

# DPAM CAPITAL B BONDS EUR MEDIUM TERM - A

Instit. Monatsbericht | 31. Dezember 2021

Morningstar ★★☆☆ (\*)

## ÜBERBLICK

Asset-Klasse	Anleihen
Kategorie	Government Investment Grade
Strategie	Aktive Strategie
Teilfonds des	DPAM Capital B
Rechtsform	SICAV
Domizil	Belgien
Fondswährung	EUR
Handelbarkeit	Täglich
Auflagedatum	29.09.1992
Erstausgabetermin	27.12.2013
Vertriebszulassung in	

BE, DE, ES, FR, LU

ISIN	BE6261452054
Ausgabeaufschlag	Maximum 2%
Rücknahmegebühr	0%
Laufende Kosten*	0.49%
<i>*Einschließlich Verwaltungsvergütung</i>	0.30%
Mindestanlagebetrag	1 Aktie
NIW (ausschüttend)	438.91
Letzte Ausschüttung (22.03.2021)	EUR 4.69
Fondsvermögen	Mio. EUR 262.84
Anzahl der Positionen	71

Fonds Benchmark

## BRUTTOWERTENTWICKLUNG (IN %)

	Fonds	Benchmark
1 Monat	-0.48	-0.76
Laufendes Jahr	-1.78	-1.67
1 Jahr	-1.78	-1.67
3 Jahre (p.a.)	1.03	1.24
5 Jahre (p.a.)	0.70	0.88
10 Jahre (p.a.)	-	-

Fonds Benchmark

## PORTFOLIOEIGENSCHAFTEN

	Fonds	Benchmark
Durchschn. Fälligkeit (Jahren)	4.82	4.85
Duration (Jahren)	4.03	4.63
Modified Duration (%)	4.02	4.64
Yield to Worst (%)	0.19	-0.17
YTW (ModDur Weighted) (%)	0.55	-0.02
Anzahl der Emittenten	28	12

## ANLAGEUNIVERSUM

Der Fonds ist darauf ausgerichtet, möglichst hohe Erträge zu erzielen, indem er vorwiegend in Anleihen (ohne jede Beschränkung auf Branchenebene) investiert, die auf eine oder mehrere europäische Währungen lauten und von hochwertigen Schuldnern der Kategorie Investment-Grade begeben oder garantiert sind. Es handelt sich um einen aktiv verwalteten Fonds. Das bedeutet, dass der Portfolioverwalter nicht das Ziel verfolgt, die Performance einer Benchmark nachzubilden.

## BENCHMARK

JPM EMU Government Investment Grade 1-10 years (seit 25.02.2014)  
Vorheriger Benchmark: JPM EMU Government Investment Grade Total Return

## AUFTEILUNG (IN%)

Länder	Fonds	Bench	Rating	Fonds	Bench
Italien	25.5	23.2	AAA	12.7	22.0
Spanien	18.7	15.1	AA+	7.7	5.3
Belgien	7.1	4.9	AA	6.5	24.9
Frankreich	6.5	24.9	AA-	5.9	4.9
Portugal	6.1	2.7	A+	3.7	2.1
Rumänien	5.0	0.0	A	1.6	0.0
Österreich	4.6	3.6	A-	18.6	15.1
Niederlande	4.6	4.2	BBB+	0.1	0.0
Supranational	3.7	0.0	BBB	34.5	25.8
Irland	3.7	2.1	BBB-	5.0	0.0
Andere	10.7	19.4	Barguthaben	3.8	0.0
Barguthaben	3.8	0.0			

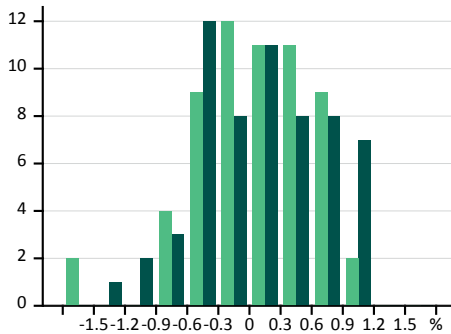
Modified durations	Fonds	Bench	Währungen	Fonds	Bench
< 3%	33.4	31.3	Euro	100.0	100.0
3 - 5%	27.1	24.7			
5 - 7%	15.9	23.4			
7 - 10%	16.0	20.6			
10 - 15%	2.8	0.0			
> 15%	1.0	0.0			
Barguthaben	3.8	0.0			

# DPAM CAPITAL B BONDS EUR MEDIUM TERM - A

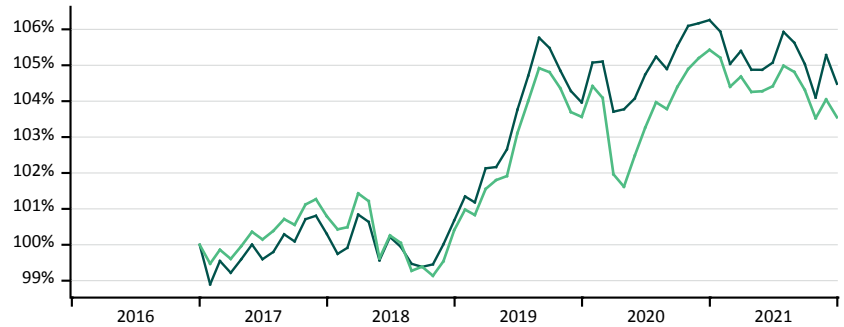
Instit. Monatsbericht | 31. Dezember 2021  
 Fondswahrung EUR | Beobachtungszeitraum - 5 Jahre

Fonds Benchmark

## VERTEILUNG DER MONATLICHEN ERGEBNISSE



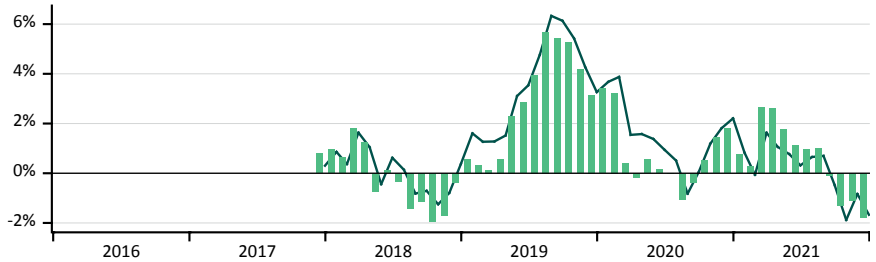
## KUMULIERTE WERTENTWICKLUNG



## STATISTISCHE ANGABEN

		Fonds	Benchmark
Volatilitat	%	2.09	2.09
Sharpe Ratio		0.56	0.65
Downside Deviation	%	1.41	1.27
Sortino Ratio		0.83	1.06
Anzahl positiver Monate	%	55.00	56.67
Maximaler Verlust	%	-3.15	-2.03
Risikoloser Zins <b>-0.48%</b>			

## ROLLIERENDE 12-MONATSERGEBNISSE

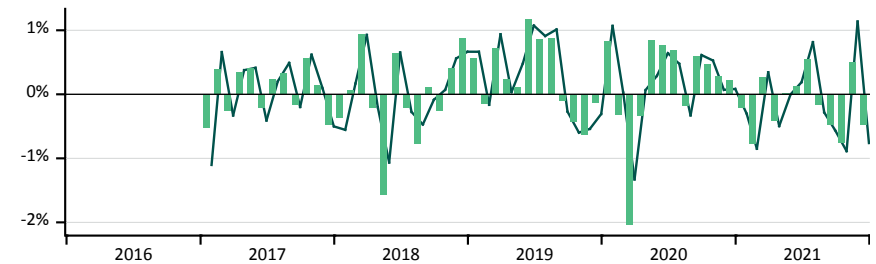


## FONDS VERSUS BENCHMARK

Korrelation		0.921
R <sup>2</sup>		0.848
Alpha	%	-0.01
Beta		0.921
Treynor Ratio	%	1.27
Tracking Error	%	0.83
Information Ratio		-0.220

Benchmark: JPM EMU Government Investment Grade 1-10 years (seit 25.02.2014)  
 Fruher: JPM EMU Government Investment Grade Total Return

## MONATSERGEBNISSE



## MONATSERGEBNISSE (IN %)

	2017		2018		2019		2020		2021	
	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark	Fonds	Benchmark
Januar	-0.53	-1.10	-0.36	-0.55	0.57	0.66	0.83	1.07	-0.21	-0.30
Februar	0.39	0.66	0.06	0.17	-0.15	-0.16	-0.31	0.03	-0.77	-0.85
Marz	-0.25	-0.33	0.94	0.93	0.72	0.94	-2.05	-1.33	0.27	0.34
April	0.35	0.38	-0.21	-0.20	0.24	0.03	-0.34	0.07	-0.41	-0.50
Mai	0.40	0.41	-1.57	-1.06	0.11	0.48	0.85	0.29	0.02	-0.00
Juni	-0.21	-0.41	0.64	0.65	1.17	1.07	0.76	0.64	0.13	0.19
Juli	0.24	0.20	-0.21	-0.27	0.87	0.91	0.68	0.48	0.55	0.81
August	0.33	0.49	-0.78	-0.47	0.88	1.01	-0.18	-0.33	-0.17	-0.28
September	-0.16	-0.20	0.11	-0.09	-0.11	-0.27	0.59	0.61	-0.48	-0.56
Oktober	0.56	0.62	-0.25	0.07	-0.43	-0.60	0.48	0.53	-0.76	-0.89
November	0.15	0.10	0.41	0.56	-0.63	-0.54	0.29	0.07	0.51	1.14
Dezember	-0.47	-0.50	0.87	0.67	-0.13	-0.31	0.22	0.08	-0.48	-0.76
<b>Jahr</b>	<b>0.79</b>	<b>0.30</b>	<b>-0.38</b>	<b>0.37</b>	<b>3.14</b>	<b>3.26</b>	<b>1.80</b>	<b>2.21</b>	<b>-1.78</b>	<b>-1.67</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.