

# DPAM Bonds L EUR Selection - F

Instit. Monatsbericht | 30. September 2020

Morningstar ★★★★★ (\*)

## ÜBERBLICK

Asset-Klasse	Anleihen
Kategorie	Government Investment Grade
Teilfonds des	DPAM Bonds L
Rechtsform	SICAV
Domizil	Luxemburg
Fondswährung	EUR
Handelbarkeit	Täglich
Auflagedatum	29.11.2005
Erstausgabebetrag	29.11.2005
Vertriebszulassung in	AT, DE, ES, FR, IT, LU

ISIN	LU0238162969
Ausgabeaufschlag	Maximum 1%
Rücknahmegebühr	0%
Laufende Kosten*	0.37%
<i>*Einschließlich Verwaltungsvergütung</i>	0.20%
Mindestanlagebetrag	EUR 25'000
NIW (thesaurierend)	179.97
Fondsvermögen	Mio. EUR 181.02
Anzahl der Positionen	76

	Fonds	Benchmark
<b>BRUTTOWERTENTWICKLUNG (IN %)</b>		
1 Monat	1.31	1.45
Laufendes Jahr	3.12	3.76
1 Jahr	0.35	0.75
3 Jahre (p.a.)	4.04	4.05
5 Jahre (p.a.)	2.98	3.08
10 Jahre (p.a.)	4.35	4.18

	Fonds	Benchmark
<b>PORTFOLIOEIGENSCHAFTEN</b>		
Durchschn. Fälligkeit (Jahren)	9.76	10.51
Duration (Jahren)	8.28	8.83
Modified Duration (%)	8.27	8.84
Yield to Worst (%)	0.15	-0.08
YTW (ModDur Weighted) (%)	0.36	0.18
Anzahl der Emittenten	29	12

## ANLAGEUNIVERSUM

Der Teilfonds investiert in erster Linie in ein Portfolio von Anleihen, die von Regierungen oder verwandten Organismen begeben werden und gedeckte Schuldverschreibungen umfassen. Die ausgewählten Anleihen haben „Investment Grade“-Status (d. h. es handelt sich um Wertpapiere, die unabhängig vom wirtschaftlichen Kontext eine hohe Rückzahlungsfähigkeit aufweisen). Der Teilfonds legt den Schwerpunkt auf erstklassige Anleihen, die auf europäische Währungen lauten und deren Emittenten einen guten Ruf haben.

## BENCHMARK

JPM EMU Government Investment Grade Total Return (seit 01.01.2011)  
Vorheriger Benchmark: JPM EMU Government Bond Total Return

## AUFTEILUNG (IN%)

Länder	Fonds	Bench	Rating	Fonds	Bench
Italien	25.9	22.7	AAA	18.6	21.1
Spanien	15.4	14.7	AA+	3.0	5.3
Frankreich	9.7	25.6	AA	11.8	25.6
Belgien	6.9	6.2	AA-	8.2	8.2
Deutschland	6.6	16.2	A+	1.0	0.0
Portugal	5.0	2.4	A-	19.1	14.7
Slowenien	3.9	0.0	BBB	2.8	0.0
Polen	3.7	0.0	BBB-	30.8	25.1
Slowakei	3.4	0.0	Barguthaben	4.8	0.0
Niederlande	3.1	4.8			
Andere	11.8	7.3			
Barguthaben	4.8	0.0			

Modified durations	Fonds	Bench	Währungen	Fonds	Bench
< 3%	5.5	18.7	Euro	100.0	100.0
3 - 5%	15.8	16.5			
5 - 7%	27.7	16.4			
7 - 10%	18.0	19.1			
10 - 15%	15.9	12.7			
> 15%	12.2	16.6			
Barguthaben	4.8	0.0			

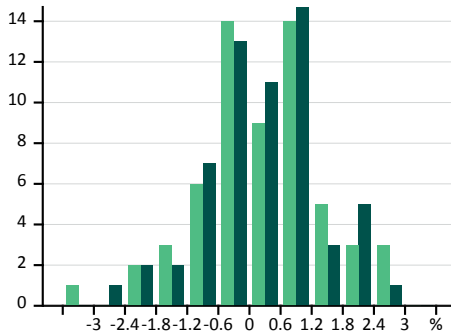
# DPAM Bonds L EUR Selection - F

Instit. Monatsbericht | 30. September 2020

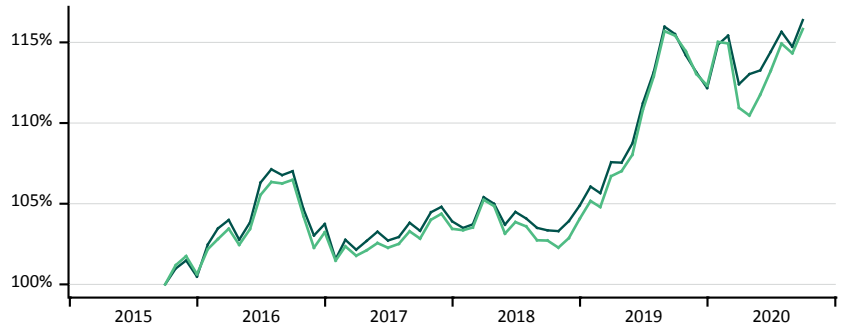
Fondswahrung EUR | Beobachtungszeitraum - 5 Jahre

Fonds Benchmark

## VERTEILUNG DER MONATLICHEN ERGEBNISSE



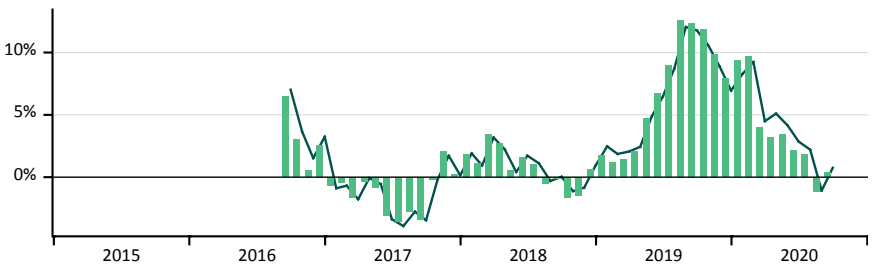
## KUMULIERTE WERTENTWICKLUNG



## STATISTISCHE ANGABEN

		Fonds	Benchmark
Volatilitat	%	4.13	3.99
Sharpe Ratio		0.82	0.87
Downside Deviation	%	2.53	2.34
Sortino Ratio		1.33	1.48
Anzahl positiver Monate	%	56.67	58.33
Maximaler Verlust	%	-4.70	-5.20
Risikoloser Zins <b>-0.40%</b>			

## ROLLIERENDE 12-MONATSERGEBNISSE

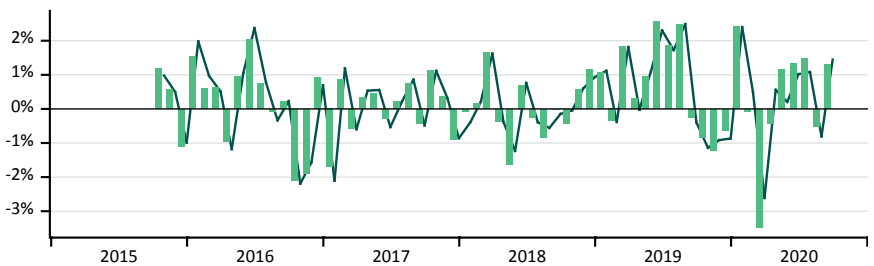


## FONDS VERSUS BENCHMARK

Korrelation		0.966
R <sup>2</sup>		0.934
Alpha	%	-0.01
Beta		0.998
Treynor Ratio	%	3.37
Tracking Error	%	1.06
Information Ratio		-0.091

Benchmark: JPM EMU Government Investment Grade Total Return (seit 01.01.2011)  
Fruher: JPM EMU Government Bond Total Return

## MONATSERGEBNISSE



## MONATSERGEBNISSE (IN %)

	2016		2017		2018		2019		2020	
	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark
Januar	1.54	1.98	-1.70	-2.11	-0.08	-0.39	1.06	1.12	2.41	2.40
Februar	0.61	0.97	0.87	1.19	0.16	0.22	-0.35	-0.38	-0.08	0.49
Marz	0.63	0.51	-0.57	-0.60	1.65	1.62	1.82	1.82	-3.47	-2.61
April	-0.96	-1.18	0.33	0.53	-0.37	-0.39	0.30	-0.02	-0.43	0.56
Mai	0.95	1.05	0.44	0.56	-1.63	-1.23	0.95	1.11	1.16	0.20
Juni	2.04	2.37	-0.28	-0.53	0.69	0.76	2.57	2.30	1.32	1.02
Juli	0.76	0.78	0.23	0.21	-0.26	-0.39	1.86	1.72	1.49	1.08
August	-0.08	-0.34	0.76	0.86	-0.83	-0.56	2.49	2.49	-0.52	-0.81
September	0.21	0.23	-0.44	-0.48	-0.02	-0.15	-0.24	-0.40	1.31	1.45
Oktober	-2.11	-2.19	1.13	1.12	-0.43	-0.05	-0.84	-1.14		
November	-1.88	-1.57	0.36	0.32	0.58	0.60	-1.23	-0.91		
Dezember	0.94	0.69	-0.89	-0.86	1.16	0.93	-0.64	-0.87		
<b>Jahr</b>	<b>2.58</b>	<b>3.25</b>	<b>0.21</b>	<b>0.15</b>	<b>0.60</b>	<b>0.95</b>	<b>7.93</b>	<b>6.94</b>	<b>3.12</b>	<b>3.76</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.