

# DPAM Invest B Equities NEWGEMS Sustainable - B

Ficha Mensual | 30 noviembre 2020

Morningstar ★★★★★ (\*)

## VISIÓN GENERAL

|                                      |                                |
|--------------------------------------|--------------------------------|
| Clase de activo                      | Renta Variable                 |
| Categoría                            | Global                         |
| Estrategia                           | Estrategia activa              |
| Fondo de                             | DPAM Invest B                  |
| Estructura Legal                     | SICAV                          |
| Domicilio                            | Bélgica                        |
| Moneda de Referencia                 | EUR                            |
| Liquidez                             | Diario                         |
| Lanzamiento sub-fondo                | 22.09.2006                     |
| Fecha del primer valor liquidativo   | 02.10.2006                     |
| Países de Registro                   | AT, BE, CH, DE, ES, FR, IT, LU |
| ISIN                                 | BE0946564383                   |
| Comisión de Suscripción              | Maximum 2%                     |
| Comisión de Rembolso                 | 0%                             |
| Gastos corrientes*                   | 1.80%                          |
| <i>*Incluida comisión de gestión</i> | 1.50%                          |
| Inversión mínima                     | 1 acción                       |
| Valor liq. (Capitalización)          | 224.46                         |
| Activos (todas las clases)           | mill. EUR 1'497.99             |
| Número de posiciones                 | 79                             |

## PERFIL RENTABILIDAD/RIESGO



## POLÍTICA DE INVERSIÓN

El objetivo del fondo es proporcionarle exposición a valores de renta variable de compañías de todo el mundo seleccionadas en base a ciertas tendencias y temas comerciales. Se trata de un fondo gestionado activamente, lo que significa que el gestor de la cartera no pretende replicar el rendimiento de ningún índice de referencia. El fondo invierte principalmente en acciones y/u otros valores que dan acceso al capital de las llamadas empresas "del futuro" de todo el mundo, identificadas por la sigla NEWGEMS (tendencias y temas comerciales relacionados con la nanotecnología, la ecología, el bienestar, la Generación Z, la sociedad electrónica, la industria 4.0 y la seguridad) y seleccionadas en base a criterios medioambientales, sociales y de gobernanza (ESG). Índice de referencia: MSCI World Net Return. Utilización del índice de referencia: el índice de referencia se utiliza para la comparación del rendimiento. La selección y ponderación de los activos en la cartera del fondo puede diferir significativamente de la composición del índice de referencia.

## ÍNDICE

MSCI World Net Return (desde 31.07.2014)  
Índice de referencia anterior MSCI World Energy

## DESGLOSE (%)

| Sectores                     | Fondo | Índice | Regiones        | Fondo | Índice |
|------------------------------|-------|--------|-----------------|-------|--------|
| Tecnología de la información | 35.3  | 21.6   | North America   | 64.3  | 69.2   |
| Salud                        | 20.9  | 13.1   | Resto del mundo | 9.8   | 3.7    |
| Comunicación                 | 11.9  | 8.9    | EMU             | 8.9   | 9.9    |
| Consumo duradero             | 10.3  | 11.9   | Europa ex-EMU   | 8.8   | 9.2    |
| Industria                    | 7.8   | 10.7   | Japan           | 5.5   | 7.9    |
| Materiales                   | 4.5   | 4.5    | Efectivo        | 2.6   | 0.0    |
| Finanzas                     | 3.6   | 12.8   |                 |       |        |
| Prod. de primera necesidad   | 3.0   | 7.8    |                 |       |        |
| Inmobiliarias                | 0.0   | 2.7    |                 |       |        |
| Servicios públicos           | 0.0   | 3.2    |                 |       |        |
| Energía                      | 0.0   | 2.8    |                 |       |        |
| Efectivo                     | 2.6   | 0.0    |                 |       |        |

## Top 10

| Compañía             | Porcentaje |
|----------------------|------------|
| Amazon Com           | 3.1        |
| Microsoft            | 2.9        |
| Sony Corporation     | 2.2        |
| Aptiv Automotive Plc | 2.2        |
| Walt Disney          | 2.1        |
| Apple                | 2.0        |
| Alphabet A           | 2.0        |
| Kerry Group          | 1.8        |
| Nice Systems         | 1.8        |
| Splunk Inc.          | 1.8        |

## Monedas

| Moneda             | Fondo | Índice |
|--------------------|-------|--------|
| Dólar USA          | 69.5  | 66.2   |
| Euro               | 11.6  | 10.2   |
| Libra esterlina    | 5.8   | 4.1    |
| Yen japonés        | 5.5   | 7.9    |
| Dólar de Hong Kong | 2.0   | 1.0    |
| Corona sueca       | 1.9   | 1.0    |
| Won coreano        | 1.3   | 0.0    |
| Corona noruega     | 0.8   | 0.2    |
| Dólar canadiense   | 0.8   | 3.1    |
| Dólar australiano  | 0.5   | 2.1    |
| Franco Suizo       | 0.4   | 3.0    |
| Corona danesa      | 0.0   | 0.8    |
| Otro               | 0.0   | 0.5    |

# DPAM Invest B Equities NEWGEMS Sustainable - B

Ficha Mensual | 30 noviembre 2020  
Moneda de Referencia EUR

## RENTABILIDADES (%) (\*)

|                            | Fondo | Índice |
|----------------------------|-------|--------|
| Último mes                 | 7.43  | 9.83   |
| Desde comienzos de año     | 28.39 | 4.34   |
| 1 año                      | 29.20 | 5.56   |
| 3 años anualizados         | 20.75 | 9.40   |
| 5 años anualizados         | 14.32 | 8.14   |
| 10 años anualizados        | 10.35 | 10.36  |
| Desde Creación anualizados | 5.88  | 7.98   |

## ESTADÍSTICAS (5 AÑOS) (\*)

|                      | Fondo  | Índice |
|----------------------|--------|--------|
| Volatilidad (%)      | 14.35  | 13.94  |
| Ratio de Sharpe      | 1.02   | 0.61   |
| Desviación a la baja | 8.34   | 9.29   |
| Sortino Ratio        | 1.76   | 0.92   |
| Meses positivos      | 66.67  | 60.00  |
| Reducción máxima     | -13.85 | -19.78 |

Tipo de interés sin riesgo -0.41%

## FONDO CONTRA EL INDICE (5 AÑOS) (\*)

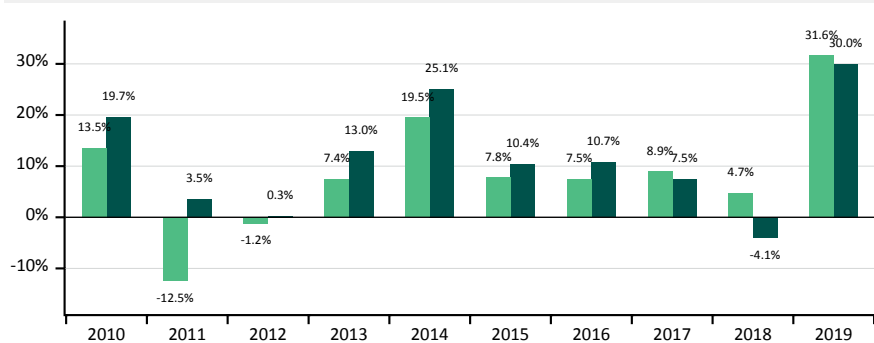
|                      |       |
|----------------------|-------|
| Correlación          | 0.927 |
| R <sup>2</sup>       | 0.860 |
| Alpha                | 0.50  |
| Beta                 | 0.955 |
| Ratio de Treynor     | 15.35 |
| Error de seguimiento | 5.40  |
| Ratio de información | 1.043 |

Índice: MSCI World Net Return (desde 31.07.2014)  
Anterior: MSCI World Energy

## 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 los 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](https://funds.degroofpetercam.com).