

DPAM Equities L Europe Behavioral Value - F

Fiche mensuelle | 31 octobre 2021

PORTRAIT

Classe d'actifs	Actions
Catégorie	Europe
Stratégie	Stratégie Active
Compartiment de	DPAM Equities L
Structure juridique	SICAV
Domicile	Luxembourg
Monnaie de référence	EUR
Liquidité	Quotidienne
Création du compartiment	31.12.2001
Date de la 1ère VNI	26.10.2005
Enregistrement commercialisation	AT, CH, DE, ES, FR, IT, LU, NL
ISIN	LU0231631879
Frais d'entrée	Maximum 1%
Frais de sortie	0%
Frais courants*	1.02%
<i>*dont frais de gestion</i>	0.80%
Inv. minimum	EUR 25'000
VNI (Capitalisation)	57.04
Taille (toutes classes)	mn EUR 49.46
Nombre de positions	117

PROFIL DE RISQUE ET DE RENDEMENT

Risque plus faible	Risque plus élevé					
Rendement potentiellement plus faible	Rendement potentiellement plus élevé					
1	2	3	4	5	6	7

SRRI établi conformément au Règlement UCITS (UE) N°583/2010

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT DU COMPARTIMENT

Augmenter la valeur de votre investissement sur le long terme. Le compartiment investit dans des actions de sociétés ayant leur siège social ou ayant une part significative de leurs activités, actifs, centres de profit ou centres de décision dans un pays d'Europe (en ce compris le Royaume-Uni et en Suisse). Afin de tirer parti ou de se couvrir contre des fluctuations de marché, ou encore pour une gestion de portefeuille efficace, le compartiment peut recourir à des instruments dérivés. Le gestionnaire gère dynamiquement son portefeuille. Ses choix d'allocation d'actifs et de durée d'investissement reposent sur des analyses politique, économique, monétaire et financière. Indice de référence: MSCI Europe Net Return. Le compartiment est géré activement, ce qui signifie que le gestionnaire du portefeuille n'a pas pour objectif de reproduire la performance de l'indice. Celui-ci est utilisé à des fins de comparaison de performance. La sélection et la pondération des actifs dans le portefeuille du compartiment peuvent différer significativement de la composition de l'indice. La politique d'investissement mentionnée ci-dessus est issue du KIID. Ni le rendement, ni le capital ne sont garantis ou protégés.

REPARTITIONS (%)

Secteurs	Fonds	Bench	Pays	Fonds	Bench
Financières	17.7	16.3	France	29.2	17.5
Industrie	14.3	14.7	Allemagne	18.5	13.8
Santé	14.2	14.5	Royaume-Uni	15.9	22.4
Consommation cyclique	11.8	11.7	Pays-Bas	8.3	7.8
Consommation non-cyclique	11.4	12.6	Suisse	5.1	15.2
Technologies de l'information	8.3	8.8	Italie	4.7	3.9
Matériaux	7.3	7.7	Suède	3.9	5.8
Energie	5.1	4.8	Belgique	3.7	1.4
Services publics	5.0	4.2	Autriche	3.3	0.3
Communications	3.9	3.5	Espagne	1.9	3.7
Immobilier	0.9	1.1	Irlande	1.9	1.1
Liquidités	0.1	0.0	Norvège	1.6	1.0
			Autre	1.7	6.1
			Liquidités	0.1	0.0

Top 10

	Fonds	Bench
Total Energies	3.5	
Novartis	2.6	
GlaxoSmithKline	2.0	
SAP AG	1.8	
Sanofi	1.8	
Omv Ag	1.6	
Prosus Nv	1.5	
Anheuser Busch Inbev	1.5	
UCB	1.5	
Merck KGaA	1.4	

Monnaies

	Fonds	Bench
Euro	72.5	52.5
Livre sterling	16.0	21.5
Franc suisse	5.1	15.2
Couronne suédoise	3.9	5.5
Couronne norvégienne	1.6	1.0
Couronne danoise	0.7	4.2
Dollar US	0.0	0.1
Dollar de Hong Kong	0.0	0.0

DPAM Equities L Europe Behavioral Value - F

Fiche mensuelle | 31 octobre 2021
Monnaie de référence EUR

RENDEMENT (%) (*)

	Fonds	Benchmark
1 mois	3.71	4.66
YTD	20.75	21.62
1 an	43.79	41.86
3 ans rend. actuariel	6.58	11.55
5 ans rend. actuariel	5.97	9.35
10 ans rend. actuariel	8.29	9.42
Depuis la création rend. actuariel	3.85	5.51

STATISTIQUES (5 ANS) (*)

	Fonds	Benchmark
Volatilité %	17.24	14.17
Ratio de Sharpe	0.37	0.69
Ecart à la baisse %	12.19	9.32
Ratio de Sortino	0.53	1.05
Mois positifs %	61.67	63.33
Baisse maximale %	-30.38	-22.59
Taux hors risque	-0.47%	

FONDS VS BENCHMARK (5 ANS) (*)

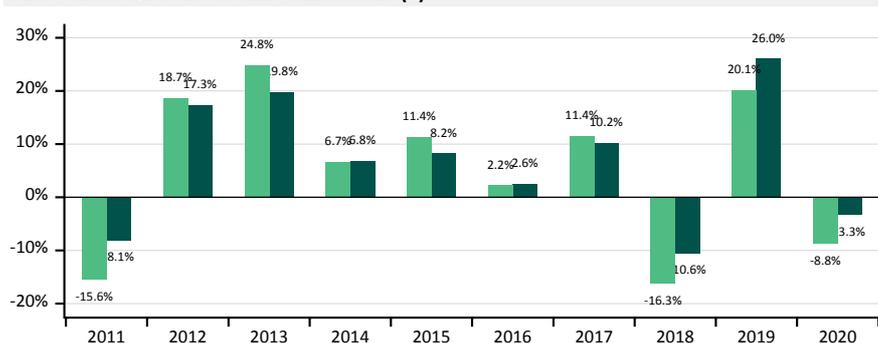
Corrélation	0.982
R ²	0.964
Alpha %	-0.38
Beta	1.194
Ratio de Treynor %	5.37
Tracking Error %	4.27
Ratio d'information	-0.634

Benchmark: MSCI Europe Net Return

VNI SUR LES 10 DERNIÈRES ANNÉES (*)



PERFORMANCE PAR ANNÉE CALENDRIER (*)



DISCLAIMER

(*) Les chiffres de performances reflètent le rendement global d'un compartiment, composé des dividendes, des coupons et des éventuelles plus-values ou moins-values. Les chiffres tiennent compte des frais de gestion et les autres frais récurrents, mais non des frais d'entrée et de sortie ni des taxes boursières. Pour des périodes plus longues qu'une année, le rendement est calculé selon la méthode actuarielle. Sauf indication contraire, le rendement est exprimé dans la même devise que celle de la valeur d'inventaire. Il s'agit toujours de chiffres historiques basés sur les résultats du passé. Ils ne constituent en aucun cas une garantie pour les rendements à venir. Les souscriptions dans les fonds de placements ici mentionnés ne sont valables que si elles sont effectuées sur base des Informations clés pour l'investisseur (KIID), du prospectus et des derniers rapports semestriels et annuels. Ces documents sont disponibles sur la page web du compartiment via funds.degroofpetercam.com.