

DPAM L BONDS CLIMATE TRENDS SUSTAINABLE - F

Instit. Monatsbericht | 31. Dezember 2021

ÜBERBLICK

Asset-Klasse	Anleihen
Kategorie	Aggregate
Strategie	Aktive Strategie
Teilfonds des	DPAM L
Rechtsform	SICAV
Domizil	Luxemburg
Fondswährung	EUR
Handelbarkeit	Täglich
Auflagedatum	28.06.2019
Erstausgabetag	28.06.2019
Vertriebszulassung in	AT, CH, DE, ES, FR, IT, LU, NL

ISIN	LU1996436579
Ausgabeaufschlag	Maximum 1%
Rücknahmegebühr	0%
Laufende Kosten*	0.58%
<i>*Einschließlich Verwaltungsvergütung</i>	0.40%
Mindestanlagebetrag	EUR 25'000
NIW (thesaurierend)	103.98
Fondsvermögen	Mio. EUR 479.60
Anzahl der Positionen	214

Fonds Benchmark

BRUTTOWERTENTWICKLUNG (IN %)

	Fonds	Benchmark
1 Monat	0.05	-1.20
Laufendes Jahr	-0.61	-2.85
1 Jahr	-0.61	-2.85
3 Jahre (p.a.)	-	-
5 Jahre (p.a.)	-	-
10 Jahre (p.a.)	-	-

Fonds Benchmark

PORTFOLIOEIGENSCHAFTEN

	Fonds	Benchmark
Durchschn. Fälligkeit (Jahren)	6.05	-
Duration (Jahren)	5.83	-
Modified Duration (%)	5.73	-
Yield to Worst (%)	1.78	-
YTW (ModDur Weighted) (%)	1.65	-
Anzahl der Emittenten	157	-

ANLAGEUNIVERSUM

Der Teilfonds investiert in erster Linie in ein diversifiziertes Portfolio von Anleihen mit „Investment Grade“-Status, die von einem Staat oder Unternehmen begeben werden. Der Teilfonds ist weder geographisch noch währungsspezifisch beschränkt. Bei der aktiven Verwaltung des Teilfonds wählt der Anlageverwalter Anlagen mit hohen Kriterien für Umwelt, Soziales und Governance (ESG) und einer potenziellen Rendite, die im Verhältnis zu ihrem geschätzten Risiko von Vorteil ist. Diese Anlagen umfassen Anleihen, die Projekte in Bezug auf den ökologischen Wandel finanzieren („grüne Anleihen“).

BENCHMARK

Bloomberg Euro Aggregate Total Return

AUFTEILUNG (IN%)

Branchen		Rating	
Finanzwesen	33.5	AAA	8.6
Gov. & Gov Related	24.6	AA+	0.6
Industrie	18.0	AA	0.2
Versorger	8.7	AA-	0.8
Zyklische Konsumgüter	7.2	A+	1.0
Kommunikation	2.0	A	3.3
Basiskonsumgüter	1.0	A-	7.9
Technologie	0.6	BBB+	7.1
Derivate	0.0	BBB	16.4
Barguthaben	4.4	BBB-	17.2
		High-Yield	29.6
		Ohne Rating	3.0
		Derivate	0.0
		Barguthaben	4.4

Kapitalstruktur

Nichtfinanzwerte Senior	30.2
Staatlich / staatsnah	24.6
Finanzwerte Senior	13.2
Banken Senior	11.2
Nichtfinanzwerte Subordinated	7.2
Versicherungen Subordinated	4.0
Banken Lower Tier Two	2.7
Finanzwerte Subordinated	2.4
Derivate	0.0
Barguthaben	4.4

Modified durations

< 3%	7.3
3 - 5%	37.4
5 - 7%	23.4
7 - 10%	18.3
10 - 15%	7.2
> 15%	2.0
Derivate	0.0
Barguthaben	4.4

Währungen nach Absicherung

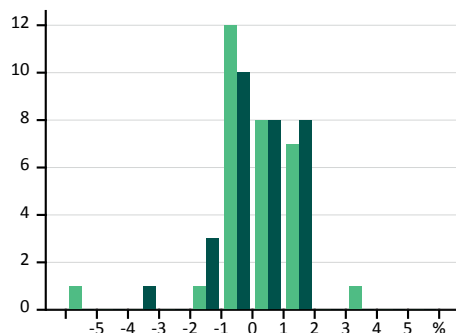
Euro	84.4
US Dollar	3.9
Andere	3.7
Pfund sterling	2.4
Mexikanischer Peso	1.6
Brasilianischer Real	1.5
Norwegische Krone	1.3
Schwedische Krone	1.2

DPAM L BONDS CLIMATE TRENDS SUSTAINABLE - F

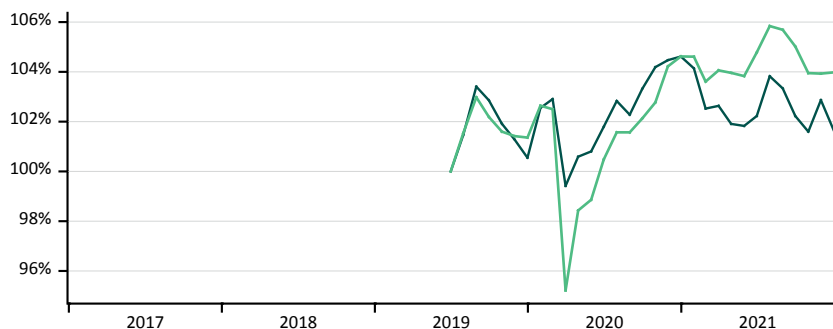
Instit. Monatsbericht | 31. Dezember 2021
 Fondswährung EUR | Seit Auflage (28.06.2019)

Fonds Benchmark

VERTEILUNG DER MONATLICHEN ERGEBNISSE



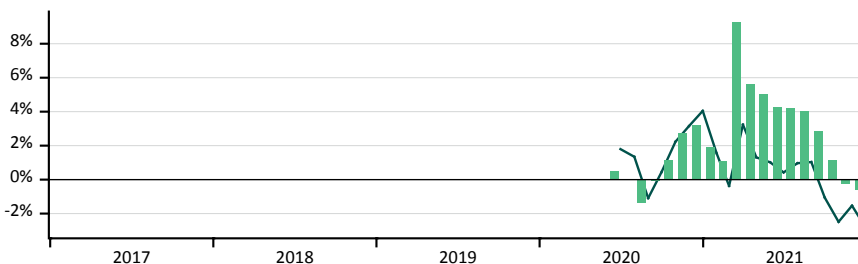
KUMULIERTE WERTENTWICKLUNG



STATISTISCHE ANGABEN

		Fonds	Benchmark
Volatilität	%	-	-
Sharpe Ratio		-	-
Downside Deviation	%	4.60	2.76
Sortino Ratio		0.45	0.43
Anzahl positiver Monate	%	50.00	53.33
Maximaler Verlust	%	-7.54	-3.86
Risikoloser Zins		-0.53%	

ROLLIERENDE 12-MONATSERGEBNISSE

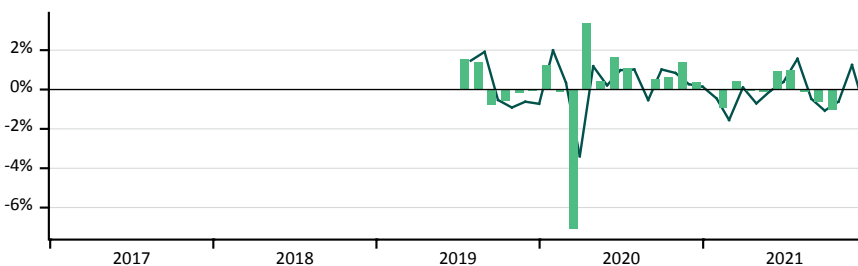


FONDS VERSUS BENCHMARK

Korrelation		0.814
R ²		0.662
Alpha	%	0.07
Beta		1.156
Treynor Ratio	%	1.81
Tracking Error	%	3.39
Information Ratio		0.279

Benchmark: Bloomberg Euro Aggregate Total Return

MONATSERGEBNISSE



MONATSERGEBNISSE (IN %)

	2017		2018		2019		2020		2021	
	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark
Januar							1.26	1.99	-0.01	-0.46
Februar							-0.14	0.35	-0.96	-1.55
März							-7.10	-3.39	0.43	0.11
April							3.37	1.18	-0.10	-0.71
Mai							0.44	0.21	-0.13	-0.08
Juni							1.64	0.98	0.91	0.39
Juli					1.54	1.47	1.08	1.02	1.01	1.56
August					1.42	1.91	0.00	-0.54	-0.14	-0.47
September					-0.77	-0.53	0.55	1.02	-0.63	-1.07
Oktober					-0.58	-0.92	0.63	0.84	-1.02	-0.61
November					-0.18	-0.62	1.41	0.27	-0.02	1.25
Dezember					-0.06	-0.73	0.38	0.14	0.05	-1.20
Jahr					1.36	0.55	3.22	4.05	-0.61	-2.85

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.