

DPAM Horizon B Balanced Conservative - F

Instit. Monatsbericht | 30. September 2020

Morningstar ★★★★★ (*)

ÜBERBLICK

Asset-Klasse	Multi Asset
Kategorie	Defensiv
Strategie	Aktive Strategie
Teilfonds des	DPAM Horizon B
Rechtsform	SICAV
Domizil	Belgien
Fondswährung	EUR
Handelbarkeit	Täglich
Auflagedatum	04.04.2003
Erstausgabetag	02.04.2013
Vertriebszulassung in	

BE, DE, FR, IT

ISIN BE6248455063

WKN A1W3UG

Ausgabeaufschlag Maximum 1%

Rücknahmegebühr 0%

Laufende Kosten* 0.40%

*Einschließlich Verwaltungsvergütung 0.15%

NIW (thesaurierend) 26'696.28

Fondsvermögen Mio. EUR 74.30

Anzahl der Positionen 161

Fonds Benchmark

BRUTTOWERTENTWICKLUNG (IN %)

	Fonds	Benchmark
1 Monat	0.19	0.34
Laufendes Jahr	0.43	0.30
1 Jahr	1.10	0.04
3 Jahre (p.a.)	3.44	3.80
5 Jahre (p.a.)	4.57	4.36
10 Jahre (p.a.)	-	-

Fonds Benchmark

PORTFOLIEIGENSCHAFTEN

Anleihen

	Fonds	Benchmark
Durchschn. Fälligkeit (Jahren)	7.62	-
Duration (Jahren)	6.62	-
Modified Duration (%)	6.62	-
Yield to Worst (%)	0.12	-
Anzahl der Emittenten	148	-

ANLAGEUNIVERSUM

Der Fonds legt sein Vermögen (ohne jede Beschränkung auf Branchenebene) hauptsächlich (i) in Aktien und/oder anderen Beteiligungspapieren, die ihren Sitz und/oder einen wesentlichen Teil ihrer Anlagen, Aktivitäten, Erträge oder Entscheidungsstrukturen in Europa oder in Nordamerika haben (bis zu 40% seines Nettovermögens) und (ii) in fest oder variabel verzinslichen Anleihen und/oder anderen Schuldtiteln an, die von den Ratingagenturen S&P bzw. Moody's ein Rating von mindestens BBB- bzw. Baa3 („Investment Grade“) haben und einen regelmäßig ausgeschütteten oder thesaurierten Ertrag bieten.

BENCHMARK

Benchmark DPAM Horizon Balanced Conservative

AUFTEILUNG (IN%)

Asset Allokation

Aktien	31.3
Anleihen	63.0
Barguthaben	5.7

Branchen des Aktienteils

Informationstechnologie	6.6
Nicht-Basiskonsumgüter	4.7
Industrie	4.6
Gesundheitswesen	3.9
Finanzwesen	3.6
Kommunikation	2.1
Roh-, Hilfs- und Betr.-Stoffe	1.8
Versorger	1.6
Basiskonsumgüter	1.2
Immobilien	1.0
Energie	0.1

Branchen des Obligationenteils

Staatsanleihen	53.4
Banken	2.5
Telekommunikation	1.5
Industrie	1.4
Konsumgüter	1.3
Versorger	1.3
Immobilien	0.9
Dienstleistungen	0.6

Top 10 Equity Holdings

Apple	0.7
Microsoft	0.7
Astrazeneca	0.7
Enel	0.5
Cellnex Telecom	0.5
Varta (kap.herab)	0.5
Nike Inc B	0.5
ServiceNow, Inc.	0.5
Iberdrola	0.4
Kbc Groep	0.4

Ratingklassen des Anleihenteils

AAA	7.2
AA+	0.2
AA	9.8
AA-	4.1
A+	3.5
A	0.0
A-	12.6
BBB+	3.4
BBB	3.7
BBB-	17.4
High-Yield	0.1
Ohne Rating	0.9

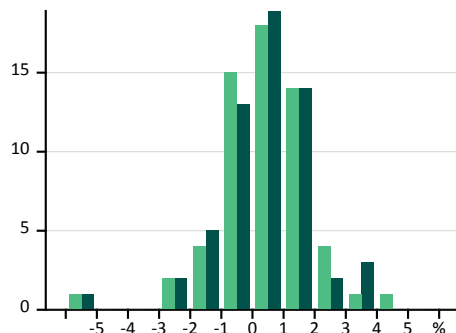
DPAM Horizon B Balanced Conservative - F

Instit. Monatsbericht | 30. September 2020

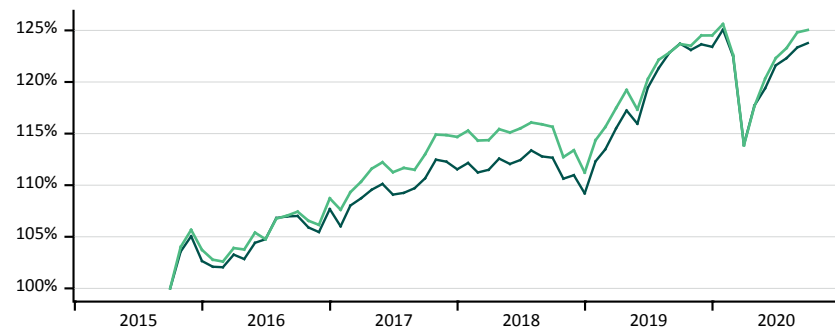
Fondswährung EUR | Beobachtungszeitraum - 5 Jahre

Fonds Benchmark

VERTEILUNG DER MONATLICHEN ERGEBNISSE



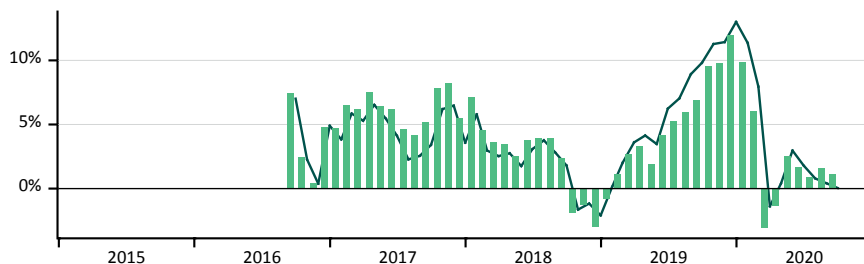
KUMULIERTE WERTENTWICKLUNG



STATISTISCHE ANGABEN

		Fonds	Benchmark
Volatilität	%	5.68	5.52
Sharpe Ratio		0.87	0.86
Downside Deviation	%	3.89	3.76
Sortino Ratio		1.27	1.26
Anzahl positiver Monate	%	63.33	65.00
Maximaler Verlust	%	-9.35	-8.92
Risikoloser Zins -0.40%			

ROLLIERENDE 12-MONATSERGEBNISSE

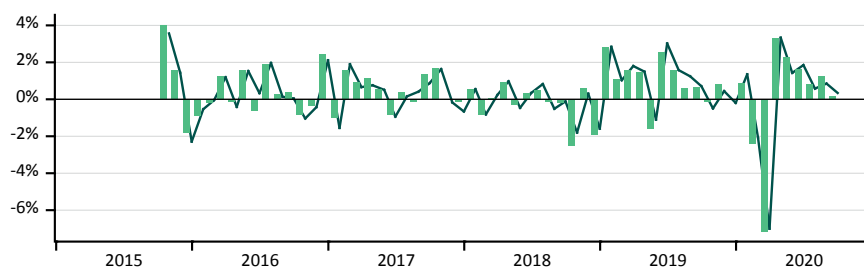


FONDS VERSUS BENCHMARK

Korrelation		0.978
R ²		0.956
Alpha	%	0.02
Beta		1.005
Treynor Ratio	%	4.92
Tracking Error	%	1.19
Information Ratio		0.174

Benchmark: Benchmark DPAM Horizon Balanced Conservative

MONATSERGEBNISSE



MONATSERGEBNISSE (IN %)

	2016		2017		2018		2019		2020	
	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark
Januar	-0.92	-0.54	-1.02	-1.55	0.53	0.55	2.81	2.84	0.88	1.35
Februar	-0.18	-0.05	1.58	1.90	-0.83	-0.82	1.11	1.03	-2.38	-2.07
März	1.27	1.19	0.94	0.66	0.04	0.23	1.60	1.80	-7.14	-7.00
April	-0.13	-0.41	1.13	0.76	0.93	0.97	1.49	1.50	3.32	3.33
Mai	1.58	1.53	0.56	0.51	-0.28	-0.46	-1.59	-1.10	2.29	1.43
Juni	-0.61	0.33	-0.86	-0.94	0.35	0.34	2.53	3.02	1.64	1.85
Juli	1.90	1.97	0.38	0.16	0.49	0.82	1.55	1.58	0.80	0.58
August	0.27	0.14	-0.16	0.41	-0.15	-0.51	0.57	1.24	1.24	0.85
September	0.36	0.04	1.34	0.87	-0.21	-0.11	0.67	0.71	0.19	0.34
Oktober	-0.82	-1.04	1.70	1.63	-2.54	-1.80	-0.14	-0.50		
November	-0.38	-0.42	-0.05	-0.17	0.58	0.31	0.81	0.44		
Dezember	2.42	2.11	-0.15	-0.66	-1.90	-1.59	0.00	-0.20		
Jahr	4.81	4.90	5.48	3.58	-3.01	-2.09	11.95	13.00	0.43	0.30

WICHTIGE INFORMATION - NUR FÜR BERECHTIGTE NUTZER

Die in diesem Factsheet enthaltenen Informationen dienen ausschließlich Informationszwecken.

Der Inhalt dieser Produktinformation stellt weder eine Anlageempfehlung dar, noch ein Angebot oder eine Aufforderung die hierin besprochenen Aktien, Anleihen, Anlagefonds oder sonstigen Produkte in irgendeiner Weise zu kaufen oder verkaufen.

Bevor Sie eine Anlageentscheidung treffen, lesen Sie bitte die aktuellen Verkaufsunterlagen des Fonds durch, die detaillierte Informationen über die mit einer Anlage in diesem Finanzprodukt verbundenen Risiken enthalten. Der Prospekt, die Rechenschaftsberichte sowie die Wesentlichen Anlegerinformationen (Key Investor Information Document - KIID) stehen zum Download in deutscher Sprache auf der Internetseite <https://funds.degroofpetercam.com> bereit und können auch in Papierform kostenlos bei der deutschen Informationsstelle Marcard, Stein & Co-. AG, Ballindamm 36, 20095 Hamburg angefordert werden.

Alle in diesem Factsheet gemachten Angaben beziehen sich auf das vorderseitig angegebene Erstellungsdatum und können ohne besondere vorherige Mitteilung abgeändert werden. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Dieses Dokument wurde von Degroof Petercam Asset Management sa ("DPAM"), deren Sitz Rue Guimard 18, 1040 Brüssel (Belgien) und Autor des vorliegenden Dokuments ist, nach bestem Wissen und Gewissen sowie im besten Interesse der Kunden erstellt, jedoch ohne den Anspruch auf das Erzielen eines bestimmten Resultates oder einer bestimmten Wertentwicklung zu erheben. Die Information basiert auf Quellen welche DPAM als glaubwürdig betrachtet, allerdings unter dem Vorbehalt der Richtigkeit und Vollständigkeit.

Dieses Dokument darf ohne die Zustimmung von DPAM, weder vollständig noch teilweise vervielfältigt und / oder an andere Personen weitergereicht werden.