

DPAM L BONDS EUR CORPORATE HIGH YIELD - F

Instit. Monatsbericht | 31. Dezember 2021

Morningstar ★★★★★ (*)

ÜBERBLICK

Asset-Klasse	Anleihen
Kategorie	Hochzins
Strategie	Aktive Strategie
Teilfonds des	DPAM L
Rechtsform	SICAV
Domizil	Luxemburg
Fondswährung	EUR
Handelbarkeit	Täglich
Aufledgedatum	23.09.2013
Erstausgabetag	07.11.2013
Vertriebszulassung in	AT, CH, DE, ES, FI, FR, IT, LU, NL
ISIN	LU0966249640
WKN	A1W8R5
Ausgabeaufschlag	Maximum 1%
Rücknahmegebühr	0%
Laufende Kosten*	0.60%
<i>*Einschließlich Verwaltungsvergütung</i>	<i>0.45%</i>
Mindestanlagebetrag	EUR 25'000
NIW (thesaurierend)	155.64
Fondsvermögen	Mio. EUR 479.84
Anzahl der Positionen	166

	Fonds	Benchmark
BRUTTOWERTENTWICKLUNG (IN %)		
1 Monat	0.98	0.87
Laufendes Jahr	2.52	3.58
1 Jahr	2.52	3.58
3 Jahre (p.a.)	5.12	5.49
5 Jahre (p.a.)	3.76	3.69
10 Jahre (p.a.)	-	-

	Fonds	Benchmark
PORTFOLIOEIGENSCHAFTEN		
Durchschn. Fälligkeit (Jahren)	2.55	2.79
Duration (Jahren)	3.37	3.37
Modified Duration (%)	3.27	3.28
Yield to Worst (%)	3.06	2.77
YTW (ModDur Weighted) (%)	2.92	2.81
Anzahl der Emittenten	112	305

ANLAGEUNIVERSUM

Der Fonds investiert überwiegend in fest oder variabel verzinsliche kurz-, mittel- oder langfristige und auf Euro lautende Anleihen und/oder andere Schuldtitel (insbesondere Anleihen mit unendlicher Laufzeit (»Perpetuals«) und Nullkuponanleihen, nachrangige Anleihen oder Anleihen, bei denen die Zinsen durch Emission neuer Anleihen thesauriert oder ausgezahlt werden (»PIK Bonds«), die von Unternehmen (außer von Unternehmen aus dem Finanzsektor) aus aller Welt begeben werden und eine hohe Rendite bieten.

BENCHMARK

Bloomberg Euro High Yield 3% Capped ex Fin

AUFTEILUNG (IN%)

Branchen	Fonds	Bench	Rating	Fonds	Bench
Industrie	31.8	28.0	BBB	0.0	1.7
Kommunikation	24.3	24.3	BB	51.9	61.5
Zyklische Konsumgüter	22.8	25.0	B	39.0	30.4
Basiskonsumgüter	15.3	12.7	C-Kategorie	8.2	6.4
Technologie	3.3	3.4	Barguthaben	1.0	0.0
Energie	1.2	2.6			
Versorger	0.2	3.9			
Derivate	0.0	0.0			
Barguthaben	1.0	0.0			

Modified durations	Fonds	Bench	Länder	Fonds	Bench
< 3%	48.7	49.3	Frankreich	29.1	16.7
3 - 5%	35.4	34.7	Vereinigte Staaten	12.1	15.9
5 - 7%	12.6	12.8	Deutschland	12.0	14.2
7 - 10%	2.2	3.0	Grossbritannien	10.6	8.0
> 15%	0.1	0.2	Niederlande	8.3	4.9
Barguthaben	1.0	0.0	Luxemburg	7.7	5.1
			Spanien	5.6	10.7
			Italien	3.7	11.8
			Japan	2.6	2.4
			Schweden	2.3	2.0
			Andere	5.2	8.3
			Barguthaben	1.0	0.0

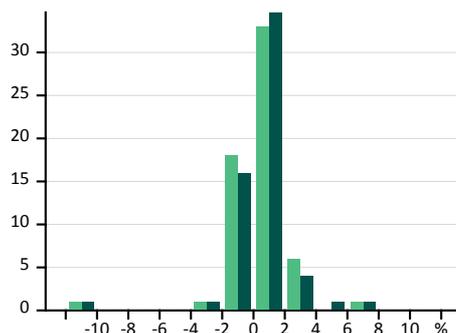
DPAM L BONDS EUR CORPORATE HIGH YIELD - F

Instit. Monatsbericht | 31. Dezember 2021

Fondswährung EUR | Beobachtungszeitraum - 5 Jahre

Fonds Benchmark

VERTEILUNG DER MONATLICHEN ERGEBNISSE



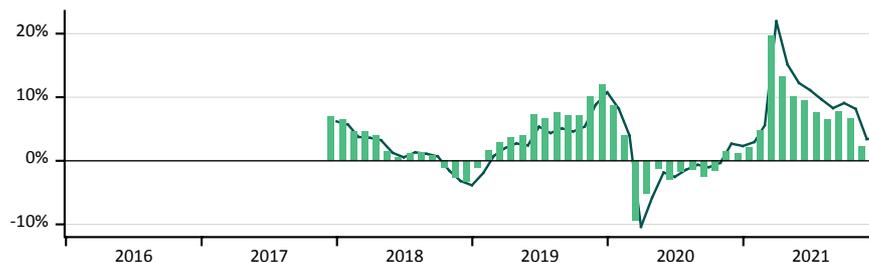
KUMULIERTE WERTENTWICKLUNG



STATISTISCHE ANGABEN

		Fonds	Benchmark
Volatilität	%	7.34	7.60
Sharpe Ratio		0.57	0.55
Downside Deviation	%	5.68	6.01
Sortino Ratio		0.74	0.69
Anzahl positiver Monate	%	66.67	70.00
Maximaler Verlust	%	-14.70	-14.75
Risikoloser Zins		-0.48%	

ROLLIERENDE 12-MONATSERGEBNISSE

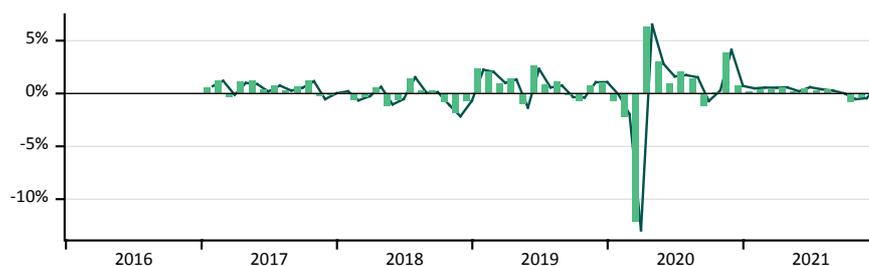


FONDS VERSUS BENCHMARK

Korrelation		0.994
R ²		0.988
Alpha	%	0.02
Beta		0.959
Treynor Ratio	%	4.40
Tracking Error	%	0.87
Information Ratio		0.043

Benchmark: Bloomberg Euro High Yield 3% Capped ex Fin

MONATSERGEBNISSE



MONATSERGEBNISSE (IN %)

	2017		2018		2019		2020		2021	
	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark
Januar	0.54	0.69	0.14	0.21	2.36	2.25	-0.67	-0.13	0.22	0.49
Februar	1.21	1.20	-0.59	-0.65	2.08	2.03	-2.24	-1.96	0.37	0.56
März	-0.33	-0.12	-0.30	-0.25	0.93	1.00	-12.15	-12.93	0.35	0.54
April	1.16	1.00	0.57	0.63	1.44	1.33	6.31	6.52	0.54	0.58
Mai	1.27	0.88	-1.17	-1.04	-0.97	-1.34	3.01	2.80	0.18	0.21
Juni	0.37	0.19	-0.58	-0.53	2.66	2.33	0.98	1.61	0.47	0.59
Juli	0.79	0.75	1.43	1.53	0.83	0.57	2.07	1.74	0.24	0.40
August	0.25	0.27	0.30	0.05	1.18	0.75	1.44	1.53	0.39	0.27
September	0.67	0.53	0.31	0.12	-0.17	-0.34	-1.15	-0.72	-0.03	0.01
Oktober	1.27	1.16	-0.79	-1.09	-0.73	-0.38	0.10	0.30	-0.82	-0.54
November	-0.26	-0.54	-1.81	-2.16	0.79	1.06	3.89	4.13	-0.37	-0.44
Dezember	-0.16	0.02	-0.70	-0.68	1.04	1.07	0.78	0.71	0.98	0.87
Jahr	6.95	6.19	-3.20	-3.85	11.98	10.77	1.18	2.33	2.52	3.58

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.