

EMCORE One Fund – EMCORE Green Yield Dynamic USD

24'075'661

Fund Total Net Assets in USD

110.12

Share Class NAV in USD

0.84%

MTD (net) return

2.28%

YTD (net) return

Strategy

Die Strategie zielt darauf ab, durch die systematische Nutzung von impliziten Volatilitätsprämien zusätzlich zur Performance des zugrunde liegenden Green-Bond-Portfolios ein konsistentes Alpha zu generieren.

Portfolio

Die Zusammensetzung des diversifizierten Portfolios besteht aus grünen Anleihen mit Investment-Grade-Rating und einem systematischen Aktienindex-Volatilitäts-Overlay. Grüne Anleihen sind wahrscheinlich die liquidesten im nachhaltigen Anlageuniversum.

Volatility Overlay

Die Strategie ist von den Volatilitäten der Aktienindizes abgeleitet. Der quantitative Anlageprozess und der integrierte Risikomanagementansatz führen zu einem attraktiven risikobereinigten Renditeprofil.

Risk Profile (SRI)



ISIN	LI1271373329
Valor	127137332
Ticker	EGYDUSD LE

Fund Domicile	Liechtenstein
Fund Inception Date	07.06.2023
Fund / ShareClass CCY	USD / USD
Distribution	Accumulating
Fiscal Year End	31.12.
Liquidity / Cut Off	Daily, 16:00 CET

Investment Manager	EMCORE AG, Liechtenstein
Administrator	IFM Independent Fund Management AG
Custodian	Neue Bank AG

Management Fee	0.50%
Performance Fee	15%
Hurdle Index	Highwater Mark Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index
Administration, Custodian and Other Fees (exp.)*	0.21%
TER without Perf Fee (exp.)*	1.01%

*) The ongoing costs can fluctuate from year to year based on fund size and transactions

Monthly Performance



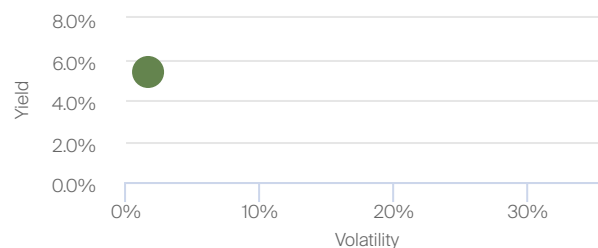
Year	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	YTD
2025	0.75%	0.67%	0.84%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2.28%
2024	0.68%	-0.39%	0.26%	-0.11%	0.61%	0.59%	1.02%	1.14%	1.01%	-0.25%	0.73%	0.41%	5.84%
2023	-	-	-	-	-	-0.69%	0.23%	0.31%	-0.18%	0.43%	0.94%	0.67%	1.72%



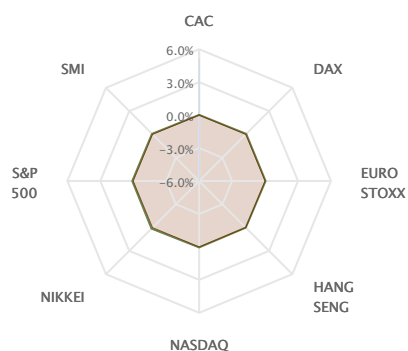
Key Figures

Return since Inception	10.12%
Return p.a.	5.40%
Volatility	1.72%
Maximum Drawdown	-0.69%

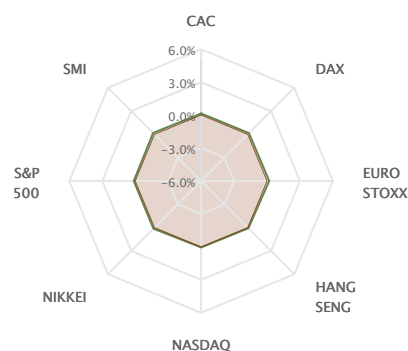
Risk Return



Option Contribution MTD



Option Contribution YTD



Portfolio Key Data

	Cash	Bonds	Equities	Options	Futures
Weighting	1.93%	98.61%	-	-0.54%	-
Credit Quality	-	AA+	-	-	-
Days to Expiration	-	-	-	30	-
Yield to Maturity	-	4.08%	-	-	-
Duration	-	1.78	-	-	-
Portfolio Vega	-	-	-	-17'455	-
Portfolio Theta	-	-	-	7'685	-

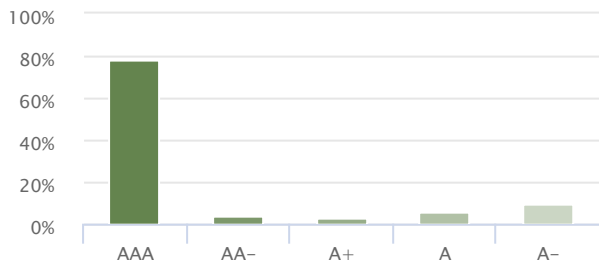
Share Classes Overview

Tranche	ISIN	Denomination	Management Fee	Performance Fee	Administration Fee	TER
EMCORE One Fund – EMCORE Green Yield Dynamic CHF	LI1271373311	CHF 100'000	0.50%	15%	0.21%	1.06%
EMCORE One Fund – EMCORE Green Yield Dynamic EUR	LI1271373303	EUR 100'000	0.50%	15%	0.21%	1.04%
EMCORE One Fund – EMCORE Green Yield Dynamic USD	LI1271373329	USD 100'000	0.50%	15%	0.21%	1.01%

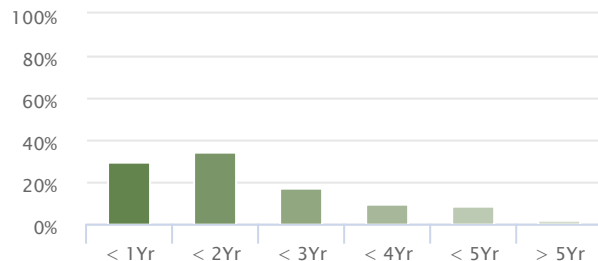


Portfolio Breakdown

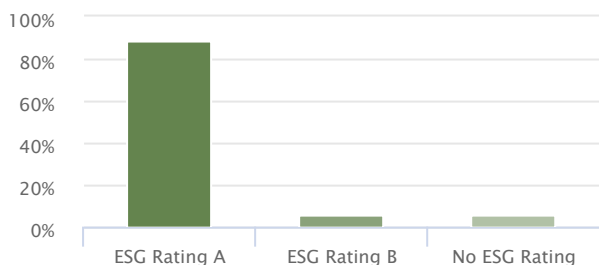
Ratings



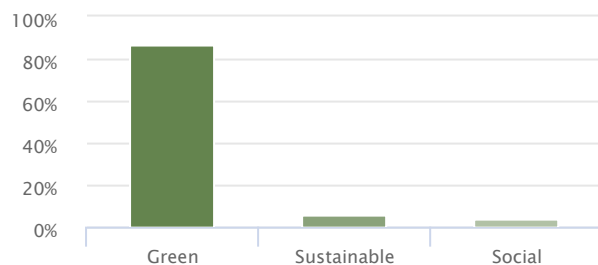
Maturity



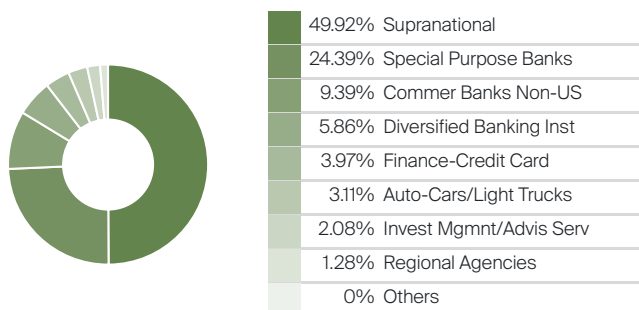
ESG Ratings



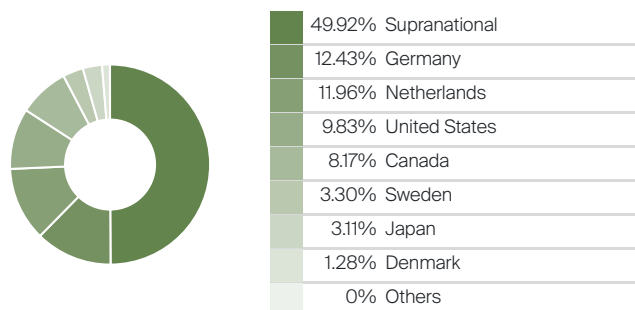
Bond Types



Sector Bonds



Country Issuer



#	Top 10 Holdings	Weight
1	KFW	7.97%
2	NEDER WATERSCHAPSBANK	7.74%
3	EUROPEAN INVESTMENT BANK	6.25%
4	INTL FINANCE CORP	6.16%
5	ASIAN DEVELOPMENT BANK	6.05%
6	JPMORGAN CHASE & CO	5.66%
7	EUROPEAN INVESTMENT BANK	5.28%
8	INTL BK RECON & DEVELOP	4.16%
9	ASIAN DEVELOPMENT BANK	4.01%
10	TORONTO-DOMINION BANK	3.84%



Disclaimer

Dieses Dokument ist ausschliesslich für Qualifizierte Investoren bestimmt. Die Ausführungen und Angaben in dieser Publikation sind von EMCORE nach bestem Wissen ausschliesslich zu Informations- und Marketingzwecken zusammengestellt worden. Diese Publikation stellt weder eine Anwerbung oder Aufforderung noch ein Angebot oder eine Empfehlung zum Erwerb oder Verkauf irgendwelcher Anlageinstrumente oder zur Vornahme sonstiger Transaktionen dar. Sie stellt auch keinerlei Beratung bezüglich rechtlicher, steuerlicher oder anderer Fragen dar. Die in dieser Publikation enthaltenen Informationen sind nicht als persönliche Empfehlung aufzufassen und berücksichtigen weder die Anlageziele noch die Anlagestrategien oder die finanzielle Situation oder Bedürfnisse einer bestimmten Person. Sie basieren auf zahlreichen Annahmen. Unterschiedliche Annahmen können zu materiell unterschiedlichen Ergebnissen führen. Alle in dieser Publikation enthaltenen Informationen und Meinungen stammen aus als zuverlässig und glaubwürdig eingestuften Quellen. EMCORE und ihre Mitarbeiter lehnen jegliche Haftung ab für falsche oder unvollständige Informationen sowie Verluste oder entgangene Gewinne, die aus der Nutzung von Informationen und der Berücksichtigung von Meinungen entstehen können.

Eine Wertentwicklung oder positive Rendite einer Anlage in der Vergangenheit stellt keine Garantie für künftige Ergebnisse und eine positive Rendite in der Zukunft dar. Ebenso können sich Wechselkursschwankungen negativ auf die Entwicklung, den Wert oder den Ertrag von Finanzinstrumenten auswirken. Alle Informationen und Meinungen sowie angegebenen Prognosen, Einschätzungen und Marktpreise sind nur zum Zeitpunkt der Erstellung dieser Publikation aktuell und können sich jederzeit ohne Vorankündigung ändern.

Eine Vervielfältigung oder Reproduktion dieser Publikation, auch auszugsweise, ist ohne vorherige schriftliche Einwilligung durch EMCORE nicht gestattet. Sofern nicht etwas anderes schriftlich vereinbart wurde, ist jegliche Verteilung und Weitergabe dieser Publikation Materials an Dritte untersagt. EMCORE übernimmt keinerlei Haftung für Ansprüche oder Klagen von Dritten, die aus dem Gebrauch oder der Verteilung dieser Publikation resultieren. Die Verteilung dieser Publikation darf nur im Rahmen der dafür geltenden Gesetzgebung stattfinden. Sie richtet sich nicht an Personen im Ausland, denen der Zugang zu solchen Publikationen aufgrund der Rechtsordnung ihres Domizilstaates nicht erlaubt ist.

Investitionen in ein Produkt sollten nur nach gründlichem Studium des Prospekts und des Basisinformationsblatts erfolgen. Der aktuelle Prospekt und das Basisinformationsblatt sind auf Deutsch kostenlos bei EMCORE AG, Pflugstrasse 20, 9490 Vaduz, Liechtenstein erhältlich.

© EMCORE. 2025 - all rights reserved