EDMOND DE ROTHSCHILD

EDR FUND QUAM 5 A-EUR

EDR FUND QUAM 5 A-EUR

SICAV FÜR DIVERSIFIZIERTES QUANTITATIVES MANAGEMENT

FONDSVOLUMEN : 26,49 Mio.EUR

Alle Anleger : CH DE ES FR IT LU NL PT

Eingeschränkte Registrierung / Qualifizierte Anleger : SG

Niedrigeres Anlagerisiko — Höheres Anlagerisiko

Niedrigeres Ertragspotenzial — Höheres Ertragspotenzial

1	2	**3**	4	5	6	7

Der Risikoindikator SRI wird auf einer Skala von 1 bis 7 dargestellt. Dieser Indikator wird verwendet, um das Risiko dieses Produkts im Vergleich zu anderen Fonds zu bewerten, und ein Rating der Kategorie 1 bedeutet nicht, dass die Anlage risikofrei ist. Darüber hinaus gibt er die Wahrscheinlichkeit an, dass dieses Produkt im Falle von Marktbewegungen oder unserer Unfähigkeit, Sie auszuzahlen, Verluste erleidet. Dieser Indikator geht davon aus, dass Sie das Produkt bis zum Ende der empfohlenen Haltedauer dieses Fonds halten. Das tatsächliche Risiko kann ganz anders sein, wenn Sie vor dem Ende der empfohlenen Haltedauer dieses Fonds aussteigen.

Informationen zum Fonds

Rechtsform

Auflagedatum : 04/11/2003
Empfohlener Anlagehorizont : 3 Jahre
Fondsdomizil : Luxemburg

Verwaltungsinformationen

Verwaltungsgesellschaft : Edmond de Rothschild Asset Management (Luxembourg)
Verwaltungsgesellschaft mit Vollmacht : Edmond de Rothschild (Suisse) S.A.
Bewertung : Täglich
Verwaltung : Edmond de Rothschild Asset Management (Luxembourg)
In Dezimalien : 3 Dezimalstellen
Depotbank : Edmond De Rothschild (Europe)
Mindestanfangsinvestition : -
Zeichnungs- und Rücknahmebedingungen : Täglich bis 16.00 Uhr auf der Grundlage des Nettoinventarwerts am Tag T+1(Ortszeit Luxemburg)

Verwaltungs-/Zeichnungs-/Rücknahmegebühren*

Verwaltungsgebühren : 1%
Performancegebühren : nein
Ausgabeaufschlag (max) : 2%
Rücknahmeabschlag (max) : 0,5%

* Gebühren: Es sind nicht alle Kosten aufgeführt, weitere Einzelheiten entnehmen Sie bitte dem BIB/Verkaufsprospekt.

Anteilsklasse

Nettoinventarwert (EUR) :	125,72
Auflegungsdatum (der Klasse) :	04/11/2003
ISIN-Code :	LU1005537912
Bloomberg-Code :	EDRQ5AE LX
Lipper-Code :	68246395
Telekurs-Code :	23092619
Gewinnverwendung :	Kapitalisierung
Letzter Kupon :	-

Fondsmanager

Antonio CIRULLI,Benjamin DUBOIS

Die in diesem Dokument vorgestellten Portfoliomanager sind möglicherweise nicht über die gesamte Laufzeit des Produkts identisch.

ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Anlageziel

Der Teilfonds verfolgt eine klar definierte Strategie für die Platzierung von Vermögen auf der Grundlage einer Steuerung des jährlichen Volatilitätsrisikos des Portfolios. Kauf- und Verkaufsentscheidungen basieren auf mittelfristig quantitativen Systemen. Die Vermögensanlage wird an vorherrschende Marktbedingungen angepasst und verfolgt das Ziel, eine mittlere jährliche Volatilität von 5 % nicht zu überschreiten. Mit diesem Ziel ist keinerlei Garantie verbunden, dass die mittlere jährliche Volatilität niemals über 5 % steigt. Der Teilfonds wird aktiv verwaltet.

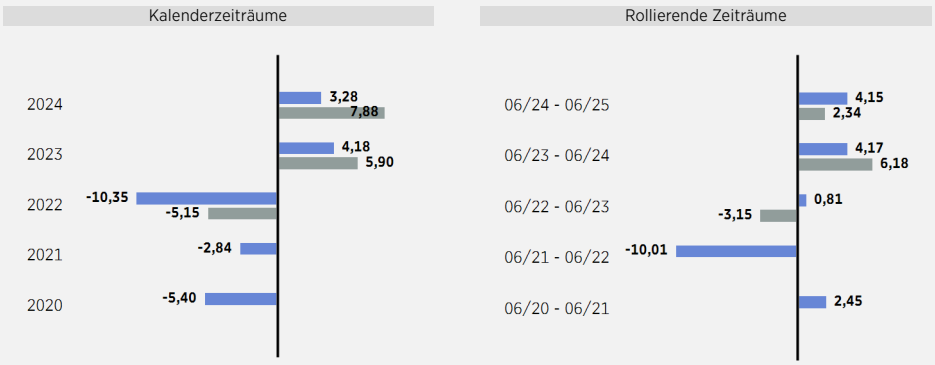
PERFORMANCE

Entwicklung Performance (Basis 100 - Netto, nach Abzug von Gebühren)

Referenzindex (Index): 80% Bloom Barclays GlobalAgg + 20% MSCI AC World (local) (NR) (EUR)

Die Wertentwicklung und Volatilität der Vergangenheit ist kein Indikator für zukünftige Wertentwicklungen und Volatilität. Diese sind im Zeitverlauf nicht konstant und können unabhängig von Wechselkursänderungen beeinflusst werden. Die angegebenen Wertentwicklungen berücksichtigen nicht die Kosten und Provisionen, die bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen anfallen, sondern beinhalten die laufenden Kosten, die Vermittlungsgebühren, sowie eventuell erhobene Performancegebühren.

Jährliche Wertentwicklungen (Netto, nach Abzug von Gebühren)



Wertentwicklung per 30 Juni 2025 (Netto, nach Abzug von Gebühren)

	Kumuliert							Annualisiert
	1 Monat	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Seit Auflegung	Seit Auflegung
Klasse (A)	1,25	3,19	4,15	9,37	0,83	-10,03	25,72	1,06
Index	-0,40	-2,87	2,34	-	-	-	-	-

Werbung. Bitte lesen Sie den Verkaufsprospekt und das Basisinformationsblatt (BIB), bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen.
Die vergangene Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Die Daten zur Wertentwicklung werden auf der Basis wiederangelegter Dividenden berechnet.
EDMOND DE ROTHSCHILD FUND 4, rue Robert Stumper- L-2557 Luxembourg. - Offene Investmentgesellschaft - B76441 Handelsregister Luxemburg USt.-Id.Nr.: LU21693120

STATISTIK UND PERFORMANCEANALYSE

Statistik (Rollierende Zeiträume)

	52 wochen (wöchentl. Perf.)		3 Jahre (monatl. Perf.)	5 Jahre (monatl. Perf.)
	Klasse	Index	Klasse	Klasse
Volatilität (%)	3,82	6,46	3,08	3,60
Tracking Error (%)	5,62			
Sharpe-Ratio	0,27	-0,11	0,08	-0,36
Information-Ratio	0,32			
Alpha	0,06			
Beta	0,31			
R2	0,27			
Korrelationsverhältnis	0,52			

Performanceanalyse

	Seit 04/11/2003 (monatl. Perf.)
% positive Performance	56,37
Maximaler Verlust (%)	-7,04
Maximaler Gewinn (%)	2,59

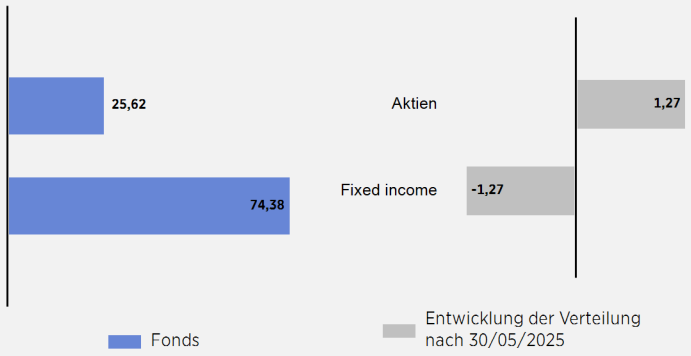
ENTWICKLUNG DER PERFORMANCE (%)

Nettoperformance

		Jan.	Feb.	März	April	Mai	Juni	Juli	Aug.	Sept.	Okt.	Nov.	Dez.	YTD
2016	Klasse (A)	-0,16	0,09	-0,01	-0,13	-0,19	0,29	0,50	0,21	-0,71	-0,36	-0,44	0,10	**-0.83**
2017	Klasse (A)	-0,15	0,46	-0,20	0,91	0,68	-0,83	0,62	0,17	-0,22	0,55	-0,15	-0,20	**1.64**
2018	Klasse (A)	1,14	-1,61	-1,30	-0,90	-0,73	-0,09	-0,01	0,63	-0,34	-3,11	0,14	-0,29	**-6.36**
2019	Klasse (A)	1,30	-0,40	1,54	0,05	-0,85	2,36	1,93	0,46	-1,10	-0,39	0,18	0,85	**6.02**
2020	Klasse (A)	-0,28	-2,61	-7,04	0,25	0,19	0,06	0,87	0,37	-0,24	-0,53	2,43	1,31	**-5.40**
2021	Klasse (A)	-0,11	-1,64	-0,25	0,48	-0,19	-0,03	0,70	-	-1,89	0,93	-0,23	-0,61	**-2.84**
2022	Klasse (A)	-2,19	-1,51	-1,09	-1,78	-0,62	-2,14	0,51	-0,58	-1,84	0,75	0,93	-1,26	**-10.35**
	Index	-	-	-	-	-	-	3,13	-2,66	-3,79	-0,05	1,66	-3,34	**-5.15**
2023	Klasse (A)	1,10	-0,43	0,24	0,55	-0,23	1,10	0,57	-0,45	-1,15	-0,62	1,75	1,72	**4.18**
	Index	2,49	-1,18	1,08	-0,65	1,17	-0,78	0,34	-0,25	-1,09	-1,36	3,00	3,12	**5.90**
2024	Klasse (A)	0,37	0,66	0,84	-0,54	0,76	0,22	0,16	0,63	1,14	-1,12	0,62	-0,48	**3.28**
	Index	0,49	0,21	1,27	-1,78	0,56	1,66	1,67	0,43	1,09	-0,74	3,33	-0,47	**7.88**
2025	Klasse (A)	1,31	0,54	-0,85	-0,34	1,26	1,25	-	-	-	-	-	-	**3.19**
	Index	0,80	0,96	-3,38	-1,74	0,93	-0,40	-	-	-	-	-	-	**-2.87**

PORTFOLIOANALYSE

Verteilung nach Art der Vermögenswerte (Gewicht in %)

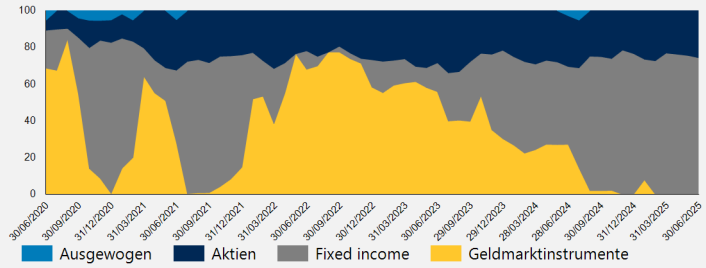


Wichtigste Positionen (ohne Geldmarkt)

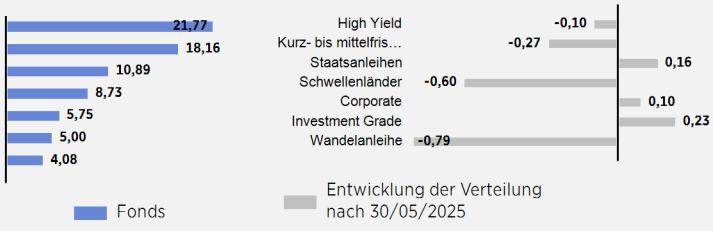
10 Wichtigste Positionen (Gesamtzahl der Positionen : 22)

	Sektor	Engag. (% NV)
EDRS - ULTIM I - EUR (H)	Geografisch	10,34
EDRS - EQUITY EURO SOLVE I - EUR	Geografisch	8,24
GROUPAMA CRÉDIT EURO CT M	Kurz- bis mittelfristi	6,23
AXA IM FIIS-EUR SH DUR H-BI	High Yield	6,23
PIMCO GIS-CAPITAL SEC-IA	Corporate	5,53
MORGAN ST-EUROP CURR HY-Z	High Yield	5,34
GENERALI INV-C&E EUR BD-BX	Investment Grade	4,80
CANDR BONDS-E HIGH YIELD-I-C	High Yield	4,78
SCOR EURO HIGH YIELD	High Yield	4,57
ISHARES USD TRES BOND 7-10Y	Staatsanleihen	4,50
Total		**60,55**

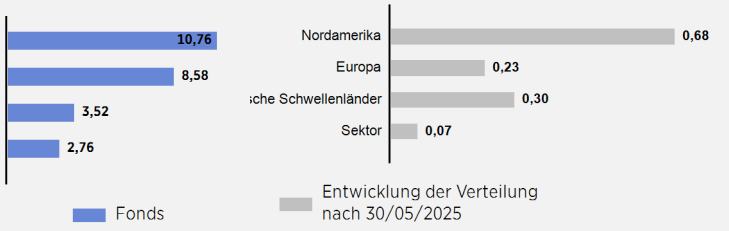
Entwicklung der Verteilung nach Anlageklasse (% des Vermögens)



Aufteilung nach Branchen Anleihen (Gewicht in %)



Geographische Aufteilung Aktien (Gewicht in %)



Werbung. Bitte lesen Sie den Verkaufsprospekt und das Basisinformationsblatt (BIB), bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen.
Die vergangene Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Die Daten zur Wertentwicklung werden auf der Basis wiederangelegter Dividenden berechnet.
EDMOND DE ROTHSCHILD FUND 4, rue Robert Stumper- L-2557 Luxembourg. - Offene Investmentgesellschaft - B76441 Handelsregister Luxemburg USt.-Id.Nr.: LU21693120

RISIKEN

Die nachstehend aufgeführten Risiken sind nicht erschöpfend (weitere Einzelheiten entnehmen Sie bitte dem Prospekt):

Aktienrisiko
Der Wert einer Aktie kann sich abhängig von Faktoren entwickeln, die mit der entsprechenden Gesellschaft zusammenhängen, jedoch auch abhängig von externen politischen oder wirtschaftlichen Faktoren. Die Schwankungen der Aktienmärkte sowie der Märkte für Wandelanleihen, deren Entwicklung teilweise von derjenigen der zugrunde liegenden Aktien abhängt, können erhebliche Schwankungen des Nettovermögens verursachen. Dadurch kann die Wertentwicklung des Nettoinventarwerts des Fonds negativ beeinflusst werden.

Inflationsrisiko
Der teilfonds ist Risiken im Zusammenhang mit der Inflation, d. h. dem allgemeinen Preisanstieg, ausgesetzt. Die Höhe der Inflation wirkt sich auf die Zinsentwicklung und damit auf Geldmarktinstrumente aus.

Liquiditätsrisiko
Die Märkte, auf denen sich der Teilfonds engagiert, können gelegentlich von einem Liquiditätsmangel betroffen sein. Diese Marktbedingungen können sich auf die Preise auswirken, zu denen der Teilfonds Positionen auflöst, aufbaut oder ändert.

Zinsrisiko
Das Engagement gegenüber Zinsprodukten (Schuldtitel und Geldmarktinstrumente) macht den OGAW anfällig gegenüber Zinssatzschwankungen. Das Zinsrisiko besteht in Form einer eventuellen Verringerung des Werts des Wertpapiers und somit des Nettoinventarwerts des OGAW im Falle einer Schwankung der Zinskurve.

Bonitätrisiko
Das Hauptrisiko in Verbindung mit Forderungspapieren und/oder Geldmarktinstrumenten wie Staatsanleihen (BTF und BTAN) oder kurzfristigen handelbaren Wertpapieren besteht in einem Ausfall des Emittenten, wovon die Zinszahlungen und/oder die Kapitalrückerstattung betroffen sein können. Das Kreditrisiko ist außerdem an die Zurückstufung eines Emittenten gekoppelt. Der Aktionär wird darauf aufmerksam gemacht, dass sich der Nettoinventarwert des Teilfonds verringern kann, falls bei einem Finanzinstrument durch den Ausfall eines Emittenten ein Totalverlust eintritt. Da das Portfolio direkt oder über OGA Forderungspapiere umfassen kann, ist der Teilfonds Auswirkungen von Schwankungen der Kreditwürdigkeit ausgesetzt.

Wechselkursrisiko
Das Kapital kann Wechselkursrisiken ausgesetzt sein, falls dessen Titel oder Anlagen auf eine andere Währung lauten als die Währung des Teilfonds. Das Wechselkursrisiko entspricht dem Risiko des Wechselkursverfalls der Notierungswährung der im Portfolio enthaltenen Finanzinstrumente im Vergleich zur Referenzwährung des Teilfonds (Euro) und kann zu einem Rückgang des Nettoinventarwerts führen.

DEFINITIONEN UND METHODEN

Die folgenden Definitionen und Methoden erheben keinen Anspruch auf Vollständigkeit und können unter https://medianet.edmond-de-rothschild.fr/edram/pdf/Methodology_fr.pdf und gegebenenfalls in den herunterladbaren Dokumenten des Fonds unter https://funds.edram.com/ eingesehen werden.

Die VOLATILITÄT eines Wertpapiers ist die Differenz zwischen der tatsächlichen und der durchschnittlichen Performance und ermöglicht es, die Konstanz der erzielten Performance zu messen. Sie stellt ein Risikomaß dar. Beträgt sie Null, ist die Performance jeweils identisch. Je höher sie ist, um so größer ist der Unterschied zwischen den einzelnen Performances.

Der TRACKING ERROR (verfügbar, wenn der Fonds über einen Referenzindex verfügt) gibt die Volatilität der relativen Performance des Produkts im Vergleich zum Referenzindex an. Er zeigt den Unterschied zwischen den Performances und ihrem jeweiligen Durchschnitt und ermöglicht so, die Konstanz der relativen Performance zu messen. Je geringer der Tracking Error, desto genauer entspricht die Performance des Produkts jener des Referenzindex.

Das ALPHA entspricht der durchschnittlichen Performance des Produkts. Genauer gesagt, misst es den vom Fondsmanager erzielten Mehrwert unter Ausschluss von Markteinflüssen, die nicht kontrolliert werden können. Diese Kennzahl wird als Prozentwert angegeben.

Die SHARPE RATIO zeigt, wie stark die Performance des Produkts, bereinigt um die Volatilität des Produkts, einen risikofreien Zinssatz übersteigt.

PRODUKTHINWEISE

Das vorliegende Dokument wurde am 30/06/2025 von Edmond de Rothschild Asset Management (France) – 47 rue du Faubourg Saint-Honoré – 75401 Paris Cedex 08 – Frankreich; AG mit Vorstand und Aufsichtsrat, Stammkapital: 11.033.769 Euro – AMF-Zulassungsnummer: GP 04000015 – 332.652.536 Handelsregister – herausgegeben. Paris – www.edr.com.

Globale Vertriebsstelle: Edmond de Rothschild Asset Management (France)

EdR Fund QUAM 5 ist ein Teilfonds der von der CSSF zugelassenen Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (SICAV) EDMOND DE ROTHSCHILD FUND luxemburgischen Rechts. Dieser Fonds ist ein Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW/UCITS).

Dieses Dokument hat keinen vertraglichen Charakter und dient nur zur Information. Die Vervielfältigung oder Verwendung des gesamten Inhalts oder eines Teils davon ohne die vorherige Genehmigung der Edmond de Rothschild Gruppe ist streng untersagt.
Wenn in einem Land entsprechende Angebote oder Transaktionsaufforderungen unzulässig sind oder der Urheber der entsprechenden Angebote oder Transaktionsaufforderungen in einem Land nicht handlungsbefugt ist, sind die im vorliegenden Dokument enthaltenen Informationen nicht als Angebot oder Transaktionsaufforderung zu verstehen. Das Dokument ist weder als Anlage-, Rechts- oder Steuerberatung noch als Empfehlung für Kauf, Verkauf oder Halten von Anlagen gedacht und darf nicht als solche aufgefasst werden. Die Edmond de Rothschild Gruppe haftet nicht für die auf der Grundlage der in diesem Dokument enthaltenen Informationen getroffenen Entscheidungen, Anlagen zu kaufen oder zu veräußern.
Dieses Dokument wurde von keiner Aufsichtsbehörde in irgendeiner Rechtsordnung geprüft oder genehmigt. Die Vorschriften für die Vermarktung dieses Fonds können von Land zu Land unterschiedlich sein. Der vorgestellte Fonds ist in Ihrem Wohnsitzland möglicherweise nicht zum Vertrieb zugelassen. Sollten Sie nicht wissen, ob Sie diesen Fonds zeichnen dürfen, wenden Sie sich bitte an Ihren gewohnten Berater.

Die in diesem Dokument enthaltenen Zahlen, Kommentare, zukunftsgerichteten Aussagen und sonstigen Informationen spiegeln die Einschätzung der Märkte und ihrer Entwicklung durch die Edmond de Rothschild Gruppe unter Berücksichtigung des wirtschaftlichen Umfelds und der zum jetzigen Zeitpunkt verfügbaren Informationen wider. Sie können an dem Tag, an dem der Anleger sie liest, nicht mehr aktuell sein. Die Edmond de Rothschild Gruppe kann daher nicht für die Qualität oder Richtigkeit der von Dritten erhaltenen wirtschaftlichen Informationen und Daten verantwortlich gemacht werden.
Informationen über Titel sind nicht als Einschätzung der Edmond de Rothschild Gruppe in Bezug auf die voraussichtliche Entwicklung dieser Werte beziehungsweise die voraussichtliche Kursentwicklung bei den von ihnen ausgegebenen Finanzinstrumenten aufzufassen. Diese Informationen sind nicht als Empfehlungen für den Kauf oder Verkauf dieser Titel zu verstehen.
Die Zusammensetzung des Portfolios kann sich im Laufe der Zeit ändern.
Jede Anlage ist mit spezifischen Risiken verbunden. Den Anlegern wird daher empfohlen, sich zu vergewissern, dass jede Anlage für ihre persönliche Situation geeignet ist, und gegebenenfalls eine unabhängige Beratung in Anspruch zu nehmen. Investieren in einen Fonds bedeutet, dass Sie Anteile oder Aktien des Fonds besitzen und nicht die zugrunde liegenden Vermögenswerte, die der Fonds möglicherweise hält.

Vor einer Anlage sollten Anleger alle Merkmale oder Ziele des Produkts, einschließlich der Nachhaltigkeit (sofern zutreffend), berücksichtigen. Darüber hinaus sollten die Anleger den Verkaufsprospekt, das Basisinformationsblatt (BIB) und/oder alle anderen aufgrund lokaler Vorschriften erforderlichen Dokumente zur Kenntnis nehmen. Diese werden den Anlegern vor jeder Zeichnung zur Verfügung gestellt und sind auf Französisch und/oder Englisch und/oder in einer anderen offiziellen Sprache auf der Website https://funds.edram.com oder auf Anfrage kostenlos erhältlich.

Eine Zusammenfassung der Rechte der Anleger in französischer und/oder englischer Sprache ist unter folgendem Link abrufbar: https://www.edmond-de-rothschild.com/SiteCollectionDocuments/LegalWebPartSiteDocument/France/_documents-reglementaires/EdRAM-France/EDRAM-FR-Principaux-droits-des-investisseurs.pdf
Die Verwaltungsgesellschaft kann beschließen, den Vertrieb dieses Fonds in Übereinstimmung mit Artikel 93a der Richtlinie 2009/65/EG und Artikel 32a der Richtlinie 2011/61/EU einzustellen.
„Edmond de Rothschild Asset Management" beziehungsweise „EdRAM" sind die Handelsnamen der Asset-Management-Gesellschaften der Edmond de Rothschild Gruppe.

Die steuerliche Behandlung hängt von der individuellen Situation des jeweiligen Kunden ab und kann sich nachträglich ändern.

Die Verwaltungsgesellschaft kann als Vergütung einen Anteil der Finanzverwaltungskosten dieses Fonds an Vermittler wie Wertpapierfirmen, Versicherungsgesellschaften, Verwaltungsgesellschaften, Strukturierungsstellen, Vertriebsstellen oder Vertriebsplattformen zahlen, mit denen eine Vereinbarung im Zusammenhang mit dem Vertrieb, der Platzierung von Anteilen des Fonds oder der Herstellung von Kontakten zu anderen Anlegern unterzeichnet wurde. Diese Vergütung ist variabel und hängt von der bestehenden Geschäftsbeziehung mit dem Vermittler und der Verbesserung der Qualität der für den Kunden erbrachten Dienstleistung ab, die der Empfänger dieser Vergütung nachweisen kann. Diese Vergütung kann pauschal erfolgen oder auf der Grundlage der gezeichneten Nettovermögenswerte berechnet werden, die sich aus der Tätigkeit des Vermittlers ergeben. Der Vermittler kann Mitglied der Edmond de Rothschild Gruppe sein oder nicht. Jeder Vermittler wird dem Kunden gemäß den für ihn geltenden Vorschriften alle zweckdienlichen Informationen über Kosten und Gebühren sowie seine Vergütung mitteilen.

Dieses Dokument richtet sich nicht an die Bürger oder Gebietsansässigen der Vereinigten Staaten von Amerika oder an „U.S. Persons" gemäß deren Definition in „Regulation S" des amerikanischen Wertpapiergesetzes von 1933. Kein hier vorgestelltes Anlageprodukt ist gemäß den Bestimmungen des Wertpapiergesetzes von 1933 oder sonstiger in den USA geltender Vorschriften zum Vertrieb zugelassen. Infolgedessen kann kein Anlageprodukt direkt oder indirekt in den Vereinigten Staaten von Amerika Gebietsansässigen und Bürgern der Vereinigten Staaten von Amerika und „U.S. Persons" angeboten oder an diese verkauft werden.

Schweiz: Der in diesem Dokument genannte Teilfonds wurde von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht (FINMA) genehmigt und darf in der Schweiz nicht qualifizierten Anlegern angeboten werden.
Prospekte, Jahres- und Halbjahresberichte, Basisinformationsblätter (BIB), Statuten (oder Reglemente) sind auf Anfrage beim Vertreter in der Schweiz kostenlos erhältlich oder können unter https://funds.edram.com/ heruntergeladen werden.
Vertreter und Zahlstelle in der Schweiz: Edmond de Rothschild (Suisse) S.A. 18, rue de Hesse, 1204 Genf, Schweiz.

Spanien: EDMOND DE ROTHSCHILD FUND ist bei der CNMV unter der Nummer 229 registriert.

Sofern nicht anders angegeben, sind die im vorliegenden Dokument verwendeten Quellen die der Edmond de Rothschild Gruppe.
Daten von Dritten: Die Anleger nehmen zur Kenntnis, dass Edmond de Rothschild für Analysen und Dienstleistungen Daten verwendet, die von Dritten zur Verfügung gestellt werden. Edmond de Rothschild ist berechtigt, sich ohne vorherige Prüfung auf diese Daten zu verlassen und übernimmt keine Gewähr für deren Richtigkeit und Vollständigkeit.
© Copyright Edmond de Rothschild. Alle Rechte vorbehalten.