

DPAM Equities L Europe Behavioral Value - F

Ficha Mensual | 31 octubre 2021

VISIÓN GENERAL

Clase de activo	Renta Variable
Categoría	Europa
Estrategia	Estrategia activa
Fondo de	DPAM Equities L
Estructura Legal	SICAV
Domicilio	Luxemburgo
Moneda de Referencia	EUR
Liquidez	Diario
Lanzamiento sub-fondo	31.12.2001
Fecha del primer valor liquidativo	26.10.2005
Países de Registro	AT, CH, DE, ES, FR, IT, LU, NL

ISIN	LU0231631879
Comisión de Suscripción	Maximum 1%
Comisión de Rembolso	0%
Gastos corrientes*	1.02%
<i>*Incluida comisión de gestión</i>	0.80%
Inversión mínima	EUR 25'000
Valor liq. (Capitalización)	57.04
Activos (todas las clases)	mill. EUR 49.46
Número de posiciones	117

PERFIL RENTABILIDAD/RIESGO

Riesgo más bajo	Riesgo más alto					
Rendimiento potencialmente más bajo	Rendimiento potencialmente más alto					
1	2	3	4	5	6	7

SRRI calculado según UCITS (EU) regulación N°583/2010

POLÍTICA DE INVERSIÓN

Aumentar el valor de su inversión a largo plazo. El compartimento invierte en acciones de empresas que tienen su domicilio social o una parte importante de sus actividades, activos, centros de beneficios o centros de decisión en un país europeo (incluidos el Reino Unido y Suiza). A fin de aprovechar o de protegerse contra las fluctuaciones del mercado, o bien para una gestión eficaz de la cartera, el compartimento puede recurrir al uso de instrumentos derivados. El gestor administra dinámicamente su cartera. Sus elecciones de asignación de activos y la duración de las inversiones se basan en análisis políticos, económicos, monetarios y financieros. Índice de referencia: MSCI Europe Net Return. El subfondo está gestionado de forma activa, lo que significa que el gestor de la cartera no pretende replicar la rentabilidad del índice. Esto se utiliza para la comparación de rendimiento. La selección y ponderación de los activos en la cartera del subfondo pueden diferir significativamente de la composición del índice.

DESGLOSE (%)

Sectores	Fondo	Índice	Países	Fondo	Índice
Finanzas	17.7	16.3	Francia	29.2	17.5
Industria	14.3	14.7	Alemania	18.5	13.8
Salud	14.2	14.5	Reino Unido	15.9	22.4
Consumo duradero	11.8	11.7	Países Bajos	8.3	7.8
Prod. de primera necesidad	11.4	12.6	Suiza	5.1	15.2
Tecnología de la información	8.3	8.8	Italia	4.7	3.9
Materiales	7.3	7.7	Suecia	3.9	5.8
Energía	5.1	4.8	Bélgica	3.7	1.4
Servicios públicos	5.0	4.2	Austria	3.3	0.3
Comunicación	3.9	3.5	España	1.9	3.7
Inmobiliarias	0.9	1.1	Irlanda	1.9	1.1
Efectivo	0.1	0.0	Noruega	1.6	1.0
			Otro	1.7	6.1
			Efectivo	0.1	0.0

Top 10

	Fondo	Índice
Total Energies	3.5	52.5
Novartis	2.6	21.5
GlaxoSmithKline	2.0	15.2
SAP AG	1.8	5.5
Sanofi	1.8	1.0
Omv Ag	1.6	4.2
Prosus Nv	1.5	0.1
Anheuser Busch Inbev	1.5	0.0
UCB	1.5	
Merck KGaA	1.4	

Monedas

	Fondo	Índice
Euro	72.5	52.5
Libra esterlina	16.0	21.5
Franco Suizo	5.1	15.2
Corona sueca	3.9	5.5
Corona noruega	1.6	1.0
Corona danesa	0.7	4.2
Dólar USA	0.0	0.1
Dólar de Hong Kong	0.0	0.0

DPAM Equities L Europe Behavioral Value - F

Ficha Mensual | 31 octubre 2021

Moneda de Referencia EUR

RENTABILIDADES (%) (*)

	Fondo	Índice
Último mes	3.71	4.66
Desde comienzos de año	20.75	21.62
1 año	43.79	41.86
3 años anualizados	6.58	11.55
5 años anualizados	5.97	9.35
10 años anualizados	8.29	9.42
Desde Creación anualizados	3.85	5.51

ESTADÍSTICAS (5 AÑOS) (*)

	Fondo	Índice
Volatilidad (%)	% 17.24	14.17
Ratio de Sharpe	0.37	0.69
Desviación a la baja	% 12.19	9.32
Sortino Ratio	0.53	1.05
Meses positivos	% 61.67	63.33
Reducción máxima	% -30.38	-22.59

Tipo de interés sin riesgo -0.47%

FONDO CONTRA EL INDICE (5 AÑOS) (*)

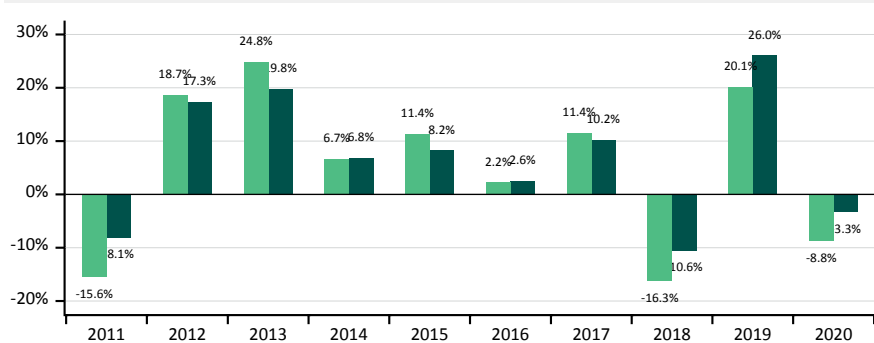
Correlación	0.982
R ²	0.964
Alpha	% -0.38
Beta	1.194
Ratio de Treynor	% 5.37
Error de seguimiento	% 4.27
Ratio de información	-0.634

Índice: MSCI Europe Net Return

VALOR LIQUIDATIVO ÚLTIMOS 10 AÑOS (*)



RENTABILIDAD ANUALIZADA (*)



DISCLAIMER

(*) Las cifras de rentabilidad corresponden al rendimiento total del fondo, incluyendo dividendos, cupones y aumentos o reducciones de precio. Las cifras de rendimiento toman en cuenta la comisión de gestión y otros gastos recurrentes, pero no la comisión de entrada, de salida y el impuesto en el reembolso. El rendimiento anualizado se calcula de forma actuarial y se expresa como un porcentaje del valor actual neto al comienzo del período. A menos que se indique lo contrario, los rendimientos se calculan en la misma moneda que la del valor actual neto del subfondo. Los rendimientos se basan en los resultados alcanzados en el pasado y no son garantía de rendimientos futuros. Suscripciones para cualquier fondo mencionado en este documento se basan en los Datos de Inversión fundamentales (KIID), en el prospecto y en los informes anuales y semestrales más recientes. Estos documentos están disponibles en el sitio web funds.degroofpetercam.com.