

DPAM L Bonds EUR Quality Sustainable - P

Fiche mensuelle | 30 septembre 2021

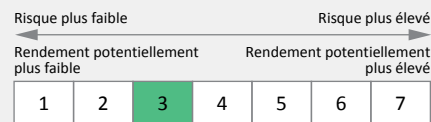
PORTRAIT

Classe d'actifs	Obligations
Catégorie	Corporate Investment Grade
Stratégie	Stratégie Active
Compartiment de	DPAM L
Structure juridique	SICAV
Domicile	Luxembourg
Monnaie de référence	EUR
Liquidité	Quotidienne
Création du compartiment	23.12.1987
Date de la 1ère VNI	02.01.2008
Enregistrement commercialisation	

FR, LU, NL

ISIN	LU0336683171
Frais d'entrée	0%
Frais de sortie	0%
Frais courants*	0.15%
<i>*dont frais de gestion</i>	0%
Inv. minimum	0.001 action
VNI (Capitalisation)	659.98
Taille (toutes classes)	mn EUR 1'499.45
Nombre de positions	468

PROFIL DE RISQUE ET DE RENDEMENT



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

Fonds Benchmark

CARACTÉRISTIQUES DU PORTEFEUILLE

Maturité (ans)	6.30	5.52
Duration (ans)	4.89	5.27
Modified duration (%)	4.86	5.25
Nombre d'émetteurs	200	646

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT DU COMPARTIMENT

Accroître la valeur de votre investissement sur le moyen terme. Le compartiment investit principalement dans des obligations d'entreprise à forte notation ("investment grade") libellées en euro. Dans une gestion active du compartiment, le gestionnaire sélectionne des titres présentant un potentiel de rendement avantageux par rapport au risque encouru sur base de critères à la fois financiers et liés au développement durable (tels que, par exemple, le respect de l'environnement ou une gouvernance socialement équitable). Indice de référence: iBoxx Euro Corporate All Maturities Total 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. 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. 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
Banques	26.0	27.7	Etats-Unis	20.4	19.1
Industrie	11.9	9.3	France	18.9	21.2
Biens de consommation	11.0	13.9	Allemagne	11.6	15.2
Services publics	9.7	9.8	Italie	8.9	4.7
Immobilier	9.6	5.7	Pays-Bas	6.6	5.4
Télécoms	6.0	6.3	Espagne	5.5	5.7
Santé	5.7	6.2	Royaume-Uni	5.5	8.1
Assurances	4.8	4.4	Belgique	4.0	1.9
Technologie	4.2	2.8	Suède	2.2	2.4
Services de consommation	3.9	3.5	Suisse	1.8	3.4
Services financiers	2.6	2.6	Danemark	1.1	1.2
Chimie	2.0	1.9	Autre	12.9	11.8
Autre	2.2	5.9	Liquidités	0.5	0.0
Liquidités	0.5	0.0			

Notations (Échelle S&P)

Notations (Échelle S&P)	Fonds	Bench
AAA	0.0	0.3
AA+	0.0	0.6
AA	0.0	1.2
AA-	1.8	6.5
A+	4.0	7.2
A	10.9	14.2
A-	20.0	17.8
BBB+	19.3	22.8
BBB	21.5	18.7
BBB-	22.0	10.8
Dérivés	0.0	0.0
Liquidités	0.5	0.0

Modified durations

Modified durations	Fonds	Bench
< 3%	12.8	27.1
3 - 5%	26.6	27.9
5 - 7%	28.5	21.3
7 - 10%	24.8	16.4
10 - 15%	6.2	5.3
> 15%	0.7	1.9
Liquidités	0.5	0.0

Structure de capital

Structure de capital	Fonds	Bench
Obl. non-financières senior	59.6	64.8
Banques Senior	20.7	24.2
Obl. non-financières subordonnées	8.5	3.1
Banques Lower Tier Two	5.5	3.4
Assurances subordonnées	4.1	3.0
Assurances Senior	0.8	1.4
Obligations d'Etat	0.3	0.0
Dérivés	0.0	0.0
Liquidités	0.5	0.0

Monnaies

Monnaies	Fonds	Bench
Euro	100.0	100.0

DPAM L Bonds EUR Quality Sustainable - P

Fiche mensuelle | 30 septembre 2021
Monnaie de référence EUR

RENDEMENT (%) (*)

	Fonds	Benchmark
1 mois	-0.57	-0.68
YTD	-0.44	-0.40
1 an	1.58	1.57
3 ans rend. actuariel	2.91	2.62
5 ans rend. actuariel	1.73	1.65
10 ans rend. actuariel	4.19	3.83
Depuis la création rend. actuariel	1.01	-

STATISTIQUES (5 ANS) (*)

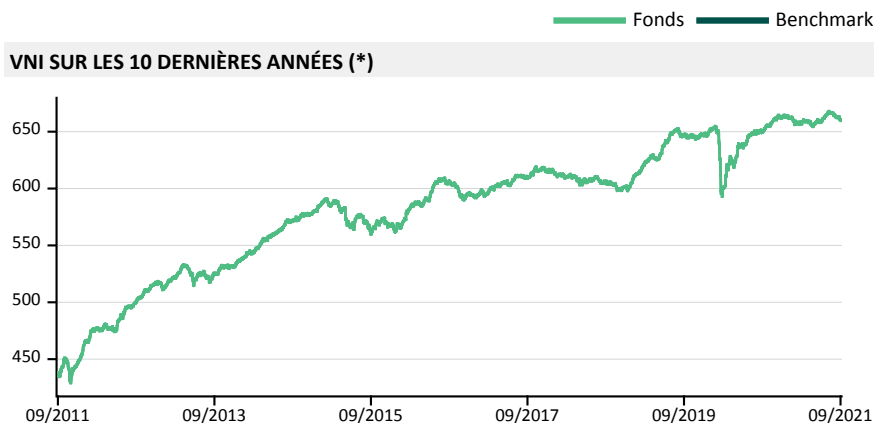
	Fonds	Benchmark
Volatilité %	4.63	4.25
Ratio de Sharpe	0.47	0.50
Ecart à la baisse %	3.49	3.24
Ratio de Sortino	0.63	0.65
Mois positifs %	56.67	53.33
Baisse maximale %	-7.83	-7.41
Taux hors risque	-0.46%	

FONDS VS BENCHMARK (5 ANS) (*)

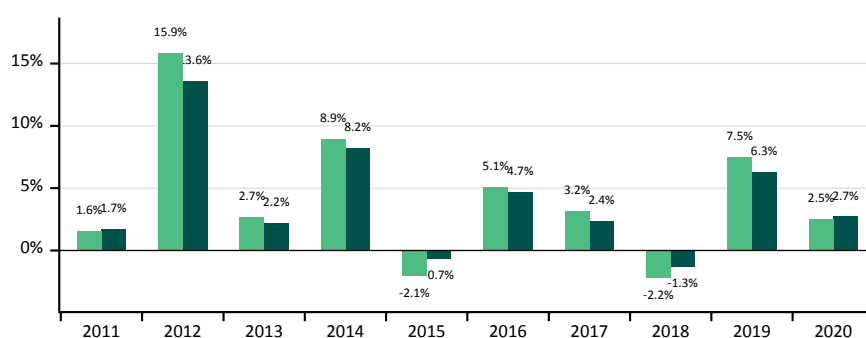
Corrélation	0.990
R ²	0.981
Alpha %	-0.00
Beta	1.079
Ratio de Treynor %	2.03
Tracking Error %	0.73
Ratio d'information	0.127

Benchmark: iBoxx Euro Corporate Overall Total Return (depuis 01.01.1999)

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.