

# DPAM L BONDS EUR QUALITY SUSTAINABLE - F

Instit. Monatsbericht | 31. Dezember 2021

Morningstar ★★☆☆ (\*)

## ÜBERBLICK

Asset-Klasse	Anleihen
Kategorie	Corporate Investment Grade
Strategie	Aktive Strategie
Teilfonds des	DPAM L
Rechtsform	SICAV
Domizil	Luxemburg
Fondswährung	EUR
Handelbarkeit	Täglich
Aufledgedatum	23.12.1987
Erstausgabebetrag	30.01.2004
Vertriebszulassung in	AT, CH, DE, ES, FR, IT, LU, NL

ISIN	LU0174537935
WKN	AOPDRR
Ausgabeaufschlag	Maximum 1%
Rücknahmegebühr	0%
Laufende Kosten*	0.43%
*Einschließlich Verwaltungsvergütung	0.30%
Mindestanlagebetrag	EUR 25'000
NIW (thesaurierend)	619.75
Fondsvermögen	Mio. EUR 1'498.44
Anzahl der Positionen	458

	Fonds	Benchmark
<b>BRUTTOWERTENTWICKLUNG (IN %)</b>		
1 Monat	0.10	-0.11
Laufendes Jahr	-1.53	-1.08
1 Jahr	-1.53	-1.08
3 Jahre (p.a.)	2.58	2.60
5 Jahre (p.a.)	1.60	1.77
10 Jahre (p.a.)	3.56	3.62

	Fonds	Benchmark
<b>PORTFOLIOEIGENSCHAFTEN</b>		
Durchschn. Fälligkeit (Jahren)	6.00	5.53
Duration (Jahren)	4.82	5.34
Modified Duration (%)	4.78	5.32
Yield to Worst (%)	0.73	0.49
YTW (ModDur Weighted) (%)	0.92	0.72
Anzahl der Emittenten	205	680

## ANLAGEUNIVERSUM

Der Teilfonds investiert überwiegend in fest- oder variabel verzinsliche Anleihen und / oder andere Schuldverschreibungen (einschließlich, aber nicht beschränkt auf unendliche Anleihen und Null-Kupon-Anleihen), die auf Euro lauten und von Gesellschaften begeben werden/wurden, die mit (oder deren Emittenten) ein Mindestrating von BBB- / Baa3 ("Investment Grade") in der Ratingsystematik der Agenturen S&P / Moody's haben. Ferner werden die Anleihen auf der Grundlage von Nachhaltigkeitskriterien wie soziale Gerechtigkeit, Umwelt und guter Unternehmensführung ausgewählt.

## BENCHMARK

iBoxx Euro Corporate Overall Total Return

## AUFTEILUNG (IN%)

Branchen	Fonds	Bench	Länder	Fonds	Bench
Banken	25.2	27.5	Vereinigte Staaten	19.4	19.3
Industrie	13.2	9.5	Frankreich	18.5	20.7
Konsumgüter	11.6	13.6	Deutschland	10.4	14.8
Versorger	9.5	9.9	Italien	8.8	4.7
Immobilien	9.2	6.2	Niederlande	7.0	5.8
Gesundheitswesen	5.9	6.2	Spanien	5.4	5.5
Telekommunikation	5.9	6.0	Grossbritannien	4.7	8.0
Versicherungen	4.7	4.4	Belgien	4.0	2.0
Technologie	4.0	2.7	Schweiz	2.1	3.4
Dienstleistungen	2.9	3.7	Schweden	2.0	2.5
Chemie	1.9	1.9	Dänemark	1.2	1.2
Energie	1.9	5.0	Andere	14.4	12.1
Andere	2.0	3.2	Barguthaben	2.1	0.0
Barguthaben	2.1	0.0			

Rating	Fonds	Bench	Kapitalstruktur	Fonds	Bench
AAA	0.0	0.5	Nichtfinanzwerte Senior	59.7	64.8
AA+	0.0	0.5	Banken Senior	19.6	24.2
AA	0.0	1.2	Nichtfinanzwerte Subordinated	7.8	3.2
AA-	2.2	6.9	Banken Lower Tier Two	5.9	3.3
A+	4.2	6.7	Versicherungen Subordinated	3.9	2.9
A	11.3	13.9	Versicherungen Senior	0.8	1.5
A-	19.4	18.0	Derivate	0.2	0.0
BBB+	18.8	22.6	Barguthaben	2.1	0.0
BBB	21.6	18.6			
BBB-	20.1	11.2			
Derivate	0.2	0.0			
Barguthaben	2.1	0.0			

Modified durations	Fonds	Bench	Währungen	Fonds	Bench
< 3%	15.2	27.2	Euro	100.0	100.0
3 - 5%	28.9	28.5			
5 - 7%	24.9	20.0			
7 - 10%	21.5	16.4			
10 - 15%	6.6	5.7			
> 15%	0.7	2.2			
Barguthaben	2.3	0.0			

(\*) Morningstar Rating Overall

(\*\*) Das "Towards Sustainability"-Label ist der Qualitätsstandard für nachhaltige und sozial verantwortliche Finanzprodukte der von der Central Labelling Agency (CLA) in Belgien vergeben wird. Luxflag ESG-Label wird von der luxemburgischen Finanzkennzeichnungsagentur vergeben.

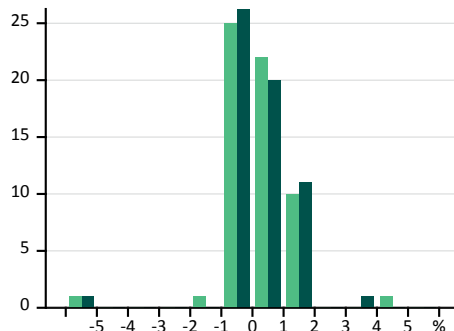
## DPAM L BONDS EUR QUALITY SUSTAINABLE - F

Instit. Monatsbericht | 31. Dezember 2021

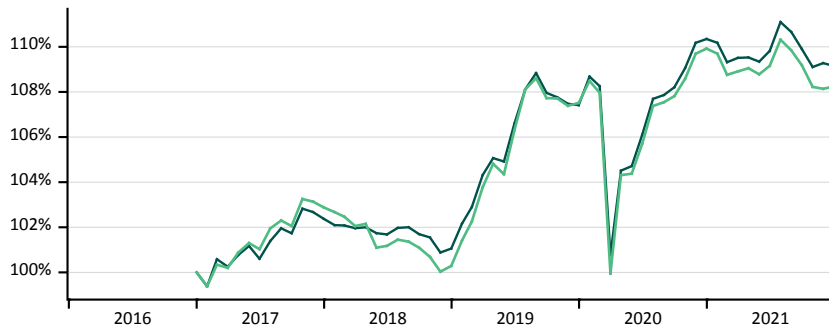
Fondswährung EUR | Beobachtungszeitraum - 5 Jahre

Fonds Benchmark

### VERTEILUNG DER MONATLICHEN ERGEBNISSE



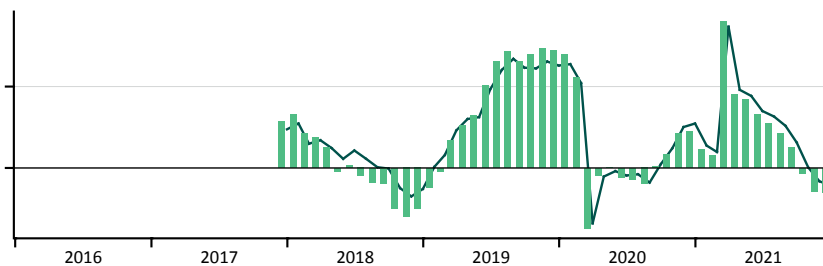
### KUMULIERTE WERTENTWICKLUNG



### STATISTISCHE ANGABEN

		Fonds	Benchmark
Volatilität	%	4.57	4.20
Sharpe Ratio		0.45	0.53
Downside Deviation	%	3.46	3.20
Sortino Ratio		0.60	0.70
Anzahl positiver Monate	%	55.00	53.33
Maximaler Verlust	%	-7.98	-7.41
Risikoloser Zins <b>-0.48%</b>			

### ROLLIERENDE 12-MONATSERGEBNISSE

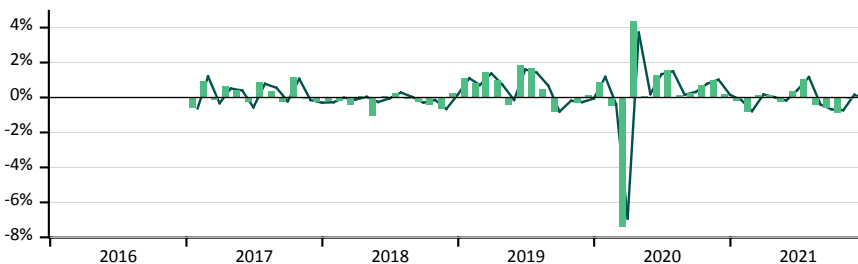


### FONDS VERSUS BENCHMARK

Korrelation		0.990
R <sup>2</sup>		0.980
Alpha	%	-0.02
Beta		1.077
Treynor Ratio	%	1.92
Tracking Error	%	0.72
Information Ratio		-0.215

Benchmark: iBoxx Euro Corporate Overall Total Return

### MONATSERGEBNISSE



### MONATSERGEBNISSE (IN %)

	2017		2018		2019		2020		2021	
	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark
Januar	-0.62	-0.62	-0.20	-0.27	1.13	1.10	0.91	1.18	-0.20	-0.15
Februar	0.97	1.21	-0.20	-0.01	0.83	0.71	-0.49	-0.39	-0.86	-0.78
März	-0.14	-0.33	-0.40	-0.12	1.48	1.38	-7.43	-6.92	0.14	0.18
April	0.67	0.52	0.10	0.04	1.00	0.72	4.37	3.71	0.13	0.02
Mai	0.42	0.40	-1.03	-0.26	-0.44	-0.14	0.06	0.19	-0.25	-0.17
Juni	-0.27	-0.56	0.08	-0.05	1.87	1.60	1.27	1.33	0.35	0.43
Juli	0.91	0.78	0.27	0.28	1.70	1.42	1.58	1.50	1.06	1.17
August	0.34	0.55	-0.09	0.03	0.46	0.67	0.15	0.16	-0.43	-0.40
September	-0.24	-0.22	-0.26	-0.30	-0.81	-0.81	0.25	0.32	-0.60	-0.68
Oktober	1.18	1.07	-0.40	-0.14	-0.02	-0.18	0.72	0.79	-0.88	-0.73
November	-0.11	-0.14	-0.65	-0.66	-0.30	-0.26	1.02	1.02	-0.08	0.16
Dezember	-0.25	-0.29	0.25	0.17	0.12	-0.06	0.21	0.15	0.10	-0.11
<b>Jahr</b>	<b>2.88</b>	<b>2.37</b>	<b>-2.52</b>	<b>-1.29</b>	<b>7.21</b>	<b>6.29</b>	<b>2.24</b>	<b>2.73</b>	<b>-1.53</b>	<b>-1.08</b>

#### **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.