

# DPAM Invest B Equities World Sustainable - A

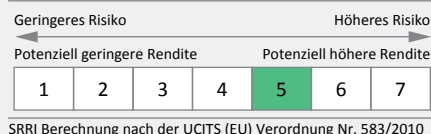
Monatliches Factsheet | 30. September 2021

Morningstar ★★★★★ (\*)

## ÜBERBLICK

Asset-Klasse	Aktien
Kategorie	Welt
Strategie	Aktive Strategie
Teilfonds des	DPAM Invest B
Rechtsform	SICAV
Domizil	Belgien
Fondswährung	EUR
Handelbarkeit	Täglich
Auflagedatum	29.10.2001
Erstausgabetag	25.02.1993
Vertriebszulassung in	AT, BE, CH, DE, ES, FR, IT, LU
ISIN	BE0058651630
WKN	A0JMB6
Ausgabeaufschlag	Maximum 2%
Rücknahmegebühr	0%
Laufende Kosten*	1.75%
<i>*Einschließlich Verwaltungsvergütung</i>	<i>1.50%</i>
NIW (ausschüttend)	240.18
Letzte Ausschüttung (22.03.2021)	EUR 1.14
Fondsvermögen	Mio. EUR 2'225.22
Anzahl der Positionen	51

## RISIKOKLASSE



## ANLAGESTRATEGIE

Ziel des Fonds ist es, Ihnen eine Anlage in Beteiligungspapieren von Unternehmen der ganzen Welt zu ermöglichen. Dieser Teilfonds verfolgt ein nachhaltiges Anlageziel im Sinne der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor, indem er in Unternehmen investiert, die mit ihren Produkten und Dienstleistungen zu den 17 von den Vereinten Nationen definierten nachhaltigen Zielen beitragen, und Unternehmen hinsichtlich ihres Beitrags zu Aspekten der nachhaltigen Entwicklung und zu Umwelt-, Sozial- und Governance-Themen (ESG) fördert. Das Anlageuniversum ist eng gefasst. Das Portfolio konzentriert sich auf Unternehmen mit einem positiven Nettobeitrag, d. h. (1) deren Haupttätigkeit in der Entwicklung von Produkten und Dienstleistungen besteht, die zum Erreichen der Ziele für nachhaltige Entwicklung beitragen, und (2) die bei nachhaltiger Entwicklung und beim Engagement im Hinblick auf ESG-Risiken am weitesten fortgeschritten sind. 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 (ohne jede Beschränkung auf Branchenebene) hauptsächlich in Aktien und/oder anderen Beteiligungspapieren von Unternehmen der ganzen Welt an. Die Auswahl basiert auf einer Methodik, die: - Unternehmen ausschließt, die sich nicht an den Pakt der Vereinten Nationen halten (Menschenrechte, Arbeitsrechte, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung), - Unternehmen ausschließt, die in kontroverse Aktivitäten verwickelt sind (Tabak, Glücksspiel, Kraftwerkskohle) oder in schwerwiegende ESG-Kontroversen verwickelt sind (Vorfälle, Behauptungen im Zusammenhang mit Umwelt-, Sozial- und Governance-Themen), - sich auf einen quantitativen „Best-in-Class“-ESG-Ansatz und einen qualitativen ESG-Ansatz stützt, - und - zielt auf eine Impact- und thematische Research zur Nachhaltigkeit ab, indem sichergestellt wird, dass die Produkte und/oder Dienstleistungen des Unternehmens - im Verhältnis zum Umsatz - eine nachhaltige Entwicklung finanzieren. Weitere Informationen finden Sie unter [www.dpamfunds.com](http://www.dpamfunds.com). Benchmark: MSCI AC 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.

## AUFTEILUNG (IN%)

Branchen	Fonds		Regionen	Fonds	
	Fonds	Bench		Fonds	Bench
Informationstechnologie	31.9	22.3	Nordamerika	47.7	62.4
Gesundheitswesen	22.9	11.7	EMU	17.5	8.5
Finanzwesen	12.4	14.4	Sonstige Regionen	14.6	15.0
Nicht-Basiskonsumgüter	8.7	12.4	Europa ex-EMU	12.4	7.9
Basiskonsumgüter	7.4	6.8	Japan	5.8	6.2
Industrie	6.2	9.7	Barguthaben	2.0	0.0
Kommunikation	3.4	9.3			
Immobilien	3.4	2.6			
Roh-, Hilfs- und Betr.-Stoffe	1.8	4.7			
Versorger	0.0	2.6			
Energie	0.0	3.5			
Barguthaben	2.0	0.0			

## Top 10

Unternehmen	Anteil
Microsoft	2.6
Salesforce.com, Inc.	2.5
Thermo Fisher Scientific Inc	2.4
Nice Systems	2.4
Danaher Corporation	2.4
Nvidia Corp	2.4
Boston Scientific Corporation	2.4
Adobe Systems Incorporated	2.3
Intuit Inc.	2.3
Mastercard Incorporated Class A	2.2

## Währungen

Währung	Fonds	Bench
US Dollar	50.2	59.9
Euro	19.5	8.9
Japanischer Yen	5.8	6.2
Schweizer Franken	5.6	2.4
Hong Kong Dollar	5.0	1.8
Pfund sterling	4.8	3.6
Dänische Krone	2.0	0.7
Thailändischer Baht	1.9	0.2
Chinesische Yuan	1.9	2.1
indische Rupie	1.7	1.5
indonesische Rupiah	1.6	0.2
Norwegische Krone	0.0	0.2
Andere	0.0	12.5

# DPAM Invest B Equities World Sustainable - A

Monatliches Factsheet | 30. September 2021  
Fondswährung EUR

## BRUTTOWERTENTWICKLUNG (IN %) (\*)

	Fonds	Benchmark
1 Monat	-4.30	-2.36
Laufendes Jahr	16.90	17.31
1 Jahr	26.56	28.94
3 Jahre (p.a.)	18.06	12.66
5 Jahre (p.a.)	15.96	12.50
10 Jahre (p.a.)	13.68	14.11
Seit Auflage (p.a.)	7.48	-

## STATISTISCHE ANGABEN (5 JAHRE)

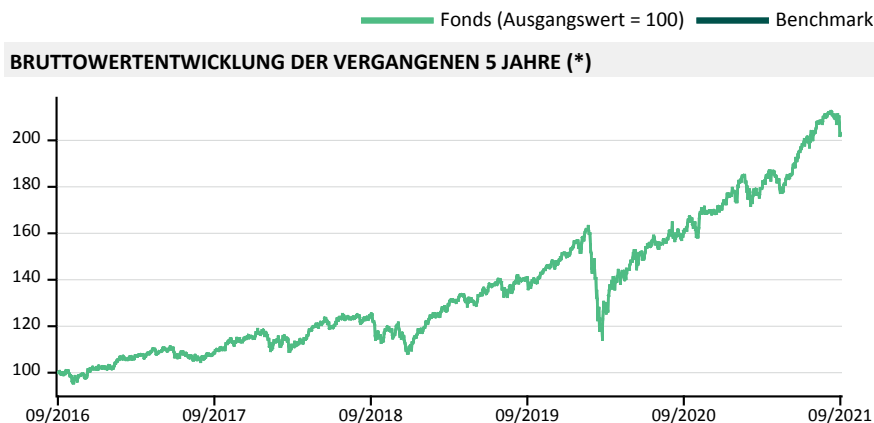
	Fonds	Benchmark
Volatilität	% 11.45	13.36
Sharpe Ratio	1.43	0.97
Downside Deviation	% 6.93	8.66
Sortino Ratio	2.36	1.49
Anzahl positiver Monate	% 76.67	68.33
Maximaler Verlust	% -14.20	-19.69
Risikoloser Zins	<b>-0.46%</b>	

## FONDS VERSUS BENCHMARK (5 JAHRE)

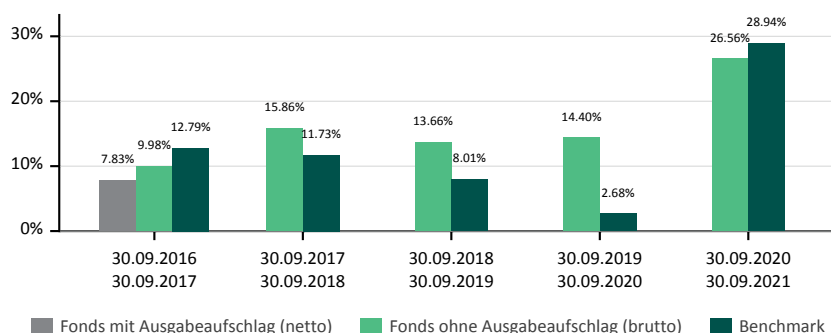
Korrelation	0.928
R <sup>2</sup>	0.862
Alpha	% 0.45
Beta	0.795
Treynor Ratio	% 20.57
Tracking Error	% 5.06
Information Ratio	0.539

Benchmark: MSCI AC World Net Return (seit 01.07.2016)  
Früher: MSCI World Net Return

## BRUTTOWERTENTWICKLUNG DER VERGANGENEN 5 JAHRE (\*)



## WERTENTWICKLUNG



Annahmen, Erläuterungen und Modellrechnung: Ein Anleger erwirbt für EUR 1000,- Anteile. Bei einem maximalen Ausgabeaufschlag von 2.00% muss er dafür EUR 1020,- aufwenden. (\*) Die Bruttowertentwicklung (BVI-Methode) berücksichtigt alle auf Fondsebene anfallenden Kosten, die Nettowertentwicklung zusätzlich den Ausgabeaufschlag. Auf Anlegerebene können weitere Kosten anfallen (z.B. Depotgebühren). Da der Ausgabeaufschlag nur im 1. Jahr anfällt, unterscheidet sich die Darstellung brutto/netto nur in diesem Jahr. Wertentwicklungen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

## CHANCEN

- Partizipation an den Kurssteigerungen der globalen Aktienmärkte.
- Attraktive Chancen durch eine breite Streuung.
- 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.
- 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.