

Candriam Diversified Futures Classique

Categoria Morningstar™
Alt - Systematic Futures

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

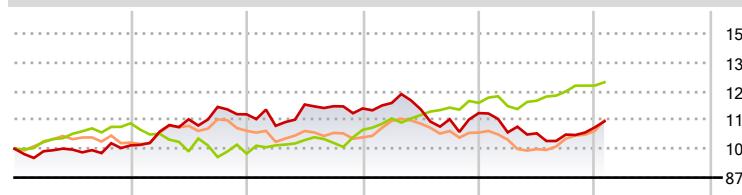
Benchmark Dichiarato
€STR capitalisé Jour TR EUR

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



2021	2022	2023	2024	2025	2026-01
1,54	13,78	2,30	-1,79	-5,54	2,51
11,51	-12,28	10,99	11,17	6,48	1,18
			0,58	1,14	4,43
2,56	7,19	-2,45			

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 %

Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	5,86	1,65
6-Mesi	8,58	6,69
1-Anno	-2,51	6,10
3-Anni Ann.ti	-0,50	8,37
5-Anni Ann.ti	2,87	5,19
10-Anni Ann.ti	2,00	5,75

Rendimenti aggiornati al 30/01/2026

Rendimenti Trimestrali %

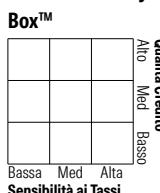
	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-7,50	-0,39	-0,51	3,04
2024	2,08	-2,35	-3,82	2,45
2023	-4,50	8,72	-0,64	-0,84
2022	6,06	5,20	4,94	-2,82

Portafoglio 30/11/2025



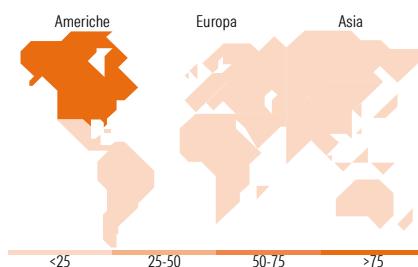
Asset Allocation %	Netta
• Azioni	1,82
• Obbligazioni	17,51
• Liquidità	80,53
• Altro	0,14

Fixed Income Style



Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media

Fondo



Ripartizione Geografica %

Fondo	America	77,68
Stati Uniti		77,60
Canada		0,02
America Latina e Centrale		0,05
Fondo	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
Fondo	Asia	2,80
Giappone		2,74
Australasia		0,00
Asia - Paesi Sviluppati		0,05
Asia - Emergenti		0,01

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

Coupon Range %

Fondo	0 coupon	92,02
Da 0 a 4 cedole		7,98
Da 4 a 6 cedole		0,00
Da 6 a 8 cedole		0,00
Da 8 a 10 cedole		0,00
Da 10 a 12 cedole		0,00
Oltre 12 cedole		0,00

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	Investimento Min. Ingresso	-
(30/01/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Domicilio	FRANCIA	T.E.R.	-
Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	1,70%
UCITS	Si	Commissione di incentivo	20,00%
Inc/Acc	Acc		
ISIN	FR0010794792		