

## DPAM BONDS L CORPORATE EUR - F

Instit. Monatsbericht | 31. Dezember 2021

Morningstar ★★☆☆ (\*)

### ÜBERBLICK

Asset-Klasse	Anleihen
Kategorie	Corporate Investment Grade
Strategie	Aktive Strategie
Teilfonds des	DPAM Bonds L
Rechtsform	SICAV
Domizil	Luxemburg
Fondswährung	EUR
Handelbarkeit	Täglich
Aufledgedatum	30.03.1990
Erstausgabebetrag	16.01.2006
Vertriebszulassung in	AT, CH, DE, ES, FR, IT, LU, NL
ISIN	LU0238158421
Ausgabeaufschlag	Maximum 1%
Rücknahmegebühr	0%
Laufende Kosten*	0.43%
*Einschließlich Verwaltungsvergütung	0.30%
Mindestanlagebetrag	EUR 25'000
NIW (thesaurierend)	201.14
Fondsvermögen	Mio. EUR 767.19
Anzahl der Positionen	301

Fonds Benchmark

### BRUTTOWERTENTWICKLUNG (IN %)

	Fonds	Benchmark
1 Monat	-0.13	-0.17
Laufendes Jahr	-1.68	-1.40
1 Jahr	-1.68	-1.40
3 Jahre (p.a.)	1.89	2.16
5 Jahre (p.a.)	1.29	1.48
10 Jahre (p.a.)	3.17	3.34

Fonds Benchmark

### PORTFOLIOEIGENSCHAFTEN

	Fonds	Benchmark
Durchschn. Fälligkeit (Jahren)	5.24	5.60
Duration (Jahren)	5.16	5.41
Modified Duration (%)	5.13	5.39
Yield to Worst (%)	0.47	0.39
YTW (ModDur Weighted) (%)	0.66	0.63
Anzahl der Emittenten	180	680

### ANLAGEUNIVERSUM

Der Teilfonds investiert in erster Linie in ein diversifiziertes Portfolio von Anleihen mit „Investment Grade“-Status oder gleichwertigem Rating (d. h. Wertpapiere, die unabhängig vom wirtschaftlichen Kontext eine hohe Rückzahlungsfähigkeit aufweisen). Der Teilfonds legt den Schwerpunkt auf Unternehmensanleihen, die auf Euro lauten. Anlagen in anderen Währungen sind vollständig oder zum Teil gegen Währungsschwankungen gegenüber dem Euro abgesichert.

### BENCHMARK

80% iBoxx Euro Corporate ex-BBB + 20% iBoxx Euro Corporate BBB

### AUFTEILUNG (IN%)

Branchen	Fonds	Bench	Länder	Fonds	Bench
Banken	22.9	34.8	Vereinigte Staaten	19.5	21.8
Industrie	12.7	9.5	Frankreich	16.7	22.0
Konsumgüter	12.5	13.3	Deutschland	10.7	13.9
Versorger	9.1	7.2	Niederlande	8.0	6.3
Gesundheitswesen	5.7	5.9	Schweiz	6.7	4.7
Immobilien	5.6	3.5	Grossbritannien	6.6	7.5
Versicherungen	5.1	4.7	Italien	4.0	2.5
Chemie	4.9	2.0	Belgien	3.8	1.6
Technologie	4.0	3.0	Australien	3.2	2.0
Finanzwerte	3.9	2.7	Japan	2.7	1.7
Telekommunikation	3.9	3.3	Spanien	2.1	3.3
Energie	2.4	6.6	Luxemburg	1.9	0.4
Dienstleistungen	1.5	3.0	Andere	9.8	12.3
Basisressourcen	1.4	0.4	Barguthaben	4.2	0.0
Barguthaben	4.2	0.0			

Rating	Fonds	Bench	Kapitalstruktur	Fonds	Bench
AAA	0.0	0.5	Nichtfinanzwerte Senior	63.4	58.6
AA	8.3	13.4	Banken Senior	19.2	33.3
A	57.7	66.2	Nichtfinanzwerte Subordinated	4.4	1.9
BBB	29.7	20.0	Versicherungen Subordinated	3.9	2.6
Barguthaben	4.2	0.0	Banken Lower Tier Two	3.6	1.5
			Versicherungen Senior	1.2	2.1
			Derivate	0.0	n.v.
			Barguthaben	4.2	0.0

Währungen	Fonds	Bench	Modified durations	Fonds	Bench
Euro	100.0	100.0	< 3%	21.6	28.0
			3 - 5%	26.5	27.3
			5 - 7%	22.0	19.7
			7 - 10%	20.3	16.4
			10 - 15%	4.8	6.0
			> 15%	0.7	2.6
			Barguthaben	4.2	0.0

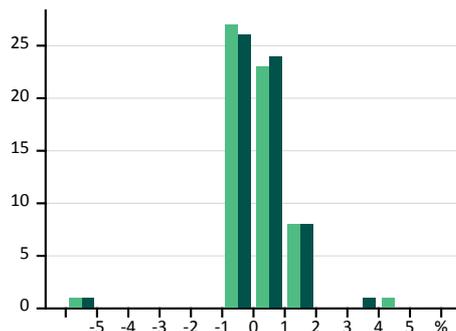
## DPAM BONDS L CORPORATE EUR - F

Instit. Monatsbericht | 31. Dezember 2021

Fondswahrung EUR | Beobachtungszeitraum - 5 Jahre

Fonds Benchmark

### VERTEILUNG DER MONATLICHEN ERGEBNISSE



### KUMULIERTE WERTENTWICKLUNG



### STATISTISCHE ANGABEN

		Fonds	Benchmark
Volatilitat	%	4.10	4.03
Sharpe Ratio		0.43	0.48
Downside Deviation	%	3.11	3.05
Sortino Ratio		0.57	0.64
Anzahl positiver Monate	%	53.33	55.00
Maximaler Verlust	%	-7.35	-7.21
Risikoloser Zins <b>-0.48%</b>			

### ROLLIERENDE 12-MONATSERGEBNISSE

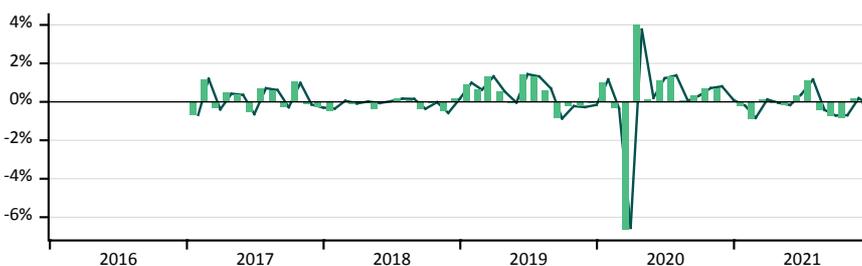


### FONDS VERSUS BENCHMARK

Korrelation		0.998
R <sup>2</sup>		0.996
Alpha	%	-0.02
Beta		1.015
Treynor Ratio	%	1.73
Tracking Error	%	0.27
Information Ratio		-0.707

Benchmark: 80% iBoxx Euro Corporate ex-BBB + 20% iBoxx Euro Corporate BBB

### MONATSERGEBNISSE



### MONATSERGEBNISSE (IN %)

	2017		2018		2019		2020		2021	
	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark
Januar	-0.68	-0.68	-0.47	-0.35	0.93	0.99	0.99	1.17	-0.20	-0.20
Februar	1.19	1.20	-0.02	0.06	0.64	0.63	-0.30	-0.34	-0.92	-0.83
Marz	-0.34	-0.39	-0.11	-0.09	1.30	1.32	-6.67	-6.55	0.14	0.12
April	0.50	0.42	0.04	0.01	0.54	0.53	4.02	3.76	-0.04	-0.05
Mai	0.40	0.36	-0.38	-0.07	-0.07	-0.04	0.13	0.21	-0.17	-0.17
Juni	-0.51	-0.64	0.05	0.03	1.42	1.44	1.13	1.23	0.32	0.39
Juli	0.70	0.71	0.17	0.17	1.30	1.32	1.31	1.37	1.13	1.16
August	0.58	0.61	0.07	0.15	0.61	0.70	0.07	0.05	-0.45	-0.42
September	-0.29	-0.28	-0.39	-0.36	-0.85	-0.87	0.33	0.32	-0.72	-0.71
Oktober	1.05	0.98	-0.05	-0.02	-0.22	-0.22	0.70	0.72	-0.83	-0.70
November	-0.11	-0.14	-0.50	-0.58	-0.24	-0.27	0.70	0.80	0.18	0.19
Dezember	-0.26	-0.30	0.17	0.17	-0.09	-0.16	0.03	0.09	-0.13	-0.17
<b>Jahr</b>	<b>2.23</b>	<b>1.84</b>	<b>-1.41</b>	<b>-0.88</b>	<b>5.36</b>	<b>5.47</b>	<b>2.11</b>	<b>2.53</b>	<b>-1.68</b>	<b>-1.40</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.