

DPAM HORIZON B BONDS GLOBAL INFLATION LINKED - F

Instit. Monatsbericht | 31. Dezember 2021

Morningstar ★★★★★ (*)

ÜBERBLICK

Asset-Klasse	Anleihen
Kategorie	Inflationsgeschützt
Strategie	Aktive Strategie
Teilfonds des	DPAM Horizon B
Rechtsform	SICAV
Domizil	Belgien
Fondswährung	EUR
Handelbarkeit	Täglich
Auflagedatum	16.09.2009
Erstausgabetag	14.10.2009
Vertriebszulassung in	AT, BE, CH, DE, FR, IT, LU, NL

ISIN	BE0948793360
WKN	A1JBB1

Ausgabeaufschlag	Maximum 1%
Rücknahmegebühr	0%
Laufende Kosten*	0.31%
<i>*Einschließlich Verwaltungsvergütung</i>	<i>0.20%</i>
Mindestanlagebetrag	EUR 25'000
NIW (thesaurierend)	155.01
Fondsvermögen	Mio. EUR 290.85
Anzahl der Positionen	48

	Fonds	Benchmark
BRUTTOWERTENTWICKLUNG (IN %)		
1 Monat	-0.37	-0.26
Laufendes Jahr	7.27	9.21
1 Jahr	7.27	9.21
3 Jahre (p.a.)	6.22	6.54
5 Jahre (p.a.)	2.91	3.32
10 Jahre (p.a.)	4.78	5.14

	Fonds	Benchmark
PORTFOLIOEIGENSCHAFTEN		
Durchschn. Fälligkeit (Jahren)	9.78	9.30
Modified Duration (%)	8.32	8.76
Beta Adj. Duration	7.20	7.51
YTW (ModDur Weighted) (%)	-0.78	-0.81
Break-Even-Rendite	2.41	2.46

ANLAGEUNIVERSUM

Der Fonds ist darauf ausgerichtet, Ihnen eine aktiv verwaltete Anlage in auf auf beliebige Währungen lautenden Schuldtiteln zu ermöglichen, wobei die Zahlung der Zinsen und/oder die Rückzahlung von Kapital von der Entwicklung der Inflation in einem Land oder einer geographischen Region abhängt. Der Fonds legt (mindestens 75% seines Nettovermögens) ohne Branchenbeschränkung hauptsächlich in fest oder variabel verzinslichen Anleihen und/oder anderen Schuldtiteln (in allen Währungen) an, wobei die Zahlung der Zinsen und/oder die Rückzahlung von Kapital von der Entwicklung der Inflation in einem Land oder einer geographischen Region abhängt. Diese Wertpapiere werden von einem Staat (einschließlich gegebenenfalls seiner Gebietskörperschaften) oder von internationalen oder supranationalen Organisationen oder von Institutionen oder Stellen begeben oder garantiert, die von einem oder mehreren öffentlichen Akteuren gehalten werden und mit öffentlichen oder Aufgaben von allgemeinem Interesse betraut sind oder von einem Mechanismus profitieren, der im Falle eines Emittentenausfalls eine vorrangige Erstattung garantiert.

BENCHMARK

Bloomberg Universal Inflation Linked GDP Weighted IG (seit 01.10.2013)
Vorheriger Benchmark: JPM Euro Linkers Securities Total Return

AUFTEILUNG (IN%)

Länder	Fonds	Bench	Rating	Fonds	Bench
Vereinigte Staaten	39.6	42.6	AAA	53.8	58.8
Italien	11.2	4.0	AA+	2.2	0.4
Frankreich	6.7	5.4	AA	8.3	8.8
Kanada	6.1	3.6	AA-	4.5	5.4
Spanien	5.6	2.8	A+	3.8	10.8
Australien	5.4	2.9	A	1.0	0.5
Grossbritannien	4.5	5.4	A-	7.0	4.0
Mexiko	3.8	2.5	BBB+	0.5	1.1
Japan	3.3	10.0	BBB	15.1	9.7
Schweden	2.3	1.1	BBB-	0.2	0.6
Andere	7.8	19.7	Barguthaben	3.6	0.0
Barguthaben	3.6	0.0			

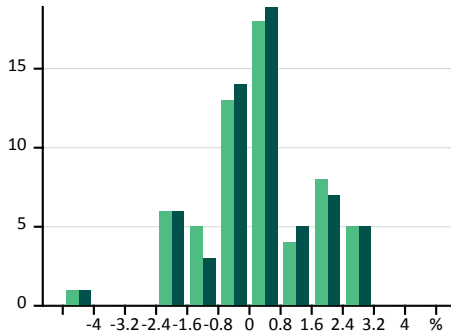
Währungen nach Absicherung	Fonds	Bench	Modified durations	Fonds	Bench
US Dollar	45.2	42.6	< 3%	14.7	19.3
Euro	15.3	20.0	3 - 5%	14.9	19.8
Japanischer Yen	10.5	10.0	5 - 7%	19.5	18.5
Pound sterling	5.5	5.4	7 - 10%	20.4	17.6
Kanadischer Dollar	3.5	3.6	10 - 15%	7.2	5.5
Mexican peso	3.5	2.5	> 15%	19.7	19.4
Australian dollar	3.4	2.9	Barguthaben	3.6	0.0
Koreanischer Won	3.0	3.3			
Polnischer Zloty	1.3	1.2			
Brasilianischer Real	0.0	0.0			
Andere	8.8	8.4			

DPAM HORIZON B BONDS GLOBAL INFLATION LINKED - F

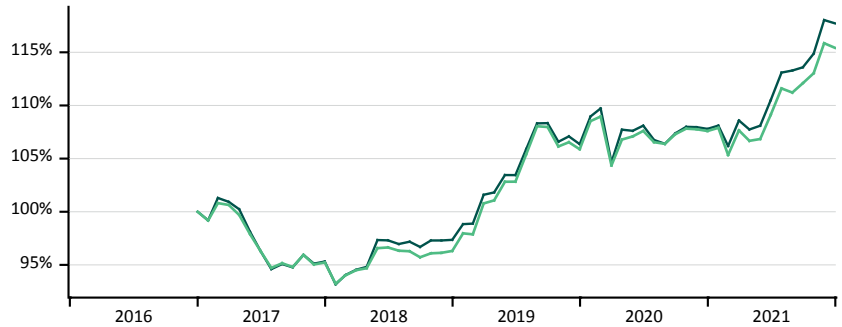
Instit. Monatsbericht | 31. Dezember 2021
 Fondswährung EUR | Beobachtungszeitraum - 5 Jahre

Fonds Benchmark

VERTEILUNG DER MONATLICHEN ERGEBNISSE



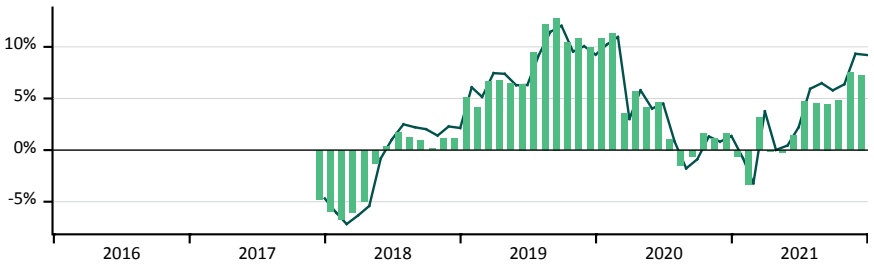
KUMULIERTE WERTENTWICKLUNG



STATISTISCHE ANGABEN

		Fonds	Benchmark
Volatilität	%	4.80	5.01
Sharpe Ratio		0.70	0.75
Downside Deviation	%	2.93	3.06
Sortino Ratio		1.15	1.24
Anzahl positiver Monate	%	58.33	60.00
Maximaler Verlust	%	-7.52	-8.02
Risikoloser Zins		-0.48%	

ROLLIERENDE 12-MONATSERGEBNISSE

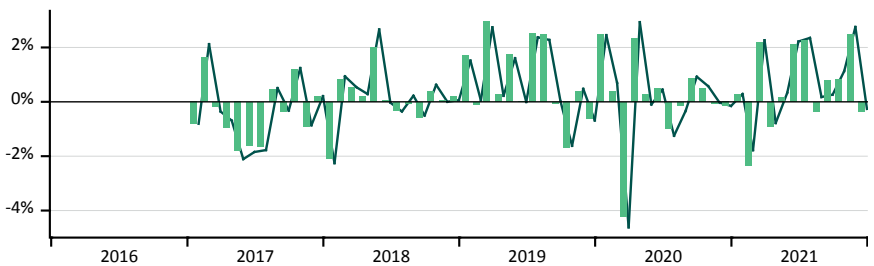


FONDS VERSUS BENCHMARK

Korrelation		0.987
R ²		0.974
Alpha	%	-0.02
Beta		0.946
Treynor Ratio	%	3.56
Tracking Error	%	0.82
Information Ratio		-0.499

Benchmark: Bloomberg Universal Inflation Linked GDP Weighted IG (seit 01.10.2013)
 Früher: JPM Euro Linkers Securities Total Return

MONATSERGEBNISSE



MONATSERGEBNISSE (IN %)

	2017		2018		2019		2020		2021	
	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark
Januar	-0.82	-0.81	-2.10	-2.26	1.72	1.52	2.50	2.45	0.28	0.29
Februar	1.64	2.12	0.84	0.94	-0.09	0.05	0.40	0.69	-2.37	-1.78
März	-0.17	-0.36	0.52	0.54	2.97	2.74	-4.22	-4.62	2.20	2.26
April	-0.94	-0.69	0.20	0.28	0.29	0.22	2.33	2.93	-0.91	-0.78
Mai	-1.81	-2.11	1.99	2.66	1.73	1.60	0.28	-0.10	0.16	0.33
Juni	-1.61	-1.85	0.07	-0.03	0.01	-0.01	0.48	0.45	2.13	2.22
Juli	-1.65	-1.78	-0.32	-0.36	2.51	2.37	-0.98	-1.25	2.28	2.35
August	0.46	0.50	-0.05	0.22	2.49	2.28	-0.15	-0.34	-0.35	0.18
September	-0.38	-0.32	-0.59	-0.50	-0.06	0.02	0.85	0.92	0.79	0.26
Oktober	1.19	1.24	0.39	0.63	-1.70	-1.62	0.49	0.57	0.84	1.13
November	-0.93	-0.86	0.05	0.00	0.37	0.48	-0.06	-0.03	2.50	2.75
Dezember	0.20	0.21	0.19	0.06	-0.62	-0.68	-0.15	-0.15	-0.37	-0.26
Jahr	-4.77	-4.68	1.14	2.14	9.93	9.24	1.62	1.35	7.27	9.21

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.