



Edmond de Rothschild Asset Management complète son équipe de gestion quantitative et lance les trois premiers fonds de sa gamme *Quartz*

-
- Les trois nouveaux fonds sont des stratégies Core US, Core EMU et Defensive Global Equities
 - Ils représentent les premiers produits d'une gamme dénommée Quartz qui comprendra initialement 7 fonds d'ici fin 2026
 - L'équipe de gestion quantitative se renforce avec l'arrivée de Yu Sun et de Juan Sebastian Caicedo, tous deux analystes quantitatifs et gérants de portefeuille.
-

Edmond de Rothschild Asset Management poursuit le développement de sa plateforme de gestion quantitative, avec le lancement de 3 fonds et le recrutement de 2 gérants supplémentaires.

Placée sous la responsabilité de **Bruno Taillardat, Responsable de la gestion quantitative**, l'équipe développe une gamme de stratégies actions dénommée *Quartz*. Ces stratégies actions systématiques s'appuient sur des modèles mathématiques avancés, tout en conférant un rôle central au jugement des gérants dans la définition et le suivi des approches d'investissement. La gamme *Quartz*, de droit Luxembourgeois, vise à répondre aux besoins des clients en actions défensives, actions multi-factorielles, solutions climatiques 3D¹ et stratégies long/short², en complément des fonds de gestion active déjà proposés par le Groupe.

Les trois premiers fonds lancés sont les fonds suivants :

- EdR Fund Quartz Core EMU Equity
- EdR Fund Quartz Core US Equity³
- EdR Fund Quartz Defensive Global Equity

¹ Stratégies actions 3D climat: construction de portefeuilles visant à optimiser simultanément 3 dimensions : génération de performance, gestion du risque, prise en compte d'objectifs climatiques.

² Lancement prévu en 2027

³ Le fonds EdR Fund Quartz Core US Equity est géré par délégation à Edmond de Rothschild (Suisse)



Les deux premiers fonds sont des stratégies Core Equities. Ils sont basés sur une stratégie pleinement investie en actions, présentant une tracking-error⁴ plutôt limitée et dont le niveau ciblé dépendra des régions et du contexte de marché. Elle est largement diversifiée entre différents facteurs actions (Value, Momentum, Quality, etc.) avec pour objectif de générer le niveau d'alpha le plus élevé possible pour un budget de risque relatif donné. Des techniques d'intelligence artificielle sont intégrées au processus d'investissement afin de renforcer encore la diversification et la réactivité du portefeuille. La stratégie s'adapte en permanence à l'évolution de l'environnement de marché, dans le but de délivrer une performance⁵ « tout cycle » avec un beta proche de 1.

La stratégie Defensive Global Equities est une stratégie actions, conçue pour générer une volatilité réduite ainsi que des replis plus limités que ceux des indices de référence traditionnels. Cette performance résiliente est obtenue sans prise de décision de market timing, le portefeuille restant en permanence pleinement investi en actions. La stratégie vise ainsi un ratio de Sharpe⁶ supérieur à celui de ses indices de référence. Tout en respectant ses caractéristiques défensives, l'objectif de l'équipe est d'adapter le niveau de risque du portefeuille en fonction du contexte de marché.

Afin d'accompagner ce développement, l'équipe de gestion quantitative est renforcée par l'arrivée de Yu Sun, et de Juan Sebastian Caicedo, qui rejoignent Edmond de Rothschild Asset Management en qualité d'analystes quantitatifs et gérants de portefeuille. Ils sont basés à Paris et reportent à Bruno Taillardat. Ils viennent compléter l'équipe de gestion quantitative formée l'an dernier avec les recrutements à Genève de Xavier Marconnet et Frédéric Girod en novembre 2025.

Yu Sun, CFA, FRM, rejoint Edmond de Rothschild Asset Management comme analyste quantitatif et gérante de portefeuille au sein de l'équipe de gestion quantitative basée à Paris. Son recrutement est effectif depuis Mars 2026. Elle dispose de dix ans d'expérience en gestion quantitative et systématique, acquise notamment chez Amundi Asset Management, où elle était gérante de fonds actions quantitatifs européens et globaux, et chez Lyxor Asset Management, où elle a contribué au lancement et à la gestion de fonds actions quantitatifs, y compris des stratégies thématiques. Elle possède une expertise approfondie en investissement factoriel, optimisation de portefeuille basée sur le risque et intégration de données ESG et climatiques dans les modèles quantitatifs.

Yu est diplômée de l'Ecole Polytechnique (Master Ingénierie Financière), de l'EDHEC Business School (Master Finance de marchés) et de l'Université Paris-

⁴ La tracking error est une mesure du risque utilisée en gestion d'actifs dans les portefeuilles indiciels ou les portefeuilles qui sont comparés à un indice de référence. Cet indicateur mesure le risque que la performance du portefeuille s'éloigne de celle de son benchmark.

⁵ Tout investissement présente un risque de perte en capital

⁶ Le ratio de Sharpe se traduit par la surperformance du produit par rapport à un taux sans risque ajustée par la volatilité du produit.



Saclay (Master Risque et gestion d'actifs). Elle est CFA charterholder, et certifiée Financial Risk Manager (FRM).

Juan Sebastian Caicedo, CFA, rejoint Edmond de Rothschild Asset Management en tant qu'analyste quantitatif et gérant de portefeuille au sein de l'équipe de gestion quantitative à Paris. Son recrutement est effectif depuis Avril 2026. Il a débuté sa carrière en 2005 en tant qu'enseignant de mathématiques à Bogota, avant d'intégrer le secteur de l'asset management à Paris au sein du groupe Natixis en 2009. Il y a occupé différentes fonctions de gestion et de recherche quantitatives chez Natixis Asset Management, Seeyond puis Ostrum Asset Management, où il a participé à la création et à la gestion de stratégies actions quantitatives européennes et globales. Il possède une expertise approfondie en investissement factoriel, gestion de stratégies à faible volatilité, et intégration d'objectifs climatiques au sein de processus d'investissement quantitatifs.

Juan Sebastian est diplômé de l'ESCP Europe (major Finance) et de l'Universidad de los Andes (B.Sc. Mathematics). Il est CFA charterholder.

Bruno Taillardat, Responsable de la gestion quantitative, Edmond de Rothschild Asset Management, commente : « *Dans un contexte de marché complexe, avec une volatilité accrue, la gestion quantitative prend tout son sens. Elle repose sur un cadre d'investissement clair, un processus adaptatif et dynamique, centré sur le contrôle des risques et une recherche prospective, dans lequel le jugement des gérants reste central à chaque étape. Nous sommes fiers de pouvoir annoncer le lancement de ces trois premiers fonds construits en à peine 6 mois, et nous compléterons la gamme avec 4 fonds supplémentaires d'ici la fin d'année. Ces stratégies comprendront notamment des stratégies Core Europe, Marchés émergents, et Global, ainsi que Core 3D climate.* »

À propos d'Edmond de Rothschild

Edmond de Rothschild est une maison d'investissement fondée sur la conviction que mise au service de l'économie réelle, la richesse peut faire œuvre utile et contribuer à faire du progrès une idée toujours neuve.

Portée par une culture d'anticipation financière de près de trois siècles, elle est spécialisée dans la banque privée et la gestion d'actifs et dispose d'un savoir-faire reconnu sur ses principaux métiers (gestion de patrimoine, ingénierie patrimoniale, assurance vie, services aux gestionnaires de fortune indépendants, corporate finance, private equity, immobilier, infrastructure, stratégies liquides et administration de fonds). Son actionnariat 100% familial lui confère une réelle indépendance qui permet l'alignement sur les intérêts de ses clients et favorise l'émergence de solutions financières adaptées aux besoins spécifiques d'une clientèle de familles, entrepreneurs et investisseurs institutionnels. Au 31 décembre 2025, Edmond de Rothschild gère plus de 198 milliards de francs suisses d'actifs et, affiche un bilan solide avec un ratio de solvabilité de 19,1%. Avec plus de 2 800 collaborateurs et 35 implantations, elle est un acteur de référence sur ses principales places où elle est implantée - dont Genève, Luxembourg, Paris et Monaco.



Edmond de Rothschild est au cœur d'un écosystème unique composé d'activités agricoles, vinicoles, hôtelières, d'activités philanthropiques familiales, de l'écurie de course au large Gitana et de la maison de parfumerie Caron.

Contact presse

Edmond de Rothschild

Fany de Villeneuve

+33 6 46 24 69 38

f.devilleneuve@edr.com