

# DPAM Invest B Equities NEWGEMS Sustainable - B

Monatliches Factsheet | 30. April 2020

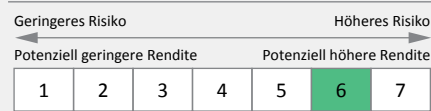
Morningstar ★★★★★ (\*)

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

## ÜBERBLICK

|  |                                |
|--|--------------------------------|
| Asset-Klasse                               | Aktien                         |
| Kategorie                                  | Welt                           |
| Strategie                                  | Aktive Strategie               |
| Teilfonds des                              | DPAM Invest B                  |
| Rechtsform                                 | SICAV                          |
| Domizil                                    | Belgien                        |
| Fondswährung                               | EUR                            |
| Handelbarkeit                              | Täglich                        |
| Auflagedatum                               | 22.09.2006                     |
| Erstausgabetag                             | 02.10.2006                     |
| Vertriebszulassung in                      | AT, BE, CH, DE, ES, FR, IT, LU |
| ISIN                                       | BE0946564383                   |
| WKN  | AOLFBM                         |
| Ausgabeaufschlag                           | Maximum 2%                     |
| Rücknahmegebühr                            | 0%                             |
| Laufende Kosten*                           | 1.80%                          |
| *Einschließlich Verwaltungsvergütung 1.50% |                                |
| NIW (thesaurierend)                        | 177.16                         |
| Fondsvermögen                              | Mio. EUR 563.05                |
| Anzahl der Positionen                      | 78                             |

## RISIKOKLASSE



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

## ANLAGESTRATEGIE

Ziel des Fonds ist es, Ihnen eine Anlage in Beteiligungspapieren von Unternehmen der ganzen Welt zu ermöglichen, die auf der Grundlage von bestimmter wirtschaftlicher Trends und Themen ausgewählt werden. Es handelt sich um einen aktiv verwalteten Fonds. Das bedeutet, dass der Portfolioverwalter nicht das Ziel verfolgt, die Performance einer Benchmark nachzubilden. Der Fonds legt sein Vermögen hauptsächlich in Aktien und/oder anderen Beteiligungspapieren von sogenannten „Zukunftsunternehmen“ der ganzen Welt an, die mit Akronym NEWGEMS bezeichnet werden und Tendenzen und Themen in den Bereichen Nanotechnologie, Umwelt, Wellness, Generation Z, E-Society, Industrie 4.0 und Sicherheit aufgreifen und nach Kriterien aus den Bereichen Umwelt, Soziales und Governance (ESG) ausgewählt werden. Benchmark: MSCI World Net Return. Verwendung der Benchmark: Die Benchmark wird für den Performancevergleich verwendet. Die Auswahl und die Gewichtung der Vermögenswerte im Portfolio des Fonds können erheblich von der Zusammensetzung der Benchmark abweichen.

## BENCHMARK

MSCI World Net Return (seit 31.07.2014)  
Vorheriger Benchmark: MSCI World Energy

## AUFTEILUNG (IN%)

| Branchen                      | Fonds |       | Regionen          | Fonds |       | Bench |
|-------------------------------|-------|-------|-------------------|-------|-------|-------|
|                               | Fonds | Bench |                   | Fonds | Bench |       |
| Informationstechnologie       | 35.7  | 19.6  | Nordamerika       | 66.3  | 68.8  |       |
| Gesundheitswesen              | 23.1  | 14.7  | Sonstige Regionen | 9.1   | 3.9   |       |
| Kommunikation                 | 11.8  | 8.9   | Europa ex-EMU     | 9.1   | 9.7   |       |
| Nicht-Basiskonsumgüter        | 9.2   | 10.8  | EMU               | 8.3   | 9.6   |       |
| Industrie                     | 7.8   | 10.0  | Japan             | 5.1   | 8.1   |       |
| Finanzwesen                   | 4.4   | 13.0  | Barguthaben       | 2.1   | 0.0   |       |
| Roh-, Hilfs- und Betr.-Stoffe | 4.0   | 4.2   |                   |       |       |       |
| Basiskonsumgüter              | 1.8   | 8.7   |                   |       |       |       |
| Immobilien                    | 0.0   | 3.1   |                   |       |       |       |
| Versorger                     | 0.0   | 3.5   |                   |       |       |       |
| Energie                       | 0.0   | 3.6   |                   |       |       |       |
| Barguthaben                   | 2.1   | 0.0   |                   |       |       |       |

## Top 10

| Unternehmen        | Anteil |
|--------------------|--------|
| Microsoft          | 3.5    |
| Amazon Com         | 3.4    |
| Alphabet A         | 2.5    |
| Apple              | 2.3    |
| Sony Corporation   | 1.9    |
| Nice Systems       | 1.9    |
| Kerry Group        | 1.8    |
| Cyber-Ark Software | 1.8    |
| Synopsys, Inc.     | 1.8    |
| Ihs Markit Ltd     | 1.8    |

## Währungen

| Währung              | Fonds | Bench |
|----------------------|-------|-------|
| US Dollar            | 71.5  | 65.9  |
| Euro                 | 10.4  | 9.7   |
| Japanischer Yen      | 5.1   | 8.1   |
| Pfund sterling       | 4.9   | 4.5   |
| Chinesische Yuan     | 2.2   | 0.0   |
| Schwedische Krone    | 2.2   | 0.8   |
| Koreanischer Won     | 1.3   | 0.0   |
| Norwegische Krone    | 1.1   | 0.2   |
| Dänische krone       | 0.9   | 0.7   |
| Malaysischer Ringgit | 0.4   | 0.0   |
| Andere               | 0.0   | 10.1  |

# DPAM Invest B Equities NEWGEMS Sustainable - B

Monatliches Factsheet | 30. April 2020

Fondswahrung EUR

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

## BRUTTOWERTENTWICKLUNG (IN %) (\*)

|                     | Fonds | Benchmark |
|---------------------|-------|-----------|
| 1 Monat             | 14.18 | 11.12     |
| Laufendes Jahr      | 1.34  | -10.25    |
| 1 Jahr              | 11.29 | -1.78     |
| 3 Jahre (p.a.)      | 12.27 | 4.79      |
| 5 Jahre (p.a.)      | 8.78  | 5.40      |
| 10 Jahre (p.a.)     | 7.83  | 9.00      |
| Seit Auflage (p.a.) | 4.30  | 7.14      |

## STATISTISCHE ANGABEN (5 JAHRE)

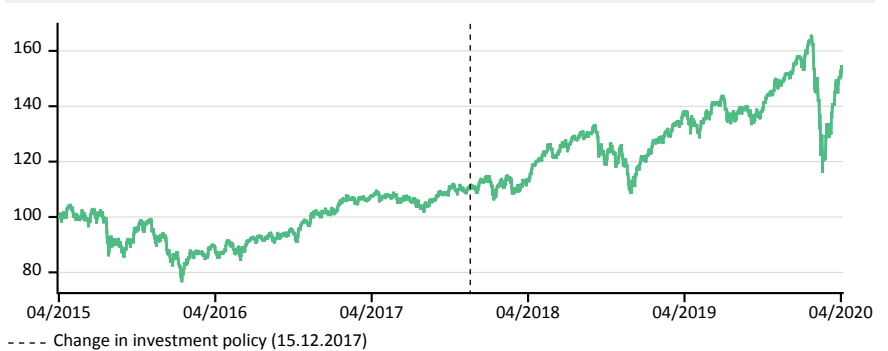
|                         | Fonds    | Benchmark |
|-------------------------|----------|-----------|
| Volatilitat            | % 14.89  | 14.43     |
| Sharpe Ratio            | 0.61     | 0.40      |
| Downside Deviation      | % 9.48   | 10.12     |
| Sortino Ratio           | 0.96     | 0.57      |
| Anzahl positiver Monate | % 65.00  | 60.00     |
| Maximaler Verlust       | % -16.96 | -19.78    |
| Risikoloser Zins        | -0.37%   |           |

## FONDS VERSUS BENCHMARK (5 JAHRE)

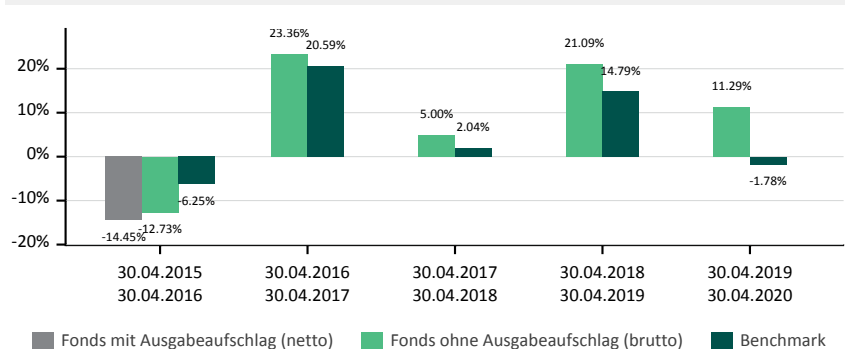
|                   |        |
|-------------------|--------|
| Korrelation       | 0.949  |
| R <sup>2</sup>    | 0.901  |
| Alpha             | % 0.28 |
| Beta              | 0.979  |
| Treynor Ratio     | % 9.30 |
| Tracking Error    | % 4.69 |
| Information Ratio | 0.674  |

Benchmark: MSCI World Net Return (seit 31.07.2014)  
Fruher: MSCI World Energy

## BRUTTOWERTENTWICKLUNG DER VERGANGENEN 5 JAHRE (\*)



## WERTENTWICKLUNG



Annahmen, Erlauterungen und Modellrechnung: Ein Anleger erwirbt fur EUR 1000,- Anteile. Bei einem maximalen Ausgabeaufschlag von 2.00% muss er dafur EUR 1020,- aufwenden. (\*) Die Bruttowertentwicklung (BVI-Methode) berucksichtigt alle auf Fondsebene anfallenden Kosten, die Nettowertentwicklung zusatzlich den Ausgabeaufschlag. Auf Anlegerebene konnen weitere Kosten anfallen (z.B. Depotgebuhren). Da der Ausgabeaufschlag nur im 1. Jahr anfallt, unterscheidet sich die Darstellung brutto/netto nur in diesem Jahr. Wertentwicklungen in der Vergangenheit sind kein verlasslicher Indikator fur die zukunftige Wertentwicklung.

## STEUERLICHE INFORMATIONEN

D - Investmentsteuergesetz (InvStG)

Transparent

## CHANCEN

- Partizipation an den Kurssteigerungen der globalen Aktienmärkte.
- Attraktive Chancen durch eine fokussierte Aktienauswahl in sieben Themen.
- Mögliche Zusatzerträge durch Einzelwertanalyse und aktives Management.
- Überprüfung einer nachhaltigen Unternehmensführung durch einen proprietären Nachhaltigkeitsansatz.
- Währungsschwankungen: Der Wert der Fondsanteile kann durch Änderungen der Wechselkursverhältnisse günstig beeinflusst werden.

## RISIKEN

- Allgemeines Marktrisiko: Der Anteilswert kann unter den Kaufpreis fallen, zu dem der Kunde den Anteil erworben hat.
- Erhöhte Kursschwankungen in bestimmten Marktphasen möglich: Die Anteilspreise können auch innerhalb kurzer Zeiträume erheblichen Schwankungen nach unten oder oben unterworfen sein.
- Währungsrisiko: Der Wert der Fondsanteile kann durch Wechselkursänderungen ungünstig beeinflusst werden.
- Keine Erfolgsgarantie für einen Zusatzertrag aus der Einzeltitelanalyse und dem aktiven Management
- Erhöhtes Risiko durch die Fokussierung auf sieben Themen.
- Die Nachhaltigkeitsanalyse führt zu einer Einschränkung des Anlageuniversums.

**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.