

Kunstig intelligens står klar til at tæske aktiemarkedet

Udviklingen inden for kunstig intelligens eksploderer i disse år, og de smarte algoritmer finder i høj grad også vej til aktiemarkedet. Nu står en dansk virksomhed med navnet AI Alpha Lab klar til at slå løs på aktiemarkedet med deres egen algoritmemodel , og som betalende medlem af daytrader.dk kan du som noget helt nyt få direkte hjælp af AI-modellen, der kan fremvise flotte historiske resultater.

Du kan læse mere om de to medlemskaber her.

Du kan tilmelde dig vores gratis webinar med AI Alpha Lab her.

Men hvordan kan kunstig intelligens gøre os til en bedre trader og investor? Det spørgsmål har vi stillet Mikkel Brichthor Petersen, der er investeringsdirektør og medgrundlægger af AI Alpha Lab.

“Det handler først og fremmest om sandsynlighedsanalyse,” slår Mikkel Brichthor Petersen fast over for daytrader.dk



Mikkel Brichthor Petersen, investeringsdirektør og medgrundlægger af AI Alpha Lab

"Optimal beslutningstagen under usikkerhed." Det er ifølge Mikkel Brichthor Petersen, hvad enhver investor prøver at gøre. Og det er her, virksomhedens sandsynlighedsmodel kommer ind i billedet.

"Hvis du ikke bygger dine beslutninger på beregnede sandsynligheder, er det ligesom at spille poker og kun kende halvdelen af dine kort på hånden. Du mangler noget information til over tid at træffe de rigtige valg," fortæller han.

Det er netop den information, AI Alpha Lab hjælper investorerne med at få. Det sker ved at kombinere menneskelig erfaring med kunstig intelligens i en kvantitativ tilgang.

"Vi begyndte med en hypotese om, hvad der skulle til for at lave en bedre investeringsmodel. Det handler grundlæggende om beregning af sandsynligheden for, om en aktie skal stige eller falde. Den AI-model brugte vi 1,5 år på at bygge, og vi er blevet ved med at se rigtig gode resultater, siden vi sparkede modellen i gang i 2019," siger Mikkel Brichthor Petersen.

Men hvordan virker modellen så?

AI-modellen fungerer ved, at AI Alpha Lab giver den et aktieunivers, de gerne vil sige noget om, fx S&P 500-indekset. Herefter beregnes der millioner af modeller på hver eneste aktie med alle tænkelige scenarier. AI-modellen leverer her et estimat på, hvad hver aktie skal stige eller falde med, og samtidig leverer den som noget helt essentielt en usikkerhed på estimatet.

"Vi kan også forklare det ved at betragte modellerne som en slags analytikere. Med AI-modellen genererer vi millioner af analytikere, som alle kommer med deres bedste bud på, hvor aktien skal hen i løbet af den næste måned. Så kan vi udvælge de aktier til porteføljen, hvor vi kan se, at der er størst sandsynlighed for et positivt afkast. Resten gider vi ikke beskæftige os med. Og så kører vi analysen igen ugen eller måneden efter," forklarer Mikkel Brichthor Petersen og

fortsætter:

"Man skal huske, at det mest sandsynlige ofte ikke er det, der sker. Med modellen kommer man ikke til at vinde hver måned, men hvis vi spiller på de rigtige hænder over tid, er sandsynligheden for at skabe god værdi stor. Det kræver altså, at man holder fast – også i de perioder, hvor det ikke går lige så godt."



Hver uge og måned vælger AI Alpha Labs probabilistiske AI-model de 5 aktier fra S&P 500-indekset, som den estimerer, vil have den højeste sandsynlighed for at klare sig bedre i løbet af enten den kommende uge eller måned tid. Rundt om modellens stock picks er bygget to forskellige strategier med hver sin risikostyring. Det er disse to strategier, man kan få adgang til som medlem. Læs mere om de to medlemskaber [her](#).

Kompliceret teknologi koger ned til et output, der kan bruges af alle

AI Alpha Lab sørger løbende for at træne modellen og "fodre" den med deres erfaring, information og data. Det, modellen "spytter ud", koger AI Alpha Lab ned til et endeligt output, der er nemt at bruge: Stock picks hvor alle aktier har en

sandsynlighed for at give et merafkast den følgende uge eller måned.

"Jo bedre en investor, man putter oven på modellen, jo bedre resultater får man. Men det kan i teorien bruges af alle, og vi kan se, at det også vil kunne skabe værdi for den mindre erfarne investor at tage nogle af vores aktier ind i sin portefølje. Det kan måske endda gøre dem i stand til at slå de professionelle og til en helt anden omkostning, end det de betaler i deres egen bank eller pensionsselskab," lyder det fra Mikkel Brichthor Petersen.

Du kan læse mere om de to medlemskaber her.

Du kan tilmelde dig vores gratis webinar med AI Alpha Lab her.

En af grundene til, at AI Alpha Lab kan lave så gode resultater, er, at der ikke er mange, der gør det samme. Derfor har det heller ikke været uden problemer at udbrede brugen af modellen.

"Nu er vi i gang med at vise, hvad vi kan. Vi er oppe imod, at vi er en ung virksomhed, fordi teknologien også er så ny, som den er. Det har været en udfordring, da mange gerne vil forstå, hvad de investerer i. Og det kan godt være et problem, når vi kommer med en AI-model som vores, hvis man ikke har baggrunden til at forstå helt ind i maven, hvordan det foregår."

"Men hvis man vil have del i de helt store fordele, som en ny teknologi kan give, skal man være med fra start. Måske skal man tage, hvad man synes er en risiko, fordi man hopper med før mange andre. Men det er også der, de store gevinster er at hente," slutter Mikkel Brichthor Petersen.



Ovenstående performance er baseret på simulerede afkast simuleret strategipræstation for S&P 500 Long/Short-strategien i perioden 01.01.2020 – 30.04.2023 i dollar. Performance er inklusive 20 bps i transaktions-omkostninger på alle handleral handlet værdi. Gebyrer pådraget af investor, såsom administrations- og depotgebyrer, er ikke inkluderet. De viste afkast er simulerede og udgør derfor ikke afkast fra en faktisk investering i perioden. Det understreges, at historiske afkast – hvad enten de er faktiske eller simulerede – ikke er en garanti for fremtidige afkast, og afkast kan variere som følge af valutaudsving. Læs mere om de to medlemskaber her.

Fremover kan du få indblik i tankerne bag AI-modellen, hvis du er TRADER Basic eller TRADER PRO-medlem hos daytrader.dk. Alt efter medlemskab vil du hver uge eller hver måned modtage en rapport, hvori AI Alpha Lab vælger 5 aktier fra S&P 500-indekset, som den estimerer vil have den højeste sandsynlighed for at klare sig bedre i løbet af enten den kommende uge eller måned. Rundt om modellens stock picks er bygget to forskellige strategier med hver sin risikostyring. Det er disse to strategier, man kan få adgang til som medlem. Du kan læse meget mere om de to medlemskaber her.

yes

Disclaimer Headline Til orientering:

Disclaimer Text Hos daytrader.dk skaber vi gratis indhold og læringsforløb for jer brugere. Det kan vi blandt andet gøre, fordi vi indgår samarbejde med brokerne, der betaler for omtale på siden.

daytrader.dk