

Candriam Diversified Futures I

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

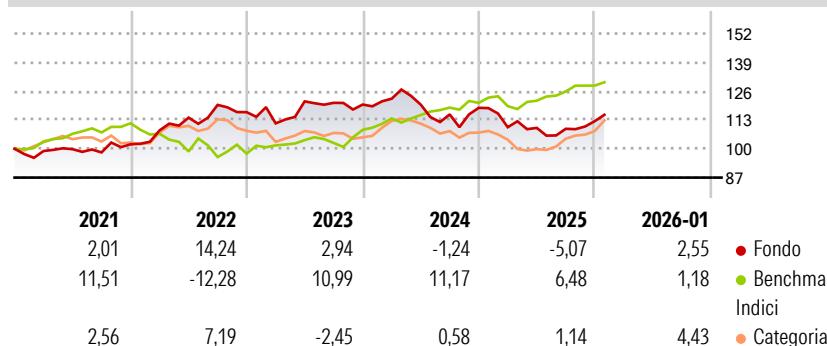
Morningstar Rating™

★★★

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	-2,78	3Y Sharpe Ratio	-0,21
3Y Beta	0,11	3Y Std Dev	10,30
3Y R-Squared	0,34	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,73	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	11,43	10Y Risk	Med

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

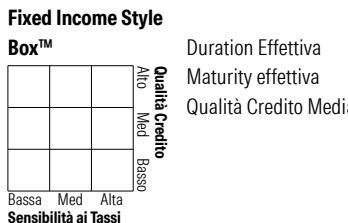
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	5,72	1,65	1,87	-	-	-	-	-
6-Mesi	10,96	6,69	6,25	2026	-	-	-	-
1-Anno	-2,76	6,10	4,48	2025	-7,38	-0,27	-0,39	3,17
3-Anni Ann.ti	0,30	8,37	3,28	2024	2,19	-2,16	-3,70	2,58
5-Anni Ann.ti	3,14	5,19	2,55	2023	-4,35	8,89	-0,53	-0,64
10-Anni Ann.ti	2,18	5,75	0,98	2022	6,17	5,30	5,05	-2,73

Rendimenti aggiornati al 02/02/2026

Portafoglio 30/11/2025



Fixed Income Style Box™	Duration Effettiva	Fondo
	Maturity effettiva	-
	Qualità Credito Media	-
Altro	-	B
Med	-	
Basso	-	
Med	-	
Alta	-	
	Sensibilità ai Tassi	



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 %

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

Coupon Range %

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

Ripartizione Geografica %

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	77,68
Europa	19,52
Asia	2,80

Stati Uniti 77,60

Canada 0,02

America Latina e Centrale 0,05

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

Giappone 2,74

Australasia 0,00

Asia - Paesi Sviluppati 0,05

Asia - Emergenti 0,01

Anagrafica

Società di Gestione	Candriam	Patrimonio Classe (Mln)	90,96 EUR	Investimento Min. Ingresso	250.000 EUR
Telefono	+352 27975130	(02/02/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.candriam.com	Domicilio	FRANCIA	T.E.R.	-
Data di Partenza	16/11/2009	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	1,20%
Nome del Gestore	Steeve Brument	UCITS	Si	Commissione di incentivo	20,00%
Data Inizio Gestione	16/11/2009	Inc/Acc	Acc		
NAV (02/02/2026)	EUR 13.812,03	ISIN	FR0010813105		
Patrimonio Netto (Mln)	151,59 EUR				
(30/11/2025)					