

# 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

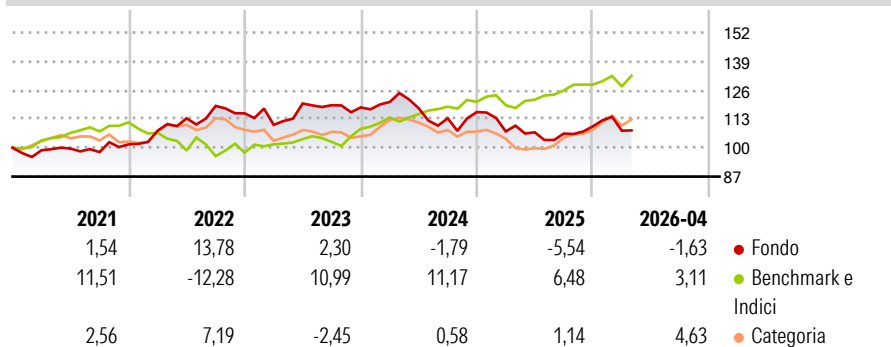
"Candriam Diversified Futures é un fondo UCITS che offre agli investitori professionisti un approccio di investimento sistematico di tipo quantitativo. Il fondo assumerà posizioni a lungo e a breve termine sulle principali asset classes (indici di borsa, tassi a breve termine, obbligazioni statali e 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."

### Misure di Rischio

3Y Alpha	-5,86	3Y Sharpe Ratio	-0,37
3Y Beta	0,36	3Y Std Dev	9,92
3Y R-Squared	5,17	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,99	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	10,50	10Y Risk	Med

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

### Rendimenti



### Rend. Cumulati %

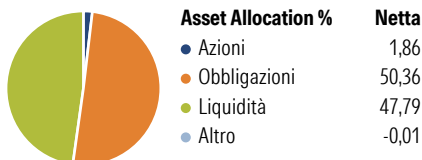
	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-2,90	2,49	3,23
6-Mesi	2,05	5,09	6,25
1-Anno	-0,57	12,49	11,52
3-Anni Ann.ti	-0,73	9,51	6,34
5-Anni Ann.ti	1,72	5,01	2,19
10-Anni Ann.ti	1,62	5,81	1,20

Rendimenti aggiornati al 05/05/2026

### Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-1,77	-	-	-
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 28/02/2026



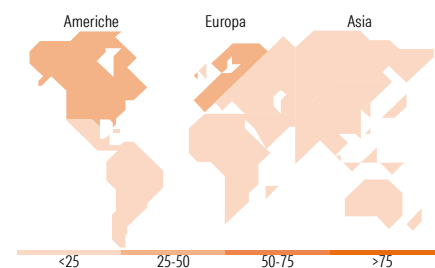
### Fixed Income Style

#### Box™

Qualità Credito	Alto	Medio	Basso
Alta			
Medio			
Bassa			

Sensibilità ai Tassi

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturità effettiva	-
Qualità Credito Media	B



### Titoli principali

Nome	Settore	%
Belgium (Kingdom Of)	-	11,61
Netherlands (Kingdom Of)	-	10,67
European Stability Mechanism	-	9,33
Finland (Republic Of)	-	7,75
European Union	-	6,75
France (Republic Of)	-	6,43
Spain (Kingdom of)	-	5,77
Candriam L Alt Mlt Starts Z...	-	5,24
Finland (Republic Of)	-	4,18
Candriam Monétaire SICAV Z C	-	3,77
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		71,49
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		19

### Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	80,81
Societario	1,37
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	17,74
Derivati	0,08

### Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	97,34
Da 0 a 4 cedole	2,65
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

### Ripartizione Geografica %

	Fondo
<b>America</b>	<b>46,21</b>
Stati Uniti	46,20
Canada	0,02
America Latina e Centrale	0,00
<b>Europa</b>	<b>45,80</b>
Regno Unito	0,25
Europa Occidentale - Euro	45,31
Europa Occidentale - Non Euro	0,00
Europa dell'Est	0,24
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
<b>Asia</b>	<b>7,99</b>
Giappone	0,00
Australasia	7,96
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,02

### Anagrafica

Società di Gestione	Candriam	Patrimonio Classe (Mln)	8,75 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+352 27975130	(06/05/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.candriam.com	Domicilio	FRANCIA	T.E.R.	1,70%
Data di Partenza	16/11/2009	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	1,70%
Nome del Gestore	Steeve Brument	UCITS	Si	Commissione di incentivo	20,00%
Data Inizio Gestione	16/11/2009	Inc/Acc	Acc		
NAV (05/05/2026)	EUR 12.415,93	ISIN	FR0010794792		
Patrimonio Netto (Mln)	154,16 EUR				

(28/02/2026)