

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

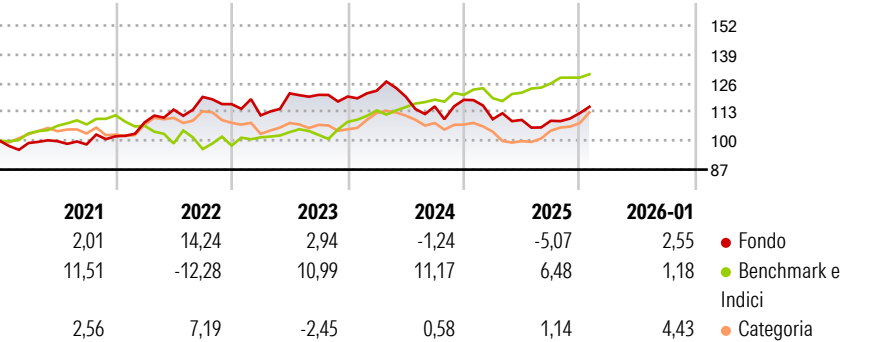
"Candriam Diversified Futures é un fondo UCITS che offre agli investitori professionisti un approccio di investimento sistematico di tipo quantitativo. Il fondo assumerà posizioni a lungo e a breve termine sulle principali asset classes (indici di borsa, tassi a breve termine, obbligazioni statali e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

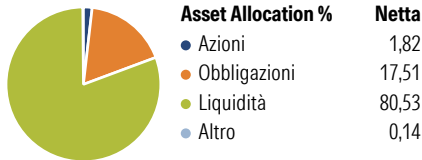
Rendimenti



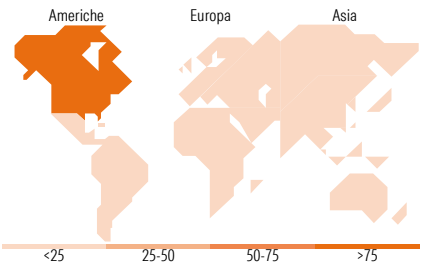
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	5,72	1,65	1,87	2026	-	-	-	-
6-Mesi	10,96	6,69	6,25	2025	-7,38	-0,27	-0,39	3,17
1-Anno	-2,76	6,10	4,48	2024	2,19	-2,16	-3,70	2,58
3-Anni Ann.ti	0,30	8,37	3,28	2023	-4,35	8,89	-0,53	-0,64
5-Anni Ann.ti	3,14	5,19	2,55	2022	6,17	5,30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

Rendimenti aggiornati al 02/02/2026

Portafoglio 30/11/2025



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



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
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero 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

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 - Emergente	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)