

DPAM Capital B Equities Europe Index - B

Fiche mensuelle | 30 juin 2021

Morningstar ★★ ★

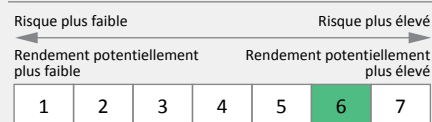
PORTRAIT

Classe d'actifs	Actions
Catégorie	Europe
Stratégie	Stratégie Passive
Compartiment de	DPAM Capital B
Structure juridique	SICAV
Domicile	Belgique
Monnaie de référence	EUR
Liquidité	Quotidienne
Création du compartiment	31.08.1992
Date de la 1ère VNI	16.12.1992
Enregistrement commercialisation	

BE, FR, LU

ISIN	BE6278393689
Frais d'entrée	Maximum 2.25%
Frais de sortie	0.10% (1)
Frais courants*	0.68%
<i>*dont frais de gestion</i>	0.50%
Inv. minimum	1 action
VNI (Capitalisation)	128.25
Taille (toutes classes)	mn EUR 293.06
Nombre de positions	430

PROFIL DE RISQUE ET DE RENDEMENT



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

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT DU COMPARTIMENT

L'objectif du fonds est de procurer un rendement aussi élevé que possible, en investissant principalement en actions européennes. L'indice est suivi selon une stratégie de gestion passive qui investira de manière physique et non-synthétique dans la totalité des titres de l'indice, ou d'un échantillon représentatif des titres de celui-ci, en détenant chaque titre dans une proportion approximativement identique à son poids dans l'indice. Chaque secteur est représenté dans une proportion approximativement identique à son poids dans l'indice. Le tracking error ou erreur de suivi (écart-type par rapport à l'indice de référence) est de l'ordre de 1,3%. Il s'agit d'un fonds géré passivement ce qui signifie que le gestionnaire de portefeuille a pour objectif de reproduire la performance d'un benchmark. Le fonds investit principalement en actions (et autres valeurs mobilières assimilables à des actions) de sociétés européennes, sicafi, warrants, obligations convertibles, droits de souscription, strips VVPR et accessoirement liquidités. 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	15.6	15.7	Royaume-Uni	21.6	22.3
Industrie	14.7	14.8	France	17.7	17.8
Santé	14.0	14.1	Suisse	15.2	15.2
Consommation non-cyclique	12.3	12.9	Allemagne	14.6	14.6
Consommation cyclique	12.1	12.2	Pays-Bas	6.9	6.8
Matériaux	8.3	8.2	Suède	5.7	5.8
Technologies de l'information	8.2	8.3	Danemark	4.0	4.0
Energie	4.4	4.4	Espagne	3.9	3.8
Services publics	4.2	4.2	Italie	3.8	3.8
Communications	3.9	3.9	Finlande	1.6	1.6
Immobilier	1.4	1.3	Belgique	1.5	1.5
Liquidités	0.8	0.0	Irlande	1.1	1.1
			Autre	1.6	1.6
			Liquidités	0.8	0.0

Top 10	Fonds	Bench	Monnaies	Fonds	Bench
Nestlé	3.3	3.3	Euro	53.3	52.6
ASML Holding	2.6	2.6	Livre sterling	20.9	21.6
Roche Holding	2.4	2.4	Franc suisse	15.2	15.2
LVMH	2.0	2.0	Couronne suédoise	5.4	5.5
Novartis	1.9	1.9	Couronne danoise	4.0	4.0
Unilever Plc	1.4	1.4	Couronne norvégienne	1.0	1.0
Astrazeneca	1.4	1.4	Dollar US	0.1	0.1
SAP AG	1.3	1.3	Dollar australien	0.0	0.0
Novo Nordisk B	1.3	1.3			
Siemens	1.1	1.1			

(1) Les frais de sortie sont au profit du compartiment.

DPAM Capital B Equities Europe Index - B

Fiche mensuelle | 30 juin 2021

Monnaie de référence EUR

RENDEMENT (%) (*)

	Fonds	Benchmark
1 mois	1.13	1.70
YTD	15.36	15.35
1 an	27.85	27.94
3 ans rend. actuariel	7.79	8.10
5 ans rend. actuariel	8.57	8.91
10 ans rend. actuariel	7.28	7.72
Depuis la création rend. actuariel	7.44	8.13

STATISTIQUES (5 ANS) (*)

	Fonds	Benchmark
Volatilité	% 14.10	14.02
Ratio de Sharpe	0.64	0.67
Ecart à la baisse	% 9.32	9.23
Ratio de Sortino	0.96	1.01
Mois positifs	% 61.67	61.67
Baisse maximale	% -22.73	-22.59
Taux hors risque	-0.45%	

FONDS VS BENCHMARK (5 ANS) (*)

Corrélation	0.999
R ²	0.998
Alpha	% -0.03
Beta	1.005
Ratio de Treynor	% 8.95
Tracking Error	% 0.58
Ratio d'information	-0.520

Benchmark: MSCI Europe Net Return

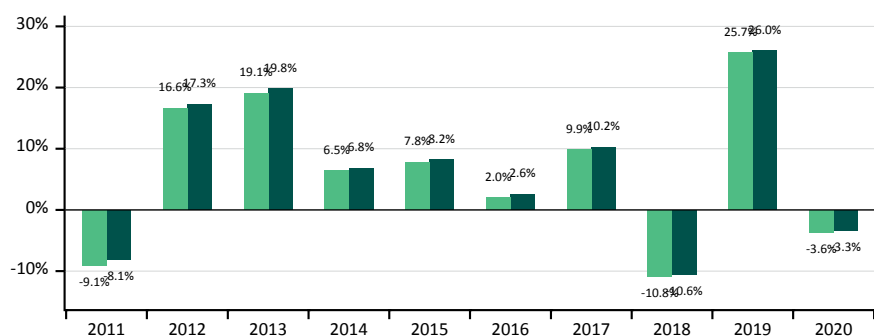
VNI SUR LES 10 DERNIÈRES ANNÉES (*)



— Split (30.07.2015)

15 janvier 1997 : division de la valeur nette d'inventaire par 10; 30 mars 2005 : division de la valeur nette d'inventaire par 5; 30 juillet 2015 : division de la valeur nette d'inventaire par 3

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.