters falsche Entscheidungen

KI ausschalten



Überprüfung der Ergebnisse aus Dunkelverarbeitung

Report



**04**

# **Workshop: KI erfolgreich umsetzen**

# 2024 vom Hype zur seriösen Implementierung

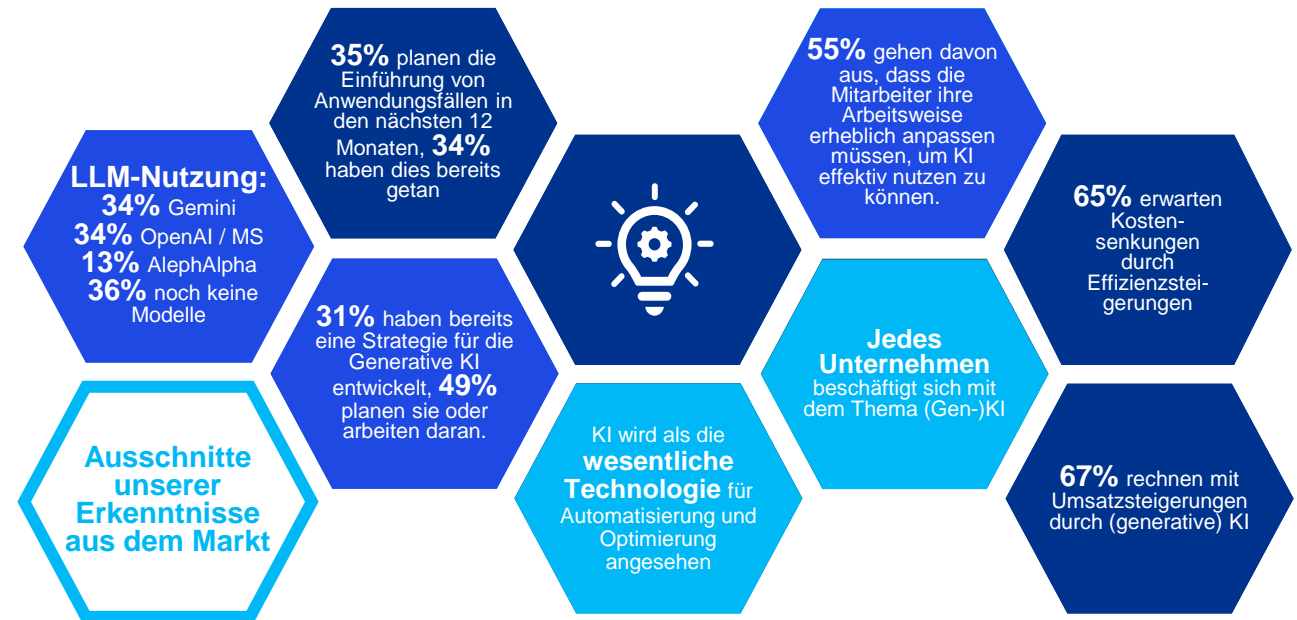
**Generative KI** erweitert die bestehenden KI-Fähigkeiten, indem sie die Analyse und Generierung von Inhalten aus einer Vielzahl von Quellen verbessert. Prompts werden für die Interaktion zwischen Mensch und Maschine verwendet, sodass (generative) KI eingesetzt werden kann, um Prozesse zu automatisieren oder die Produktivität des Einzelnen auf natürliche Weise zu steigern.

## Prozesse

- Hyper-Personalisierung
- Dokumentenverarbeitung
- Risikomanagement
- Portfoliomanagement

## Produktivität

- Erstellung von Inhalten
- Lernen
- Coding
- Zusammenfassungen



n = 284 Unternehmen DE

# Workshop



## Stimmungsbild

- Setzen Sie KI bereits im Unternehmen ein?
- Welche Use Cases stehen für Sie im Fokus?
- Welche Herausforderungen sehen Sie?

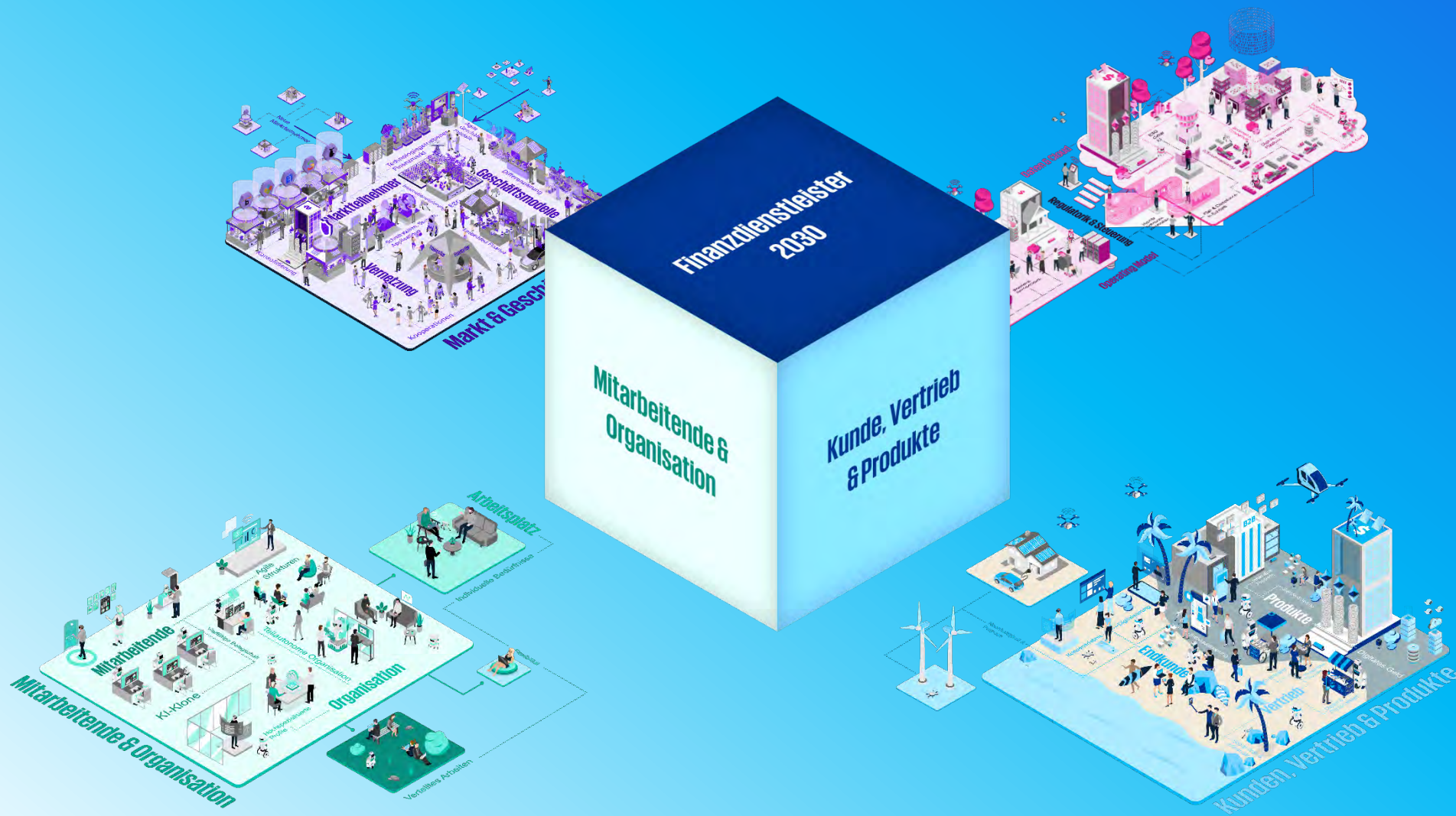
## Interaktiver Workshop

- Vorstellung und Diskussion Umsetzungsvorgehen
- Diskussion typischer Herausforderungen
- Aufzeigen von Lösungen

**05**

**Ausblick:  
Klim Asset Management  
der Zukunft**

# Das Zukunftsbild: KI im Fokus







**Kerstin Manthey**  
Gruppenleiterin Datenmanagement  
Union Investment



**Dr. Felix Schmidt**  
Senior Data Scientist  
Union Investment



**Benedikt Höck**  
Partner & Head of AI  
KPMG



Die enthaltenen Informationen sind allgemeiner Natur und nicht auf die spezielle Situation einer Einzelperson oder einer juristischen Person ausgerichtet. Obwohl wir uns bemühen, zuverlässige und aktuelle Informationen zu liefern, können wir nicht garantieren, dass diese Informationen so zutreffend sind wie zum Zeitpunkt ihres Eingangs oder dass sie auch in Zukunft so zutreffend sein werden. Niemand sollte aufgrund dieser Informationen handeln ohne geeigneten fachlichen Rat und ohne gründliche Analyse der betreffenden Situation.

© 2024 KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, eine Aktiengesellschaft nach deutschem Recht und ein Mitglied der globalen KPMG-Organisation unabhängiger Mitgliedsfirmen, die KPMG International Limited, einer Private English Company Limited by Guarantee, angeschlossen sind. Alle Rechte vorbehalten. Der Name KPMG und das Logo sind Marken, die die unabhängigen Mitgliedsfirmen der globalen KPMG-Organisation unter Lizenz verwenden.