

DPAM L Bonds Government Sustainable - B

Monatliches Factsheet | 30. September 2020

Weitere Informationen zu den in diesem Text verwendeten statistischen Kennzahlen finden Sie auf der letzten Seite.

ÜBERBLICK

Asset-Klasse	Anleihen
Kategorie	Government Investment Grade
Strategie	Aktive Strategie
Teilfonds des	DPAM L
Rechtsform	SICAV
Domizil	Luxemburg
Fondswährung	EUR
Handelbarkeit	Täglich
Auflagedatum	24.01.2020
Erstausgabebetrag	21.02.2020
Vertriebszulassung in	AT, BE, DE, ES, FR, IT, LU

ISIN	LU2098852986
Ausgabeaufschlag	Maximum 2%
Rücknahmegebühr	0%
Laufende Kosten*	0.66%
*Einschließlich Verwaltungsvergütung	0.40%
NIW (thesaurierend)	99.21
Fondsvermögen	Mio. EUR 86.25
Anzahl der Positionen	38

RISIKOKLASSE



SRRI Berechnung nach der UCITS (EU) Verordnung Nr. 583/2010

PORTFOLIOEIGENSCHAFTEN

Durchschn. Fälligkeit (Jahren)	9.21
Duration (Jahren)	8.80
Modified Duration (%)	8.81
Anzahl der Emittenten	25

ANLAGESTRATEGIE

Eine aktiv verwaltete Anlage in Schuldtiteln ermöglichen, die von einem Mitgliedstaat der OECD (oder deren Gebietskörperschaften) oder von bestimmten internationalen öffentlichen Organisationen begeben (oder garantiert) sind und nach Kriterien der Nachhaltigkeit ausgewählt werden. Der Teilfonds legt sein Vermögen hauptsächlich in fest oder variabel verzinslichen Anleihen und/oder anderen Schuldtiteln an, die von einem Mitgliedstaat der OECD (oder seinen Gebietskörperschaften) oder von bestimmten internationalen öffentlichen Organisationen begeben (oder garantiert) und nach Kriterien der Nachhaltigkeit ausgewählt werden. Es handelt sich um einen aktiv verwalteten Teilfonds. Bei der Verwaltung des Teilfonds wird keine Benchmark verwendet.

AUFTEILUNG (IN%)

Länder		Rating	
Deutschland	12.4	AAA	48.1
Neuseeland	11.2	AA+	19.4
Australien	9.7	AA	7.2
Kanada	9.3	AA-	20.1
Slowenien	8.1	A+	4.2
Schweden	6.7	Barguthaben	1.0
Irland	6.4		
Grossbritannien	6.2		
Dänemark	5.0		
Österreich	4.7		
Andere	19.2		
Barguthaben	1.0		

Währungen nach Absicherung

Währungen nach Absicherung		Modified durations	
Euro	45.2	< 3%	0.2
Neuseeland-Dollar	8.8	3 - 5%	0.9
Australischer Dollar	7.6	5 - 7%	50.0
Japanischer Yen	7.5	7 - 10%	29.2
Schwedische Krone	6.7	10 - 15%	13.4
Kanadischer Dollar	5.9	> 15%	5.3
Schweizer Franken	5.8	Barguthaben	1.0
Dänische krone	5.1		
Tschechische Krone	3.0		
Pfund sterling	2.6		
Norwegische Krone	1.8		

DPAM L Bonds Government Sustainable - B

Monatliches Factsheet | 30. September 2020
Fondswährung EUR

Weitere Informationen zu den in diesem Text verwendeten statistischen Kennzahlen finden Sie auf der letzten Seite.

STEUERLICHE INFORMATIONEN

D - Investmentsteuergesetz (InvStG)

Transparent

Volatilität: Die Volatilität eines Wertes bezeichnet die Intensität seiner Kursschwankungen. Eine hohe Volatilität bedeutet, dass die Kursentwicklung eines Anlagewertes innerhalb eines relativ kurzen Zeitraums von starken Schwankungen nach oben und unten gekennzeichnet ist. Die Volatilität ist ferner ein Indikator für das Risiko, das für einen Anleger im betreffenden Instrument besteht. Unsere Website und die Datenblätter geben die Volatilität auf der Basis der Standardabweichung an, genauer gesagt, auf der Basis der annualisierten Standardabweichung der Monatsrenditen der letzten fünf Jahre seit Auflegung des Teilfonds.

Sharpe Ratio (Sharpe-Verhältnis): Das Sharpe-Verhältnis bildet die Rendite im Verhältnis zur risikolosen Rendite pro Risikoeinheit ab. Der von uns für die Berechnung des Sharpe-Verhältnisses verwendete Risikoindikator ist die Volatilität. Je höher der Koeffizient, desto größer war bei einem gegebenen Risiko die Überschussrendite.

Downside Deviation (Baisse-Abweichung): Die Baisse-Abweichung entspricht der annualisierten Standardabweichung der Monatsrenditen unter einem gegebenen Niveau. In unseren Datenblättern beruht seine Berechnung auf dem risikolosen Renditesatz. Die Baisse-Abweichung berücksichtigt also nicht die Volatilität des Teilfonds in Aufwärtstrends, und zwar dies aufgrund der Überlegung, dass ein Anleger empfindlicher auf Wertschwankungen seiner Anlagen in Abwärtstrends der Märkte reagiert.

Sortino Ratio (Sortino-Verhältnis): Das Sortino-Verhältnis ähnelt weitgehend dem Sharpe-Verhältnis, legt für die Risikoeinheiten jedoch nicht die Volatilität zugrunde, sondern die Abweichung nach unten (downside deviation).

Maximaler Verlust: Der maximal mögliche Verlust (maximum drawdown) ist ein Risikoindikator. Sie ist relativ zu einem Anlagezeitraum die schlechteste mögliche Rendite einer Anlage. Anders gesagt ist der maximal mögliche Verlust derjenige, den ein Anleger zu verzeichnen hätte, wenn er Fondsanteile in einem gegebenen Zeitraum zum höchsten Kurs ge- und zum niedrigsten Kurs wieder verkauft hätte. Dieser Indikator beruht auf vergangenen Kursentwicklungen, die keinesfalls auf zukünftige schließen lassen.

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.degroopfetercam.com> bereit und können auch in Papierform kostenlos bei der deutschen Informationsstelle Marcard, Stein & Co.- AG, Ballindamm 36, 20095 Hamburg angefordert werden.

Die ausgegebenen Anteile dieses Fonds dürfen nur in solchen Rechtsordnungen zum Kauf angeboten oder verkauft werden, in denen ein solches Angebot oder ein solcher Verkauf zulässig ist. So dürfen die Anteile dieses Fonds weder innerhalb der USA noch an oder für Rechnung von US-Staatsbürgern oder in den USA ansässigen US-Personen zum Kauf angeboten oder an diese verkauft werden.