EDMOND DE ROTHSCHILD

EDR FUND QUAM 5 A-USD (H)

EDR FUND QUAM 5 A-USD (H)

SICAV FÜR DIVERSIFIZIERTES QUANTITATIVES MANAGEMENT

FONDSVOLUMEN : 31,10 Mio.USD

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%

Anteilsklasse

Nettoinventarwert (USD) :	144,13
Auflegungsdatum (der Klasse) :	04/11/2003
ISIN-Code :	LU1005538217
Bloomberg-Code :	EDRQ5AU LX
Lipper-Code :	68246396
Telekurs-Code :	23093136
Gewinnverwendung :	Kapitalisierung
Letzter Kupon :	-

Fondsmanager

Antonio CIRULLI,Benjamin DUBOIS

Risiken

Bei den Hauptrisiken des Teilfonds handelt es sich um:

- **Inflationsrisiko**
- **Liquiditätsrisiko**
- **Wechselkursrisiko**
- **Bonitätrisiko**
- **Zinsrisiko**

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.

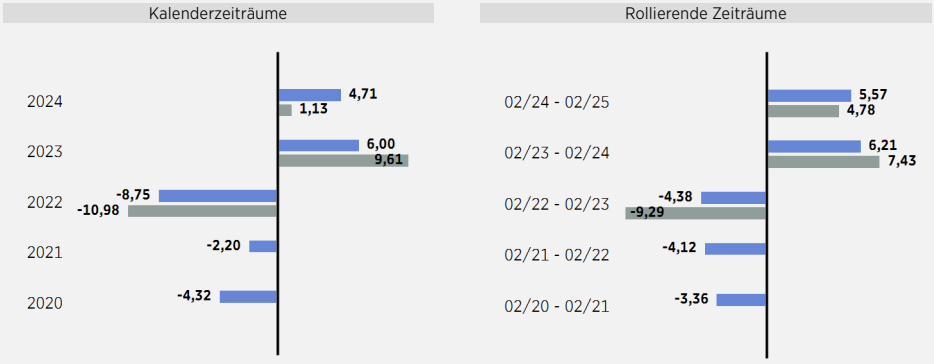
PERFORMANCE

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

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

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 28 Februar 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)	0,64	2,08	5,57	7,22	-0,65	1,34	44,13	1,73
Index	1,00	2,21	4,78	-	-	-	-	-

Dieses Dokument ist nicht vertraglich bindend.
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 (%)	2,84	6,60	3,48	4,66
Tracking Error (%)	4,89			
Sharpe-Ratio	0,17	-0,08	-0,52	-0,57
Information-Ratio	0,21			
Alpha	0,07			
Beta	0,32			
R2	0,54			
Korrelationsverhältnis	0,74			

Performanceanalyse

	Seit 04/11/2003 (monatl. Perf.)
% positive Performance	58,43
Maximaler Verlust (%)	-6,75
Maximaler Gewinn (%)	2,56

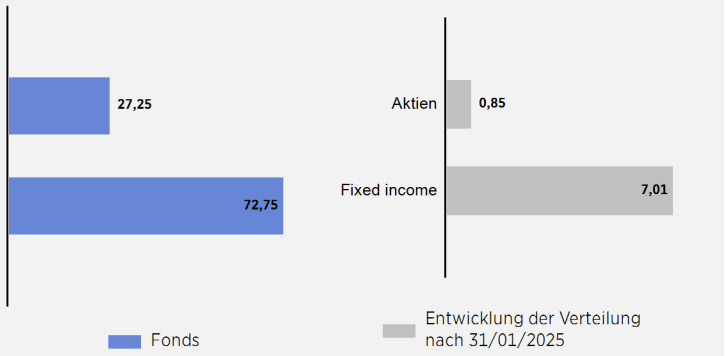
ENTWICKLUNG DER PERFORMANCE (%)

Nettoperformance

		Jan.	Feb.	März	April	Mai	Juni	Juli	Aug.	Sept.	Okt.	Nov.	Dez.	YTD
2016	Klasse (A)	-0,11	0,15	0,12	-0,05	-0,10	0,40	0,58	0,27	-0,58	-0,27	-0,38	0,33	**0.35**
2017	Klasse (A)	-	0,53	-0,04	0,89	0,71	-0,60	0,66	0,33	-0,10	0,73	-0,01	0,05	**3.19**
2018	Klasse (A)	1,32	-1,45	-1,06	-0,70	-0,51	0,14	0,16	0,86	-0,16	-2,88	0,37	-	**-3.92**
2019	Klasse (A)	1,55	-0,20	1,76	0,29	-0,60	2,56	1,86	0,60	-0,73	-0,12	0,31	0,97	**8.50**
2020	Klasse (A)	-0,12	-2,51	-6,75	0,32	0,22	0,11	0,94	0,41	-0,19	-0,46	2,50	1,43	**-4.32**
2021	Klasse (A)	-0,06	-1,59	-0,18	0,54	-0,14	0,01	0,75	0,04	-1,83	0,96	-0,21	-0,49	**-2.20**
2022	Klasse (A)	-2,14	-1,47	-1,00	-1,68	-0,49	-2,04	0,68	-0,40	-1,61	0,91	1,15	-0,96	**-8.75**
	Index	-	-	-	-	-	-	0,58	-4,00	-6,27	0,84	5,91	0,19	**-10.98**
2023	Klasse (A)	1,31	-0,27	0,41	0,71	-0,08	1,27	0,71	-0,31	-1,05	-0,53	1,87	1,84	**6.00**
	Index	4,30	-3,50	3,55	0,95	-2,30	1,54	1,40	-1,81	-3,51	-1,53	6,32	4,40	**9.61**
2024	Klasse (A)	0,47	0,77	0,95	-0,45	0,88	0,32	0,29	0,79	1,26	-1,01	0,73	-0,37	**4.71**
	Index	-1,19	-0,17	1,07	-2,76	2,10	0,36	2,65	2,73	1,92	-3,44	0,53	-2,42	**1.13**
2025	Klasse (A)	1,43	0,64	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	**2.08**
	Index	1,19	1,00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	**2.21**

PORTFOLIOANALYSE

Verteilung nach Art der Vermögenswerte (Gewicht in %)

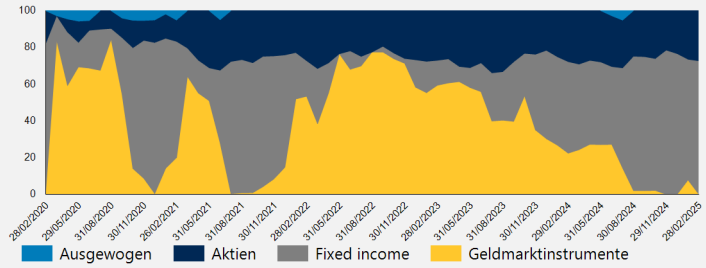


Wichtigste Positionen (ohne Geldmarkt)

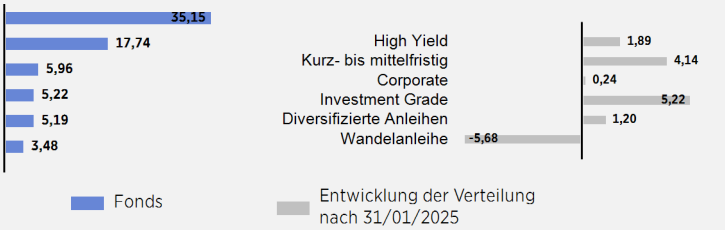
10 Wichtigste Positionen (Gesamtzahl der Positionen : 20)

	Sektor	Engag. (% NV)
EDRS - EQUITY US SOLVE I - EUR (H)	Geografisch	9,39
EDRS - EQUITY EURO SOLVE I - EUR	Geografisch	7,47
GROUPAMA CRÉDIT EURO CT M	Kurz- bis mittelfristi	5,56
AXA IM FIIS-EUR SH DUR H-BI	High Yield	5,56
PIMCO GIS-CAPITAL SEC-IA	Corporate	5,50
CANDR BONDS-E HIGH YIELD-I-C	High Yield	5,24
ISHARES CORE DAX (DE)	Geografisch	5,21
SCOR EURO HIGH YIELD	High Yield	4,90
ISHARES EURO HIGH YIELD CORPORATE BOND	High Yield	4,84
GENERALI INV-C&E EUR BD-BX	Investment Grade	4,83
Total		**58,50**

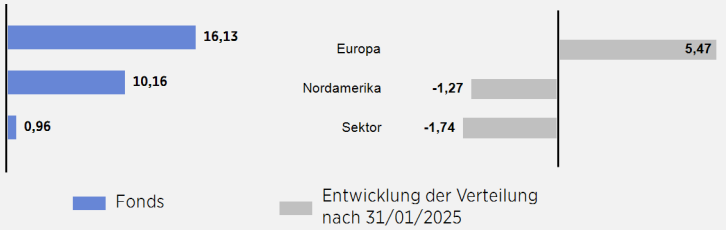
Entwicklung der Verteilung nach Anlageklasse (% des Vermögens)



Aufteilung nach Branchen Anleihen (Gewicht in %)



Geographische Aufteilung Aktien (Gewicht in %)



Datenquellen: Edmond de Rothschild Asset Management - Buchhaltungsdaten - Externe Datenanbieter – MSCI ESG-Rating

contact-am@edr.com http://funds.edram.com

Dieses Dokument ist nicht vertraglich bindend.
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

PRODUKTHINWEISE

Das vorliegende Dokument wurde am 28/02/2025 ausgegeben von EDMOND DE ROTHSCHILD ASSET MANAGEMENT (FRANCE) globale vertriebsstelle

47, rue du Faubourg Saint-Honoré

75401 Paris Cedex 08

vereinfachte Aktiengesellschaft (SAS) mit Vorstand und Aufsichtsrat mit einem Kapital von 11.033.769 Euro Euro

Zulassungsnummer der AMF GP 04000015

332.652.536 R.C.S. Paris

http://www.edram.de

EdR Fund QUAM 5 ist ein Teilfonds der SICAV nach luxemburgischem Recht, die von der CSSF beaufsichtigt wird und ist zum Vertrieb in Schweiz, Deutschland, Spanien, Frankreich, Italien, Luxemburg, Niederlande and Portugal zugelassen.

Dieses Dokument ist nicht vertraglich bindend und dient ausschließlich Informationszwecken. Jegliche Vervielfältigung oder Verwendung der Inhalte ist ohne Zustimmung der Unternehmensgruppe Edmond de Rothschild strengstens untersagt.

Die Informationen in diesem Dokument sind nicht als Angebot oder eine Aufforderung zu irgendeiner Transaktion in einer Gerichtsbarkeit anzusehen, in der ein solches Angebot oder eine solche Aufforderung ungesetzlich wäre oder in der die Person, von der dieses Angebot oder diese Aufforderung ausgeht, nicht handlungsbefugt ist. Dieses Dokument stellt weder eine Anlage-, Steuer- oder Rechtsberatung noch eine Empfehlung zum Kauf, Verkauf oder Halten einer Anlage dar und sollte auch nicht als solche ausgelegt werden.

EdRAM kann nicht für eine Investitions- oder Desinvestitionsentscheidung verantwortlich gemacht werden, die aufgrund dieser Informationen getroffen wurde.

Dieses Dokument wurde von keiner Aufsichtsbehörde irgendeiner Gerichtsbarkeit überprüft bzw. genehmigt. Die Vorschriften für die Vermarktung eines OGA können von Land zu Land unterschiedlich ausfallen.

Der hier beschriebene OGA ist unter Umständen nicht zum Vertrieb in Ihrem Wohnsitzland zugelassen. Sollten Sie in Bezug auf Ihre Fähigkeit, einen OGA zu zeichnen, Zweifel haben, raten wir Ihnen, sich an Ihren gewohnten Berater zu wenden.

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 sonstigen in den USA geltenden Vorschriften zum Verkauf 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.

Die Zahlen, Kommentare, Prognosen und sonstigen Elemente dieses Dokuments spiegeln die unter Berücksichtigung des Wirtschaftsumfelds und der aktuell verfügbaren Informationen erfolgende Einschätzung der Märkte und deren Entwicklung wider. Sie sind möglicherweise an dem Tag, an dem sie der Anleger zur Kenntnis nimmt, nicht mehr relevant. Folglich kann man EdRAM nicht für die Qualität oder Richtigkeit der von Dritten bereitgestellten Informationen und Daten wirtschaftlicher Natur verantwortlich machen.

Die Informationen zu den in den Fonds gehaltenen Werten sind nicht mit der Meinung von Edmond de Rothschild Asset Management (France) über die voraussichtliche Entwicklung dieser Werte und gegebenenfalls über die voraussichtliche Kursentwicklung der von ihr aufgelegten Finanzinstrumente gleichzusetzen. Diese Informationen sind nicht mit Empfehlungen zum Kauf oder Verkauf dieser Werte gleichzusetzen. Die Zusammensetzung des Portfolios kann sich durchaus im Laufe der Zeit verändern.

Jede Anlage ist mit besonderen Risiken verbunden. Wir empfehlen dem Anleger, sicherzustellen, dass jegliche Anlage stets mit seiner persönlichen Situation vereinbar ist. Er sollte sich folglich diesbezüglich gegebenenfalls von unabhängigen Experten beraten lassen. Des Weiteren sollte der Anleger das Dokument mit wesentlichen Informationen (KID) und/oder sonstige gemäß lokalen Vorschriften erforderliche Dokumente zur Kenntnis nehmen, die vor einer Zeichnung übergeben werden und auf der Website www.edmond-de-rothschild.com unter "Fund Center" abgerufen werden können oder jederzeit auf Anfrage kostenlos erhältlich sind.

Die steuerliche Behandlung ist von der jeweiligen Situation eines jeden Kunden abhängig und kann sich zu einem späteren Zeitpunkt ändern.

"Edmond de Rothschild Asset Management" oder "EdRAM" ist der Handelsname der Vermögensverwaltungsgesellschaften der Unternehmensgruppe Edmond de Rothschild.

Eine ausführliche Beschreibung der für Zielanleger geltenden Bestimmungen und der jeweiligen Risiken von OGA ist im Prospekt für diesen von der FINMA das Angebot an nicht qualifizierte Anleger in der Schweiz zugelassenen OGA zu finden. Die Satzung, der Prospekt, die wesentlichen Informationen für den Anleger sowie die Jahres- und Halbjahresberichte sind auf Anforderung bei Edmond de Rothschild Asset Management (France) bzw. den Vertriebsstellen und/oder**Vertretern und/oder Kontaktstellen von Edmond de Rothschild Asset Management (France) erhältlich. Deren Liste kann unter http://funds.edram.com abgerufen werden.** So können Anleger ihr Risiko analysieren und sich ihre eigene Meinung unabhängig von der Edmond de Rothschild Gruppe bilden, indem sie sich gegebenenfalls durch Experten in diesen Fragen beraten lassen, insbesondere um die Eignung dieser Anlage in Anbetracht ihrer finanziellen Situation, ihrer Erfahrung und ihrer Anlageziele sicherzustellen.

Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen über diesen OGA sollen die Angaben im Prospekt oder den Halbjahrs- und Jahresbericht nicht ersetzen. Anleger sind verpflichtet, diese zusätzlichen Unterlagen zu lesen, bevor sie Anlageentscheidungen treffen.

Schweiz (Gesetzlicher Vertreter und Zahlstelle): Edmond de Rothschild (Suisse) S.A. 18, rue de Hesse 1204 Genève Schweiz

Die Ratings und Bewertungen Morningstar sind nicht als Bestenlisten des Marktes anzusehen und sind nicht mit Empfehlungen zum Kauf, Verkauf oder Halten von Anteilen oder Aktien der von Edmond de Rothschild Asset Management (France) verwalteten OGA gleichzusetzen. Der Verweis auf eine Einstufung oder einen Kurs dieser OGA greift in keinem Fall künftigen Einstufungen oder Kursen dieser OGA oder des Vermögensverwalters voraus.

Quelle: Morningstar, Inc. Alle Rechte vorbehalten. Die im vorliegenden Dokument enthaltenen Informationen: (1) gehören Morningstar und/oder seinen Informationslieferanten; (2) dürfen nicht reproduziert oder weiterverteilt werden; (3) erfolgen ohne Gewähr der Richtigkeit, Vollständigkeit oder Aktualität. Weder Morningstar noch seine Informationslieferanten haften für Schäden oder Verluste, die aus der Nutzung dieser Daten entstehen. Die frühere Wertentwicklung ist keine Garantie für zukünftige Ergebnisse.

GLOSSAR

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.

Weitere Definitionen und Methoden finden Sie unter www.edmond-de-rothschild.com unter der Registerkarte„Fund Center“ in den herunterladbaren Unterlagen des Fondsdatenblatts.