DPAM L Bonds EUR Quality Sustainable - V

Fiche mensuelle | 31 octobre 2018

Morningstar ★★★ (*)

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	23.09.2013
Enregistrement commercialisation	AT, CH, DE, ES, FR, IT, LU, NL
ISIN	LU0966591991
Frais d'entrée	Maximum 2%
Frais de sortie	0%
Commission de gestion	0.30%
Frais courants	0.47%
Inv. minimum	0.001 action
VNI (Distribution)	148.76
Dernier dividende brut (25.04.2017)	EUR 1.57
Taille (toutes classes)	mn EUR 799.05
Nombre de positions	330

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

CARACTÉRISTIQUES DU PORTEFEUILLE

Maturité (ans)	6.33
Duration (ans)	4.79
Modified duration (%)	4.73
Nombre d'émetteurs	110

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT DU COMPARTIMENT

Le compartiment investit principalement dans des obligations et/ou d'autres titres de créance (en ce compris, sans que cette liste ne soit exhaustive, des obligations perpétuelles et des obligations à coupon zéro), à taux fixe ou flottant, libellés en euro, émis par des entreprises et bénéficiant (ou, à défaut, leurs émetteurs) d'une notation correspondant au moins à BBB-/Baa3 (« investment grade ») selon l'échelle des agences de notation S&P/Moody's et sélectionnés sur base de critères liés au développement durable (tels que, par exemple, l'équité sociale, le respect de l'environnement et une gouvernance politique et économique socialement équitable).

REPARTITIONS (%)

Secteurs

Banques	31.6
Services publics	10.4
Biens de consommation	9.5
Industrie	7.9
Télécoms	7.7
Immobilier	7.5
Santé	6.1
Assurances	4.1
Services financiers	3.4
Technologie	3.4
Chimie	3.0
Services de consommation	2.4
Pétrole & Gaz	2.0
Matériaux de base	0.8
Obligations d'Etat	0.2
Autre	-0.1

Pays

Etats-Unis	22.8
France	22.6
Pays-Bas	10.1
Allemagne	7.3
Espagne	6.9
Royaume-Uni	5.6
Italie	5.0
Belgique	4.5
Suisse	4.0
Suède	2.6
Danemark	1.4
Autre	6.9
Liquidités	0.2

Notations (Échelle S&P)

AAA	0.5
AA+	0.0
AA	0.6
AA-	5.0
A+	10.0
A	13.1
A-	13.9
BBB+	25.7
BBB	20.4
BBB-	10.3
High-Yield	0.4
Autre	-0.1
Liquidités	0.2

Structure de capital

Obl. non-financières senior	57.5
Banques Senior	23.8
Banques Lower Tier Two	7.4
Obl. non-financières subordonnées	6.5
Assurances subordonnées	2.9
Assurances Senior	1.2
Banques subordonnées	0.4
Obligations d'Etat	0.2
Autre	-0.1
Liquidités	0.2

Modified durations

< 3%	9.2
3 - 5%	28.3
5 - 7%	28.1
7 - 10%	28.5
10 - 15%	4.9
> 15%	1.0
Liquidités	0.1

Monnaies

Euro	100.0

(*) Morningstar Rating Overall

DPAM L Bonds EUR Quality Sustainable - V

Fiche mensuelle | 31 octobre 2018
Monnaie de référence EUR

RENDEMENT (%) (*)

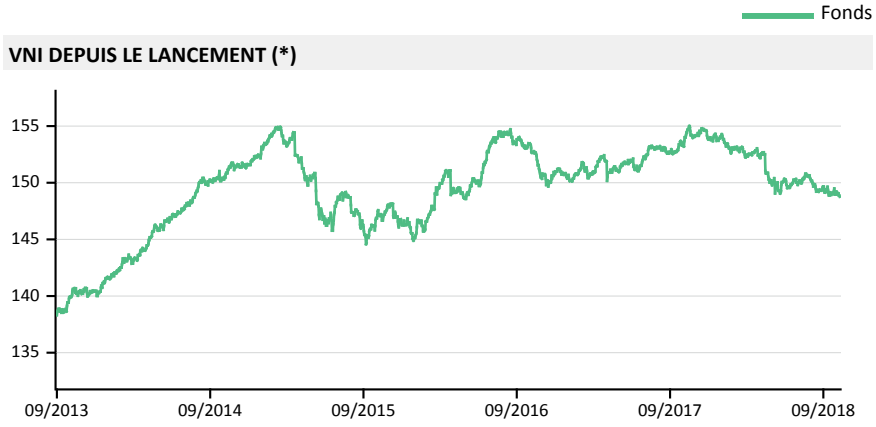
	Fonds
1 mois	-0.44
YTD	-2.30
1 an	-2.68
3 ans rend. actuariel	1.49
5 ans rend. actuariel	2.09
10 ans rend. actuariel	-
Depuis la création rend. actuariel	2.38

STATISTIQUES (5 ANS) (*)

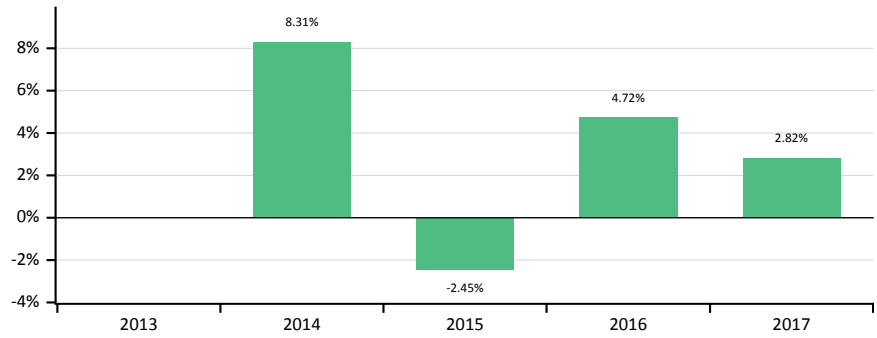
Volatilité	%	3.10
Ratio de Sharpe		0.73
Ecart à la baisse	%	1.95
Ratio de Sortino		1.17
Mois positifs	%	60.00
Baisse maximale	%	-5.33

Taux hors risque **-0.20%**

VNI DEPUIS LE LANCEMENT (*)



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.