

## Wesentliche Informationen für den Anleger

Gegenstand dieses Dokuments sind wesentliche Informationen für den Anleger über diesen OGAW. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen die Wesensart dieses OGA und die Risiken einer Anlage in ihm zu erläutern. Wir raten Ihnen zur Lektüre dieses Dokuments, sodass Sie eine fundierte Anlageentscheidung treffen können.



# R-co Conviction Credit 12M Euro

Teilfonds der SICAV R-co 2

Dieser OGAW wird von Rothschild & Co Asset Management Europe verwaltet

ISIN-Code: FR0012371359 (Aktie P EUR)

## Anlageziel und Anlagepolitik

Das Anlageziel dieses OGAW mit der Klassifizierung „auf Euro lautende Anleihen und sonstige Schuldtitel“ besteht darin, über die empfohlene Anlagedauer von einem Jahr eine höhere Wertentwicklung als der folgende kombinierte Referenzindikator zu erzielen: 75 % [€STR kapitalisiert + 0,085 %] + 25 % Markt iBoxx € Corporates 1-3 mit Reinvestition der Netto-Kupons nach Abzug der Verwaltungsgebühren bei einer empfohlenen Mindestanlagedauer von einem Jahr. Dazu investiert er in ein repräsentatives Portfolio, das Chancen am Markt für kurzfristige Anleihen nutzt. Die Zusammensetzung des Teilfonds kann erheblich von der des Referenzindex abweichen.

Die Allokation auf der Zinskurve und das Kreditengagement erfolgen diskretionär, und das Engagement des Teilfonds hängt davon ab, mit welcher Entwicklung die Verwaltungsgesellschaft bei Zinsen und Kreditspreads rechnet.

Die Strategie für die Allokation auf der Zinskurve und das Kreditengagement werden durch eine direkte oder indirekte Anlage (über OGAW) oder durch eine synthetische Anlage mit Hilfe von Terminfinanzinstrumenten umgesetzt.

Das Portfolio des Teilfonds kann zu 90 % bis 100 % in auf Euro lautenden Anleihen, handelbaren Schuldtiteln, Indexanleihen, besicherten Anleihen öffentlicher oder privater Emittenten mit beliebigem Rating investiert sein. Das Engagement in spekulativen Titeln (Hochzinstitel) beträgt maximal 10 %, in Titeln von Ländern außerhalb der OECD (einschließlich Schwellenländer) maximal 10 %, in Anleihen ohne Rating maximal 10 % und in Anleihen mit Emittenten- bzw. Gläubigerkündigungsrecht, darunter auch „*Make Whole Calls*“, maximal 60 %. Zwischen 0 % und 10 % des Portfolios können auch in Aktien oder Anteile französischer und europäischer koordinierter OGAW investiert werden.

Der Teilfonds kann bis zu 100 % seines Vermögens in Terminfinanzinstrumente investieren, die an französischen und ausländischen geregelten Terminmärkten oder außerbörslich gehandelt werden (insbesondere Kreditderivate, Futures, Optionen, Performance-Swaps und Devisentermingeschäfte). Zu diesem Zweck wird das Portfolio abgesichert und/oder geht ein Engagement in Zinsen, Indizes sowie im Währungs- und Kreditrisiko ein. Das Gesamtengagement auf dem Zinsmarkt (durch Wertpapiere, OGAW oder Termingeschäfte) gewährleistet, dass die Duration\* des Portfolios sich stets innerhalb einer Spanne von 0 bis 1,5 bewegt.

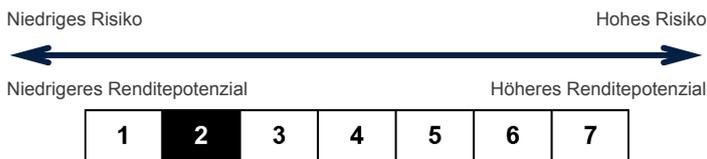
Der positive Beitrag von umweltbezogenen, sozialen und die Unternehmensführung betreffenden Kriterien (ESG-Kriterien) kann bei Anlageentscheidungen berücksichtigt werden, stellt allerdings keinen maßgeblichen Faktor bei der Entscheidungsfindung dar.

Bewertungshäufigkeit: täglich. Zentralisierung von Zeichnungs-/Rücknahmeaufträgen (Z/R): jeden Tag um 12:00 Uhr bei Rothschild Martin Maurel. Auftragsausführung: auf Basis des nächsten NIW (Kurs nicht bekannt). Abrechnungsdatum für Z/R: NIW + 2 Werktage. Dieser Anteil ist ein thesaurierender Anteil.

Empfehlung: Dieser OGA ist unter Umständen nicht für Anleger geeignet, die ihr Kapital innerhalb von weniger als einem Jahr nach der Anlage wieder zurückziehen möchten.

\* Die Duration einer Anleihe misst die Kursschwankungen eines festverzinslichen Papiers bei Änderungen der Zinssätze. Je länger die Restlaufzeit einer Anleihe ist, desto höher ist ihre Duration.

## Risiko- und Ertragsprofil



• Das Risikoniveau dieses Teilfonds liegt bei 2 (Volatilität zwischen 0,5 % und 2 %) und entspricht seiner Positionierung auf dem Markt für kurzfristige Anleihen.

• Die zur Berechnung dieses synthetischen Indikators verwendeten historischen Daten können möglicherweise nicht als verlässlicher Hinweis auf das künftige Risikoprofil des Teilfonds herangezogen werden.

• Die Risikokategorie des Teilfonds ist nicht garantiert und kann sich im Laufe der Zeit nach oben wie nach unten verändern.

• Die niedrigste Kategorie bedeutet nicht, dass die Anlage risikofrei ist.

• Für den Teilfonds gilt keine Kapitalgarantie.

Sonstige wesentliche, im Indikator nicht angemessen berücksichtigte Risiken:

• Kreditrisiko: Das Risiko einer Verschlechterung der Kreditqualität oder eines Zahlungsausfalls eines Emittenten, das die Kurse der Anlagen im Portfolio beeinträchtigen kann.

• Auswirkungen von Techniken wie Derivaten: Durch den Einsatz von Derivaten können sich die Auswirkungen von Marktveränderungen auf das Portfolio verstärken.

Das Eintreten eines dieser Risiken kann einen Rückgang des Nettoinventarwertes des Teilfonds nach sich ziehen.

Ausführlichere Informationen über das Risikoprofil und die wichtigsten Risikofaktoren entnehmen Sie bitte dem Verkaufsprospekt.

## Kosten

Die entrichteten Kosten und Gebühren dienen zur Deckung der Betriebskosten des Teilfonds, einschließlich der Kosten für die Vermarktung und den Vertrieb der Aktien. Diese Kosten beschränken das potenzielle Anlagewachstum.

### Einmalige Kosten vor und nach der Anlage

|                   |        |
|-------------------|--------|
| Ausgabeaufschlag  | 1,00 % |
| Rücknahmeabschlag | Keine  |

Bei den angegebenen Prozentsätzen handelt es sich um Höchstsätze, die vor der Anlage und/oder vor der Auszahlung Ihres Anlageertrags von Ihrem Kapital abgezogen werden können. In einigen Fällen können Sie weniger zahlen. Informationen zu den aktuellen Ausgabeauf- und Rücknahmeabschlägen erhalten Sie bei Ihrem Finanzberater oder Ihrer Vertriebsstelle.

### Kosten, die im Laufe des Jahres vom OGA abgezogen werden

|   |        |
|---|--------|
| Laufende Kosten (in % des Nettovermögens) | 0,32 % |
|---|--------|

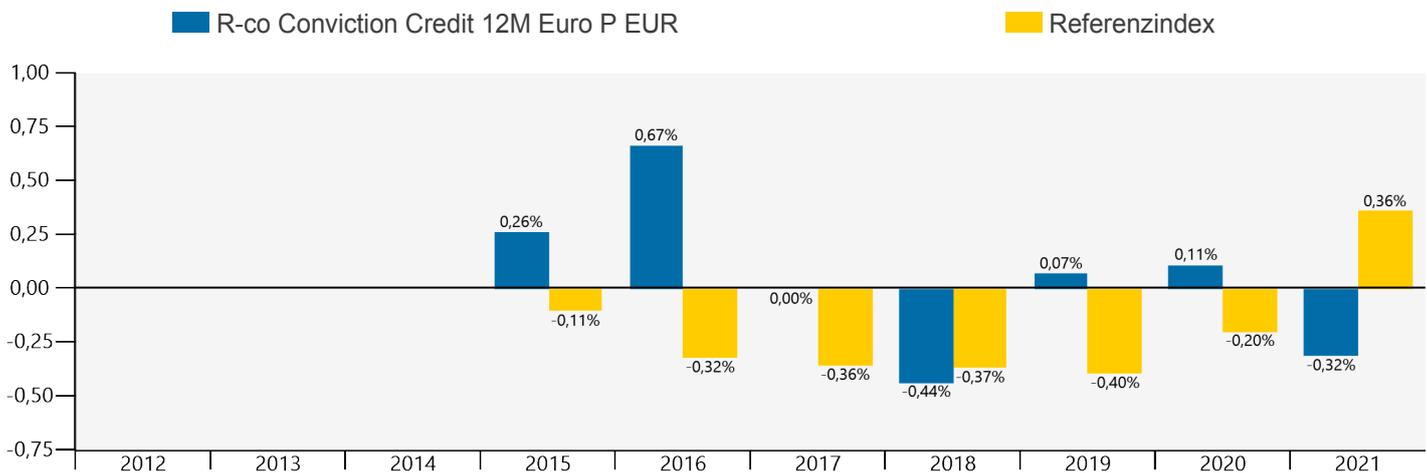
Der angegebene Prozentsatz der laufenden Kosten beruht auf den Kosten des im Dezember 2021 abgeschlossenen Geschäftsjahres. Dieser Satz kann von einem Geschäftsjahr zum anderen schwanken. Die laufenden Kosten schließen die erfolgsabhängigen Gebühren und die Vermittlungskosten – mit Ausnahme der Ausgabeauf- und/oder Rücknahmeabschläge, die der OGA beim Kauf oder Verkauf von Anteilen eines anderen Organismus für gemeinsame Anlagen zahlt – nicht ein.

### Einmalige Kosten, die unter bestimmten Umständen vom OGA berechnet werden

|                         |       |
|-------------------------|-------|
| Erfolgsabhängige Gebühr | Keine |
|-------------------------|-------|

Weitere Informationen zu den Gebühren entnehmen Sie bitte der Rubrik „Kosten und Gebühren“ im Verkaufsprospekt dieses OGAW, erhältlich auf einfache schriftliche Anfrage an die nachstehend in der Rubrik „Praktische Informationen“ genannte Adresse.

## Wertentwicklung in der Vergangenheit



Dieser Teilfonds wurde **2020** aufgelegt.

Die „P EUR“-Aktien wurden am 30.11.2020 aufgelegt.

Die Wertentwicklungen werden in Euro berechnet.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit lässt keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu. Bei der Berechnung der angegebenen Wertentwicklung werden sämtliche Kosten und Gebühren berücksichtigt.

## Praktische Informationen

Die Verwahrstelle des OGAW ist Rothschild Martin Maurel.

Der Verkaufsprospekt sowie die letzten Jahres- und Halbjahresberichte des OGAW sind in französischer Sprache verfügbar und werden Anteilhabern auf schriftliche Anfrage an folgende Adresse innerhalb von acht Werktagen kostenlos zugesandt:

Rothschild & Co Asset Management Europe – Service Commercial 29, avenue de Messine, 75008 Paris.

Der Nettoinventarwert wird auf der Website der Verwaltungsgesellschaft veröffentlicht:  
<https://am.eu.rothschildandco.com>.

Die Steuervorschriften des Mitgliedstaates, in dem der OGAW aufgelegt wurde, können sich auf die persönliche Steuerlage des Anlegers auswirken.

Rothschild & Co Asset Management Europe kann lediglich auf der Grundlage einer in diesem Dokument enthaltenen Erklärung haftbar gemacht werden, die irreführend, unrichtig oder nicht mit den einschlägigen Teilen des Verkaufsprospekts des OGAW

vereinbar ist. Dieser Teilfonds kann andere Aktienarten beinhalten. Ausführlichere Informationen über diese Aktien entnehmen Sie bitte dem Verkaufsprospekt des OGAW oder der folgenden Website: <https://am.eu.rothschildandco.com>. Dieser OGAW ist in Frankreich zugelassen und untersteht der Aufsicht der französischen Finanzmarktaufsichtsbehörde (Autorité des Marchés Financiers). Rothschild & Co Asset Management Europe ist in Frankreich zugelassen und wird von der Autorité des Marchés Financiers reguliert.

Einzelheiten zur aktualisierten Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft sind der Website <https://am.eu.rothschildandco.com> zu entnehmen. Ein gedrucktes Exemplar der Vergütungspolitik ist auf Anfrage kostenlos am Sitz der Verwaltungsgesellschaft erhältlich.

Diese wesentlichen Informationen für den Anleger sind zutreffend und entsprechen dem Stand vom 11. Februar 2022.