

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

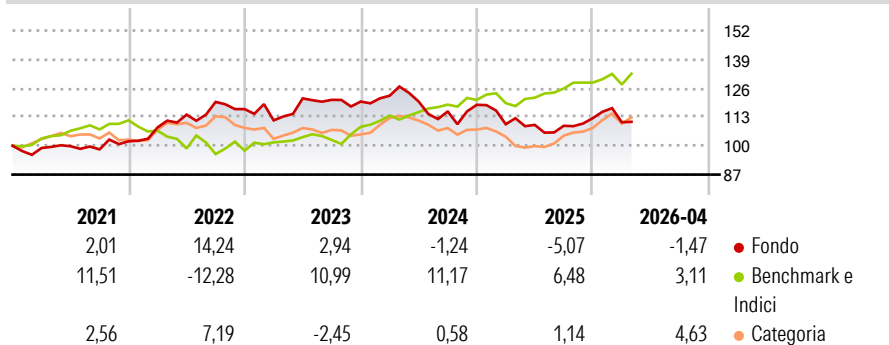
"Candriam Diversified Futures é un fondo UCITS che offre agli investitori professionisti un approccio di investimento sistematico di tipo quantitativo. Il fondo assumerà posizioni a lungo e a breve termine sulle principali asset classes (indici di borsa, tassi a breve termine, obbligazioni statali e 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	-5,33	3Y Sharpe Ratio	-0,32
3Y Beta	0,36	3Y Std Dev	9,91
3Y R-Squared	5,27	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,94	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	10,48	10Y Risk	Med

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

Rendimenti



Rend. Cumulati %

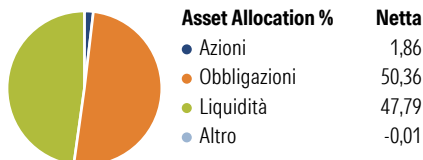
	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-2,99	2,37	2,94
6-Mesi	4,68	6,14	8,29
1-Anno	3,19	12,91	11,70
3-Anni Ann.ti	-0,81	10,04	6,07
5-Anni Ann.ti	2,41	5,37	2,34
10-Anni Ann.ti	2,37	5,71	1,28

Rendimenti aggiornati al 21/05/2026

Rendimenti

Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-1,65	-	-	-
2025	-7,38	-0,27	-0,39	3,17
2024	2,19	-2,16	-3,70	2,58
2023	-4,35	8,89	-0,53	-0,64
2022	6,17	5,30	5,05	-2,73

Portafoglio 28/02/2026

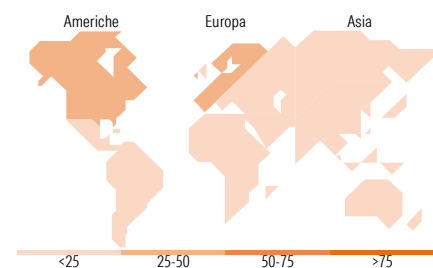


Fixed Income Style

Box™

Qualità Credito	Alto	Med	Basso
Sensibilità ai Tassi	Bassa	Med	Alta

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	
America	46,21
Stati Uniti	46,20
Canada	0,02
America Latina e Centrale	0,00
Europa	45,80
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
Asia	7,99
Giappone	0,00
Australasia	7,96
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,02

Anagrafica

Società di Gestione	Candriam	Patrimonio Classe (Mln)	89,43 EUR	Investimento Min. Ingresso	250.000 EUR
Telefono	+352 27975130	(21/05/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.candriam.com	Domicilio	FRANCIA	T.E.R.	1,20%
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 (21/05/2026)	EUR 13.462,42	ISIN	FR0010813105		
Patrimonio Netto (Mln)	154,16 EUR				

(28/02/2026)

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotte; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.