

Candriam Diversified Futures Classique

Categoria Morningstar™

Alt - Systematic Futures

Benchmark Morningstar
Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR
Usato nel Report
Benchmark Dichiarato

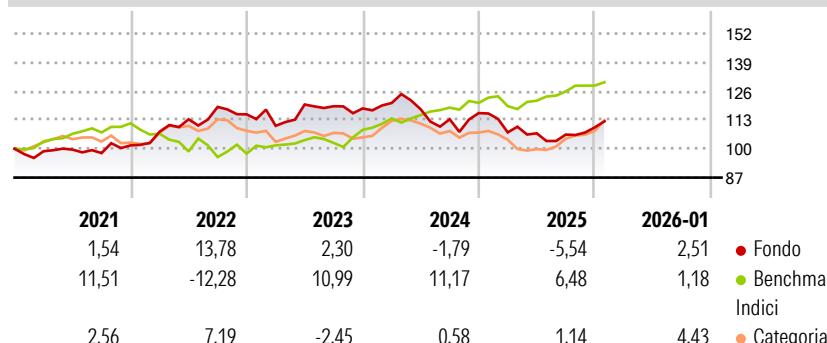
€STR capitalisé Jour TR EUR

Morningstar Rating™

★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

"Candriam Diversified Futures è un fondo UCITS che offre agli investitori professionisti un approccio di investimento sistematico di tipo quantitativo. Il fondo assumerà posizioni a lungo e a breve termine sulle principali asset classes (indici di borsa, tassi a breve termine, obbligazioni statali e divise), in base ai segnali generati dalle tre strategie principali implementate nel fondo: tendenza, controtendenza e riconoscimento del modello. L'eccesso di denaro liquido nel fondo è investito in titoli con un rating elevato a breve termine del mercato monetario."

Rendimenti

Misure di Rischio

3Y Alpha	-3,31	3Y Sharpe Ratio	-0,26
3Y Beta	0,10	3Y Std Dev	10,31
3Y R-Squared	0,32	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,78	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	11,45	10Y Risk	Med

Basati su Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %

3-Mesi	5,86	1,65	1,87
6-Mesi	8,58	6,69	6,25
1-Anno	-2,51	6,10	4,48
3-Anni Ann.ti	-0,50	8,37	3,28
5-Anni Ann.ti	2,87	5,19	2,55
10-Anni Ann.ti	2,00	5,75	0,98

Rendimenti aggiornati al 30/01/2026

Fondo

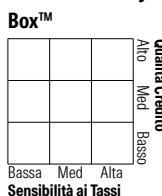
Bmk	Cat
-	-
-	-
-	-
-	-

Rendimenti Trimestrali %

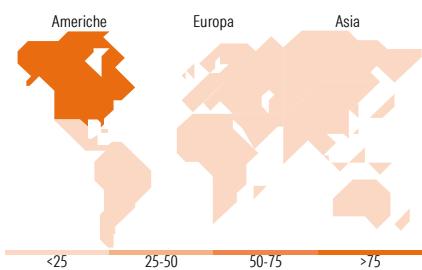
	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-7,50	-0,39	-0,51	3,04
2024	2,08	-2,35	-3,82	2,45
2023	-4,50	8,72	-0,64	-0,84
2022	6,06	5,20	4,94	-2,82

Portafoglio 30/11/2025


Asset Allocation %	Netta
• Azioni	1,82
• Obbligazioni	17,51
• Liquidità	80,53
• Altro	0,14

Fixed Income Style Box™

Fondo

Americhe	B
Europa	-
Asia	-


Titoli principali

Nome	Settore	%
Austria (Republic of)	-	10,85
Finland (Republic Of)	-	7,85
European Stability Mechanism	-	7,23
European Union	-	6,97
Belgium (Kingdom Of)	-	6,59
European Union	-	6,58
France (Republic Of)	-	6,57
Spain (Kingdom of)	-	6,57
Candriam L Alt Mlt Starts Z...	-	5,07
Belgium (Kingdom Of)	-	4,28
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		68,56
Numeri Complessivo di Titoli Azionari	0	
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari	15	

Fixed Income Sector Weightings %

Fondo	Governativo	56,87
Societario	1,54	
Cartolarizzazioni	0,00	
Enti Locali	0,00	
Liquidità ed equivalenti	41,13	
Derivati	0,45	

Ripartizione Geografica %

Fondo	America	77,68
Stati Uniti		77,60
Canada		0,02
America Latina e Centrale		0,05
Europa	19,52	
Regno Unito		0,03
Europa Occidentale - Euro		19,36
Europa Occidentale - Non Euro		0,12
Europa dell'Est		0,00
Africa		0,01
Medio Oriente		0,00
Asia	2,80	
Giappone		2,74
Australasia		0,00
Asia - Paesi Sviluppati		0,05
Asia - Emergenti		0,01

Anagrafica

Società di Gestione	Candriam
Telefono	+352 27975130
Web	www.candriam.com
Data di Partenza	16/11/2009
Nome del Gestore	Steeve Brument
Data Inizio Gestione	16/11/2009
NAV (30/01/2026)	EUR 12.896,71
Patrimonio Netto (Mln)	151,59 EUR

(30/11/2025)

Patrimonio Classe (Mln)	9,47 EUR
(30/01/2026)	
Domicilio	FRANCIA
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	FR0010794792

Investimento Min. Ingresso
Investimento Min. Successivo
T.E.R.
Spese correnti
Commissione di incentivo

-
-
-
1,70%
20,00%