

Invesco DB Commodity Index Tracking Fund

Morningstar Medalist Rating™



Morningstar Categorie Index

Bloomberg Commodity TR USD

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

DBIQ Optimum Yield Div Comdt

ER USD

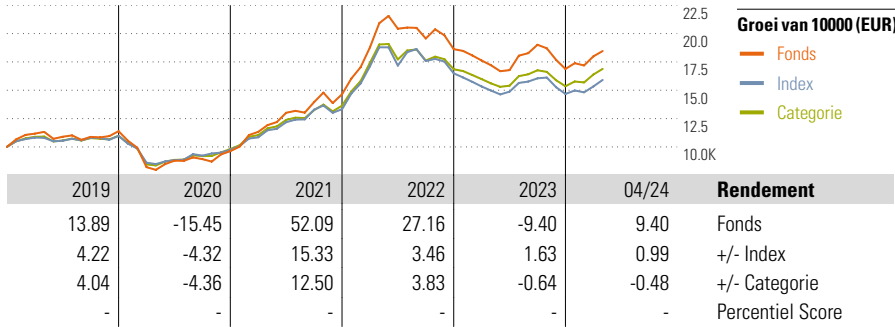
Morningstar Rating™

★★★

Morningstar Categorie™

Beleggingsdoelstelling

The investment seeks to track changes, whether positive or negative, in the level of the DBIQ Optimum Yield Diversified Commodity Index Excess Return™. The fund pursues its investment objective by investing in a portfolio of exchange-traded futures on Light Sweet Crude Oil (WTI), Heating Oil, RBOB Gasoline, Natural Gas, Brent Crude, Gold, Silver, Aluminum, Zinc, Copper Grade A, Corn, Wheat, Soybeans, and Sugar. The index is composed of notional amounts of each of these commodities.



Risicomaatstaven

Alpha	3.94	Sharpe Ratio	0.87
Beta	0.98	Std Deviatie	16.79
R-kwadraat	84.06	3-jr Risico	Bov gem
Informatie Ratio	0.61	5-jr Risico	Bov gem
Tracking Error	6.55	10-jr Risico	Bov gem

Berekeningen met Bloomberg Commodity TR USD (waar van toepassing)

Rendementen (3 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	6.30	-0.28	-0.58
6 Maanden	-2.10	-0.70	-2.87
1 jaar	10.38	2.27	0.71
3 jr gean.	14.72	3.71	2.29
5 jr gean.	10.16	2.16	1.15

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	6.60	-	-	-
2023	-5.39	-4.78	13.31	-11.24
2022	28.18	8.80	-4.22	-4.80
2021	17.63	14.86	7.27	4.94
2020	-27.84	6.90	1.61	7.87

Portefeuille 2 mei 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	6.65	0.00	6.65
Obligaties	3.83	0.00	3.83
Kas/ geldmarkt	45.85	0.00	45.85
Overig	51.87	8.20	43.67

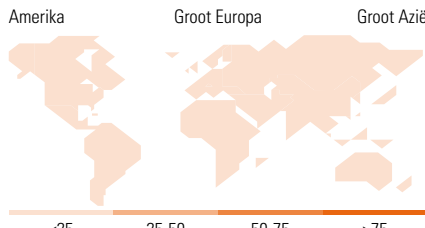
Morningstar Style Box

Stijl Aandelen

	Wrd	Gem	Groei	Stijl
Onverw				
Groot				
Mid				
Klein				

Stijl vastrentend

	Laag	Gem	Hoog	Rentegevoeligheid
Kredietwaarde				
Hoog				
Med				
Laag				



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
Invesco Shrt-Trm Inv Gov&Agcy...	—	23.19
United States Treasury Bills...	—	17.35
Mini Ibovespa Future Dec...	—	6.65
Brent Crude Future Feb...	—	6.45
WTI BALMO Swap Futures Jan15	—	6.37

Invesco Short Term Treasury ETF	—	6.25
NY Harbor ULSD Future June...	—	6.06
Gold Future Dec 242024-12-27	—	4.68
Lme Copper Future...	—	4.07
Lme Pri Alum Futr...	—	3.33

Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	0
% Van Vermogen In Top 10 Posities	84.39

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	0.00
Basismaterialen	-
Cyclische consumentenproducten	-
Financiële dienstverlening	-
Vastgoed	-
Licht Cyclisch	0.00
Communicatiediensten	-
Energie	-
Industrie	-
Technologie	-
Defensief	0.00
Defensieve consumptiegoederen	-
Gezondheidszorg	-
Nutsbedrijven	-

Fondsinformatie

Fondsgroep	Invesco	Vestigingsland	Verenigde Staten	Min Aanvangsbedrag	-
Telefoon	(800) 659-1005	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	www.invesco.com/us	UCITS	nee		
Oprichtingsdatum	3 feb 2006	Inc/Acc	-		
Fondsmanager	Management Team	ISIN	US46138B1035		
Aanvangsdatum	3 feb 2006				
Koers (3 mei 2024)	USD 23.11				
Fondsvermogen (mln)	USD 1,733.96				