

Edmond de Rothschild Fund - QUAM 5 B CHF

Morningstar Categorie Index

Cat 75%Citi SwissGBI&25%MSCI Wld
Free NR

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

80% Bloomberg Global Aggregate TR
USD, 20% MSCI ACWI NR USD

Morningstar Rating™

—

Morningstar Categorie™

Mixfondsen CHF Defensief

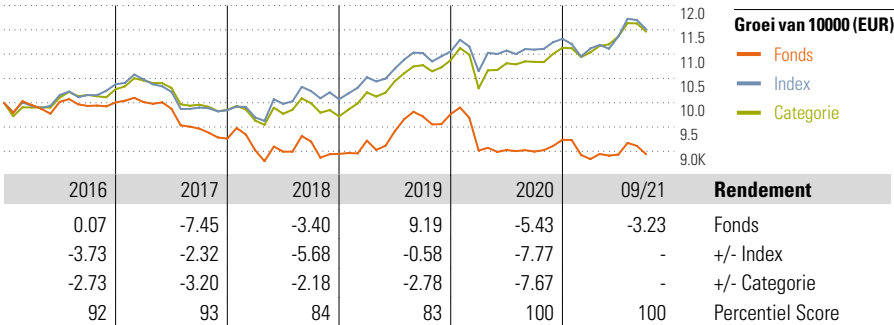
Beleggingsdoelstelling

The Sub-Fund follows a clearly defined strategy for the placement of assets based on controlling the portfolio's risk from annual volatility. Purchase and sale decisions are based upon quantitative systems over the medium term. The investment of assets is adjusted to the prevailing market conditions and has the objective of not exceeding a mean annual volatility of 5%. This objective does not constitute a guarantee of any sort that the mean annual volatility will never exceed 5%. The Sub-Fund is actively managed.

Risicomaatstaven

Alpha	-4.38	Sharpe Ratio	-0.03
Beta	0.87	Std Deviatie	6.93
R-kwadraat	57.94	3-jr Risico	-
Informatie Ratio	-1.27	5-jr Risico	-
Tracking Error	3.82	10-jr Risico	-

Berekeningen met Cat 75%Citi SwissGBI&25%MSCI Wld Free NR (waar van toepassing)



Rendementen (30 sep 2021)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	0.07	-0.16	3.62
6 Maanden	1.11	-6.50	-2.58
1 jaar	-0.62	-11.24	-3.82
3 jr gean.	-0.96	-5.04	-3.05
5 jr gean.	-2.09	-5.93	-5.32

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2021	-4.29	1.04	0.07	-
2020	-7.70	0.12	-0.35	2.70
2019	3.07	2.11	3.24	0.50
2018	-2.61	-0.30	2.31	-2.77
2017	0.07	-1.39	-4.14	-2.17

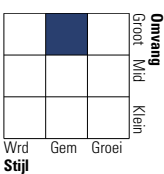
Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling

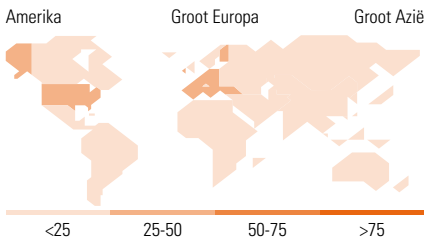
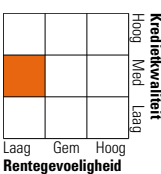
	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	27.96	7.15	20.81
Obligaties	59.95	3.49	56.46
Kas/ geldmarkt	64.50	42.69	21.82
Overig	1.14	0.23	0.91

Morningstar Style Box

Stijl Aandelen



Stijl vastrentend



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
La Française Trésorerie ISR I	—	16.73
EdR SICAV Equity US Solve I...	—	10.40
EdR SICAV Equity Euro Solve I...	—	6.73
AXAIMFIS Europe Short Dur HY...	—	5.12
Groupama Crédit Euro CT MC	—	5.12
DWS Invest Short Duration...	—	4.88
Candriam Bds Euro High Yld I...	—	4.72
MS INVF European HY Bd Z	—	4.70
MS INVF Short Maturity Euro...	—	4.68
Scor Sustainable Euro High...	—	4.42
Totaal Aantal Aandelen		0
Totaal Aantal Obligaties		0
% Van Vermogen In Top 10 Posities		67.50

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	33.08
Basismaterialen	4.22
Cyclische consumentenproducten	12.96
Financiële dienstverlening	14.07
Vastgoed	1.82
Licht Cyclisch	51.13
Communicatiediensten	6.79
Energie	3.50
Industrie	14.87
Technologie	25.96
Defensief	15.80
Defensieve consumptiegoederen	5.32
Gezondheidszorg	8.20
Nutsbedrijven	2.27

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	42.65
Verenigde Staten	42.51
Canada	0.00
Latijns Amerika	0.14
Groot Europa	34.55
Verenigd Koninkrijk	0.21
West Europa – Euro	33.85
West Europa – Niet Euro	0.49
Emerging Europa	0.00
Midden-Oosten / Afrika	0.00
Groot Azië	22.80
Japan	17.55
Australazië	0.00
Azië - Ontwikkeld	5.23
Azië - Emerging	0.01

Fondsinformatie

Fondsgroep	Edmond de Rothschild...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	1 Aandeel
Telefoon	01 40 17 25 25	Fondsvaluta	CHF	Min Additioneel	1/1000 Aandeel
Website	https://www.edmond-de...	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	20 jan 2014	Inc/Acc	Inc		
Fondsmanager	Antonio Cirulli	ISIN	LU1005538993		
Aanvangsdatum	16 jul 2021				
Koers (30 sep 2021)	CHF 88.29				
Fondsvermogen (mln)	CHF 0.26				