

Edmond de Rothschild Asset Management erweitert die Produktpalette



Edmond de Rothschild erweitert die bestehende Produktpalette um die langjährig bewährten quantitativen QUAM-Dachfonds, die ihren Fokus auf Wertsteigerung in einem risikokontrollierten Umfeld setzen. Ziel ist es, durch eine flexible Asset Allokation in traditionellen Anlageklassen von positiven Markttrends zu profitieren und bei langanhaltenden Negativtrends das investierte Kapital zu erhalten. Dabei liegt die Priorität auf der Risikokontrolle. Edmond de Rothschild Asset Management verwaltet in den QUAM-Strategien über 3 Mrd. Euro von institutionellen und privaten Anlegern. Die seit mehr als 15 Jahren erfolgreich positionierten QUAM-Fonds wurden bisher durch die auf Risikomanagement und Overlay-Strategien spezialisierte Tochtergesellschaft La Compagnie Benjamin de Rothschild (CBR) mit Sitz in Genf vertrieben. Im Rahmen der neuen Strategie werden sie nun in die Asset Management Einheit der Gruppe integriert.

Der von CBR eigens entwickelte aktive Asset Allokation Ansatz kommt in 4 Risikokategorien zum Einsatz:

- EdR Fund Quam 5 (EUR)
- EdR Fund Quam 10 (EUR)

Edmond de Rothschild Asset Management erweitert die Produktpalette

- EdR Fund Quam 15 (EUR)

Alle vier Strategien bieten ein quantitatives Risikomanagement, welches eine flexible Anpassung des Portfolios an die jeweiligen Marktgegebenheiten erlaubt. Sie bedienen sich dabei einer dynamischen und disziplinierten Asset Allokation, die eine jährlich angestrebte Volatilität von maximal 5%, 10% beziehungsweise 15% nicht überschreiten soll.

Das Anlageuniversum der QUAM-Fonds umfasst neben UCITS IV konformen Publikumsfonds auch ETFs mit täglicher Verfügbarkeit, die sämtliche Anlageklassen (Aktien, Anleihen, diversifizierte Fonds und Geldmarkt), Regionen und Sektoren abdecken. Eine automatische Steuerung der Investitionsentscheidungen, ohne Einschränkung bezüglich Investitionsthema oder Managementstil, ermöglicht es, zu jedem Zeitpunkt alle Markttrends unter Berücksichtigung einer begrenzten Volatilität auszuschöpfen.

Im Gegensatz zu anderen Anlagestrategien, orientiert sich der QUAM-Ansatz nicht nur am Performance-Ziel. Die Priorität liegt auf der Risikokontrolle, die mit Hilfe eines asymmetrischen und diversifizierten Portfoliomanagements auf einem begrenzten Volatilitätsbudget basiert. Nach der Überzeugung des Fondsmanagementteams unter der Leitung von Mathieu Gilbert, Direktor Quantitatives Asset Management und Overlays (Verwaltetes Vermögen 10 Mrd. Euro) der Edmond de Rothschild Gruppe, stellt diese strikte Risiko-Kontrolle eine stabilere und damit weniger zufallsbedingte Performance sicher. So konnte das QUAM 5 Portfolio als defensive Variante im Zeitraum von 01.01.1998 bis 28.02.2014 pro Jahr eine durchschnittliche Wertentwicklung von 4.30% mit einer niedrigen Volatilität von ca. 3,15%* erzielen.

Gilbert, kommentiert: „Die QUAM-Strategie hat sich in den letzten 16 Jahren gerade in Krisenzeiten besonders bewährt. Unsere Teams in Genf und London haben Zugang zu allen globalen Anlageklassen, um so das Investmentuniversum qualitativ zu bereichern. Wir sind davon überzeugt, dass das Risikoprofil dieser Anlagestrategie hervorragend an die Bedürfnisse unserer privaten sowie institutionellen Kunden angepasst ist, die im anhaltenden Niedrigzinsumfeld auf der Suche nach Rendite sind, ohne das Risiko in ihrem Portfolio erhöhen zu wollen.“

Guillaume Poli, globaler Vertriebsleiter von Edmond de Rothschild Asset Management, fügt hinzu: „Die Neustrukturierung der Asset Management Sparte innerhalb der Gruppe lässt unsere Kunden von der exzellenten Expertise unserer Fondsmanager profitieren. Wir sprechen mit der erweiterten Fondspalette alle Kundengruppen in Deutschland, Frankreich und der Schweiz an.“