

# DPAM CAPITAL B EQUITIES US BEHAVIORAL VALUE - F

Instit. Monatsbericht | 31. Dezember 2021

Morningstar ★★★★★ (\*)

## ÜBERBLICK

Asset-Klasse	Aktien
Kategorie	USA
Strategie	Aktive Strategie
Teilfonds des	DPAM Capital B
Rechtsform	SICAV
Domizil	Belgien
Fondswährung	EUR
Handelbarkeit	Täglich
Aufliedatum	30.01.2004
Erstausgabebetag	14.12.2007
Vertriebszulassung in	AT, BE, CH, DE, ES, FR, IT, LU, NL
ISIN	BE0947579836
WKN	AORHMT
Ausgabeaufschlag	Maximum 1%
Rücknahmegebühr	0%
Laufende Kosten*	0.88%
*Einschließlich Verwaltungsvergütung	0.80%
Mindestanlagebetrag	EUR 25'000
NIW (thesaurierend)	2'180.31
Fondsvermögen	Mio. EUR 790.18
Anzahl der Positionen	122

	Fonds	Benchmark
<b>BRUTTOWERTENTWICKLUNG (IN %)</b>		
1 Monat	5.04	2.86
Laufendes Jahr	37.97	36.06
1 Jahr	37.97	36.06
3 Jahre (p.a.)	21.02	26.17
5 Jahre (p.a.)	10.69	16.35
10 Jahre (p.a.)	14.62	17.51

	Fonds	Benchmark
<b>PORTFOLIOEIGENSCHAFTEN</b>		
Dividendenrendite (%)	1.63	1.25

## ANLAGEUNIVERSUM

Der Fonds investiert in Aktien amerikanischer Unternehmen (und andere aktienähnliche Wertpapiere), Optionsscheine, Bezugsrechte und in liquide Mittel. Mindestens achtzig Prozent des Bruttovermögens des Teilfonds werden in Aktien und andere Wertpapiere und Anteilsrechte an Unternehmen investiert, die ihren Sitz oder ihren Tätigkeitsschwerpunkt in den Vereinigten Staaten haben. Die restlichen zwanzig Prozent können in liquiden Mitteln angelegt werden. Die Anlagepolitik basiert auf den Grundsätzen der Verhaltensökonomie, einer akademischen Disziplin, die bei der Analyse der Finanzmärkte psychologische Komponenten berücksichtigt. Der Fonds investiert in Aktien, die als unterbewertet erachtet werden und eine positive Dynamik aufweisen.

## BENCHMARK

MSCI USA Net Return

## AUFTEILUNG (IN%)

Branchen	Fonds	Bench
Informationstechnologie	28.9	29.9
Gesundheitswesen	13.4	13.1
Nicht-Basiskonsumgüter	12.1	12.6
Finanzwesen	11.3	10.5
Kommunikation	9.7	10.1
Industrie	7.8	7.8
Basiskonsumgüter	5.7	5.7
Energie	3.0	2.5
Versorger	2.9	2.4
Immobilien	2.7	2.9
Roh-, Hilfs- und Betr.-Stoffe	2.4	2.5
Barguthaben	0.0	0.0

## Top 10

	Fonds	Bench
Microsoft		5.4
Alphabet A		3.2
Home Depot		1.8
Applied Materials		1.8
Visa A		1.4
Nxp Semiconductors N.v.		1.4
Ford Motor Company		1.4
Citizens Financial Group, Inc.		1.3
Pfizer		1.3
Morgan Stanley		1.3

Länder	Fonds	Bench
Vereinigte Staaten	100.0	100.0
Barguthaben	0.0	0.0

## Währungen

	Fonds	Bench
US Dollar	100.0	99.6
Schweizer Franken	0.0	0.0
Euro	-0.0	0.4

## TOP 5 ÜBER-UND UNTERGEWICHTUNGEN

Top 5 Übergewichtungen	Aktive Gewichtung
Applied Materials	+1.42
Citizens Financial Group, Inc.	+1.27
Nxp Semiconductors N.v.	+1.25
Alphabet A	+1.20
Ford Motor Company	+1.20

Top 5 Untergewichtungen	Aktive Gewichtung
Apple	-6.82
Amazon Com	-3.53
Tesla Motors, Inc.	-2.07
Alphabet C	-1.94
Facebook A	-1.86

## TOP 5 NACH PERFORMANCEBEITRAG (+/-)

Top 5 höchster Performancebeitrag	Beitrag
Amazon Com	+0.34
Nvidia Corp	+0.27
Tesla Motors, Inc.	+0.27
Centene Corporation	+0.10
Juniper Networks	+0.10

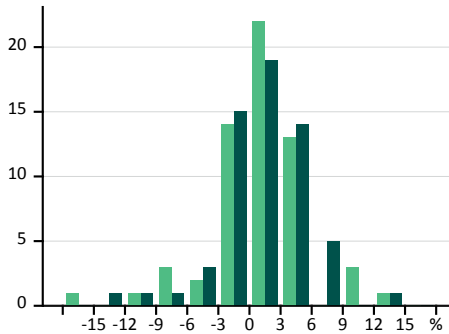
Top 5 niedrigster Performancebeitrag	Beitrag
Apple	-0.23
Carmax, Inc.	-0.10
UnitedHealth Group	-0.09
Broadcom Inc	-0.09
Procter & Gamble	-0.08

# DPAM CAPITAL B EQUITIES US BEHAVIORAL VALUE - F

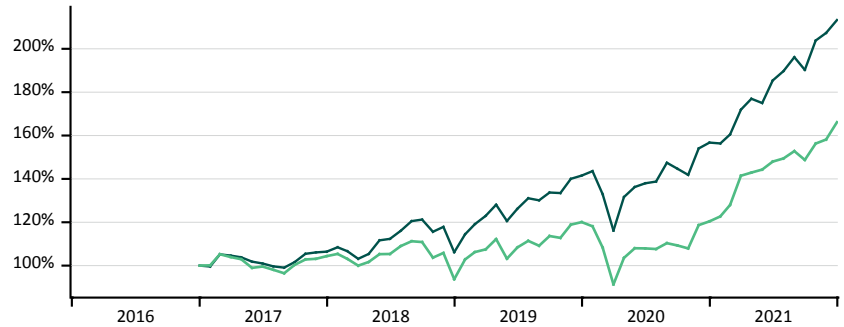
Instit. Monatsbericht | 31. Dezember 2021  
 Fondswahrung EUR | Beobachtungszeitraum - 5 Jahre

Fonds Benchmark

## VERTEILUNG DER MONATLICHEN ERGEBNISSE



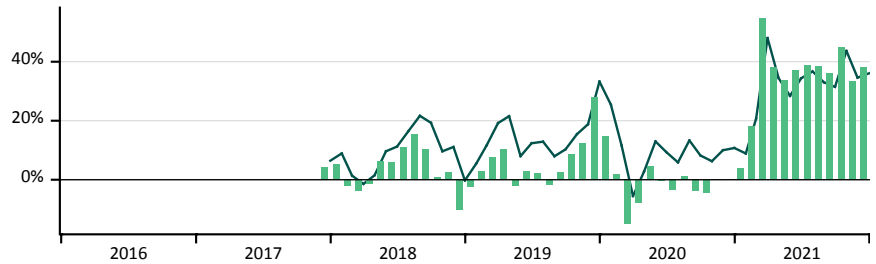
## KUMULIERTE WERTENTWICKLUNG



## STATISTISCHE ANGABEN

		Fonds	Benchmark
Volatilitat	%	16.56	14.88
Sharpe Ratio		0.67	1.13
Downside Deviation	%	10.95	8.98
Sortino Ratio		1.01	1.87
Anzahl positiver Monate	%	65.00	65.00
Maximaler Verlust	%	-23.92	-19.10
Risikoloser Zins <b>-0.48%</b>			

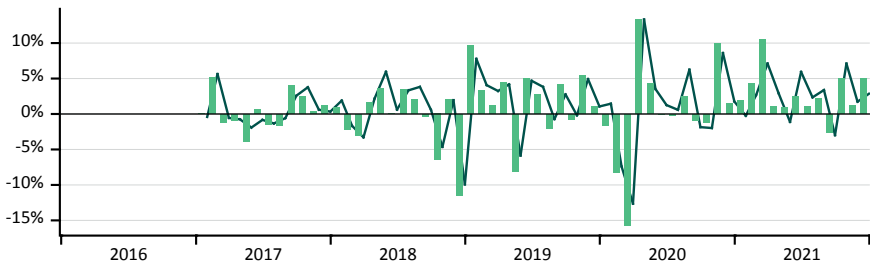
## ROLLIERENDE 12-MONATSERGEBNISSE



## FONDS VERSUS BENCHMARK

Korrelation		0.952
R <sup>2</sup>		0.907
Alpha	%	-0.48
Beta		1.060
Treynor Ratio	%	10.48
Tracking Error	%	5.13
Information Ratio		-0.933
Benchmark: MSCI USA Net Return		

## MONATSERGEBNISSE



## MONATSERGEBNISSE (IN %)

	2017		2018		2019		2020		2021	
	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark
Januar	0.13	-0.41	0.97	1.89	9.70	7.78	-1.61	1.45	1.90	-0.25
Februar	5.12	5.63	-2.16	-1.67	3.32	4.07	-8.28	-7.40	4.31	2.66
Marz	-1.24	-0.55	-3.03	-3.29	1.18	3.24	-15.69	-12.64	10.52	7.12
April	-0.96	-0.75	1.68	2.17	4.41	4.17	13.37	13.32	1.03	2.92
Mai	-3.87	-1.91	3.55	5.95	-8.05	-5.85	4.30	3.52	0.98	-1.11
Juni	0.61	-0.83	0.07	0.62	5.03	4.68	-0.08	1.26	2.54	5.93
Juli	-1.50	-1.33	3.47	3.33	2.80	3.82	-0.26	0.58	0.99	2.34
August	-1.62	-0.58	2.04	3.83	-2.02	-0.72	2.52	6.25	2.25	3.38
September	4.01	2.58	-0.34	0.59	4.10	2.77	-0.97	-1.85	-2.66	-2.98
Oktober	2.47	3.77	-6.49	-4.64	-0.75	-0.19	-1.25	-1.98	5.07	7.11
November	0.30	0.60	2.08	1.95	5.40	4.92	9.95	8.59	1.20	1.73
Dezember	1.20	0.34	-11.44	-9.92	1.00	1.06	1.47	1.76	5.04	2.86
<b>Jahr</b>	<b>4.38</b>	<b>6.45</b>	<b>-10.20</b>	<b>-0.25</b>	<b>28.09</b>	<b>33.28</b>	<b>0.29</b>	<b>10.75</b>	<b>37.97</b>	<b>36.06</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.