

# DPAM L Bonds EUR Government 1-5 - F

Instit. Monatsbericht | 30. September 2020

Morningstar ★★★★★ (\*)

## ÜBERBLICK

Asset-Klasse	Anleihen
Kategorie	Government Investment Grade
Strategie	Aktive Strategie
Teilfonds des	DPAM L
Rechtsform	SICAV
Domizil	Luxemburg
Fondswährung	EUR
Handelbarkeit	Täglich
Auflagedatum	19.08.2014
Erstausgabebetrag	31.08.2014
Vertriebszulassung in	

AT, CH, DE, ES, FR, IT, LU, NL

ISIN	LU1090892222
WKN	A12BGV
Ausgabeaufschlag	Maximum 1%
Rücknahmegebühr	0%
Laufende Kosten*	0.33%
*Einschließlich Verwaltungsvergütung	0.05%
Mindestanlagebetrag	EUR 25'000
NIW (thesaurierend)	101.42
Fondsvermögen	Mio. EUR 9.91
Anzahl der Positionen	34

Fonds Benchmark

## BRUTTOWERTENTWICKLUNG (IN %)

1 Monat	0.12	0.23
Laufendes Jahr	-0.20	0.40
1 Jahr	-0.95	-0.27
3 Jahre (p.a.)	-0.08	0.45
5 Jahre (p.a.)	0.12	0.51
10 Jahre (p.a.)	-	-

Fonds Benchmark

## PORTFOLIOEIGENSCHAFTEN

Durchschn. Fälligkeit (Jahren)	2.72	2.83
Duration (Jahren)	2.72	2.74
Modified Duration (%)	2.73	2.75
Yield to Worst (%)	-0.38	-0.47
YTW (ModDur Weighted) (%)	-0.37	-0.45
Anzahl der Emittenten	16	19

## ANLAGEUNIVERSUM

Der Fonds legt sein Vermögen hauptsächlich in auf Euro lautenden fest oder variabel verzinslichen Anleihen und/oder anderen Schuldtiteln mit einer Restlaufzeit zum Zeitpunkt des Erwerbs durch den Teilfonds von höchstens fünf Jahren an, die von Staaten (einschließlich der jeweiligen Gebiets- und/oder regionalen Körperschaften) oder von internationalen Einrichtungen (z. B. der Weltbank oder der Europäischen Bank für Wiederaufbau und Entwicklung) begeben oder garantiert werden, die von den Ratingagenturen S&P bzw. Moody's ein Rating von mindestens BBB- bzw. Baa3 (»Investment Grade«) oder ein gleichwertiges Rating besitzen.

## BENCHMARK

Bloomberg Barclays Euro Treasury 1-5 Years

## AUFTEILUNG (IN%)

Länder	Fonds	Bench	Modified durations	Fonds	Bench
Italien	24.6	25.9	< 3%	65.3	60.9
Deutschland	15.9	20.6	3 - 5%	32.1	39.1
Frankreich	14.7	21.7	Barguthaben	2.6	0.0
Spanien	13.9	13.0			
Niederlande	7.7	4.4			
Portugal	5.8	1.6			
Supranational	4.8	0.0			
Rumänien	3.9	0.0			
Irland	2.2	1.7			
Slowakei	1.7	0.4			
Anderere	2.2	10.8			
Barguthaben	2.6	0.0			

Rating	Fonds	Bench	Währungen	Fonds	Bench
AAA	28.4	25.1	Euro	100.0	100.0
AA+	2.2	5.3			
AA	14.7	21.7			
AA-	2.2	6.7			
A+	1.7	0.6			
A-	13.9	13.0			
BBB-	34.3	27.6			
High-Yield	0.0	0.0			
Barguthaben	2.6	0.0			

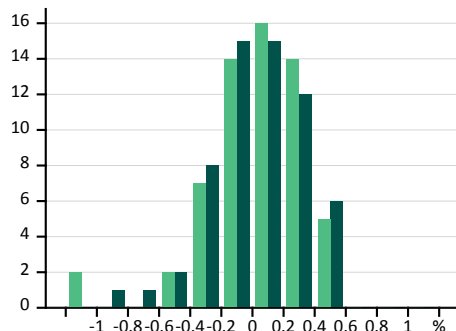
## DPAM L Bonds EUR Government 1-5 - F

Instit. Monatsbericht | 30. September 2020

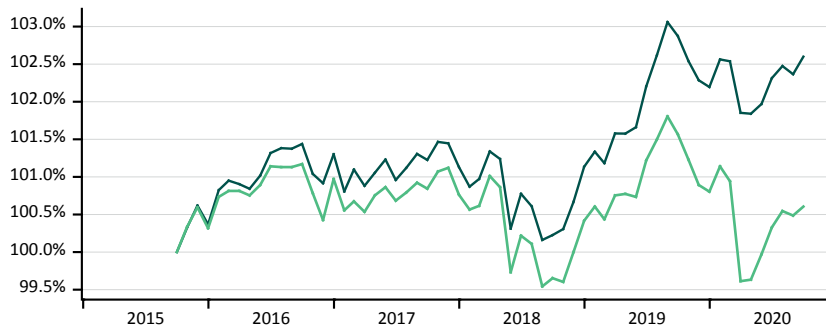
Fondswährung EUR | Beobachtungszeitraum - 5 Jahre

Fonds Benchmark

### VERTEILUNG DER MONATLICHEN ERGEBNISSE



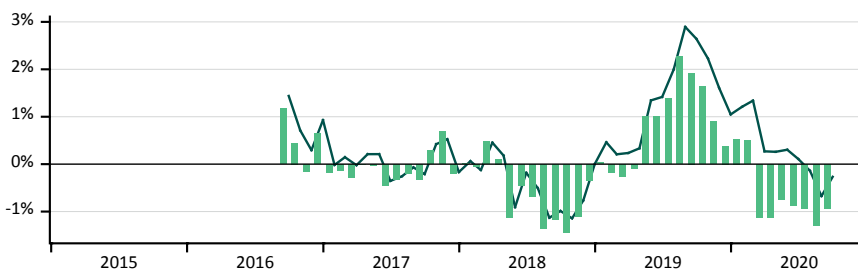
### KUMULIERTE WERTENTWICKLUNG



### STATISTISCHE ANGABEN

		Fonds	Benchmark
Volatilität	%	1.19	1.03
Sharpe Ratio		0.43	0.88
Downside Deviation	%	0.89	0.66
Sortino Ratio		0.58	1.39
Anzahl positiver Monate	%	55.00	55.00
Maximaler Verlust	%	-2.15	-1.29
Risikoloser Zins		<b>-0.40%</b>	

### ROLLIERENDE 12-MONATSERGEBNISSE

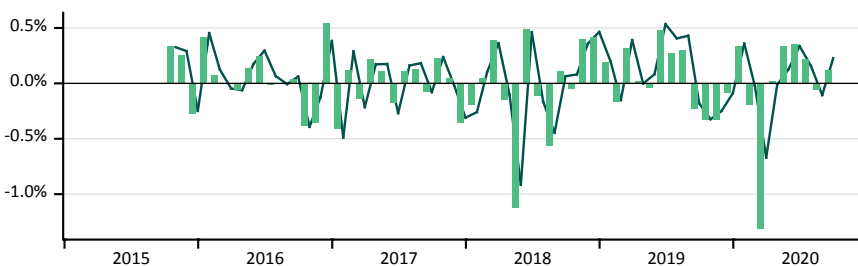


### FONDS VERSUS BENCHMARK

Korrelation		0.947
R <sup>2</sup>		0.896
Alpha	%	-0.04
Beta		1.096
Treynor Ratio	%	0.47
Tracking Error	%	0.40
Information Ratio		-0.984

Benchmark: Bloomberg Barclays Euro Treasury 1-5 Years

### MONATSERGEBNISSE



### MONATSERGEBNISSE (IN %)

	2016		2017		2018		2019		2020	
	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark
Januar	0.42	0.45	-0.41	-0.49	-0.20	-0.26	0.19	0.20	0.33	0.36
Februar	0.08	0.13	0.12	0.29	0.05	0.10	-0.17	-0.15	-0.20	-0.02
März	0.00	-0.05	-0.14	-0.21	0.39	0.36	0.32	0.39	-1.32	-0.67
April	-0.06	-0.06	0.22	0.17	-0.15	-0.10	0.02	-0.00	0.02	-0.01
Mai	0.14	0.17	0.11	0.17	-1.12	-0.91	-0.04	0.08	0.34	0.13
Juni	0.25	0.30	-0.18	-0.27	0.49	0.46	0.48	0.53	0.36	0.34
Juli	-0.01	0.06	0.11	0.16	-0.11	-0.16	0.27	0.41	0.22	0.16
August	0.00	-0.01	0.13	0.18	-0.56	-0.45	0.30	0.43	-0.06	-0.11
September	0.04	0.06	-0.08	-0.08	0.11	0.06	-0.23	-0.18	0.12	0.23
Oktober	-0.38	-0.39	0.23	0.24	-0.05	0.08	-0.33	-0.32		
November	-0.35	-0.12	0.05	-0.02	0.40	0.36	-0.33	-0.25		
Dezember	0.54	0.38	-0.35	-0.31	0.42	0.46	-0.09	-0.09		
<b>Jahr</b>	<b>0.65</b>	<b>0.93</b>	<b>-0.21</b>	<b>-0.17</b>	<b>-0.34</b>	<b>0.00</b>	<b>0.39</b>	<b>1.05</b>	<b>-0.20</b>	<b>0.40</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.