

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

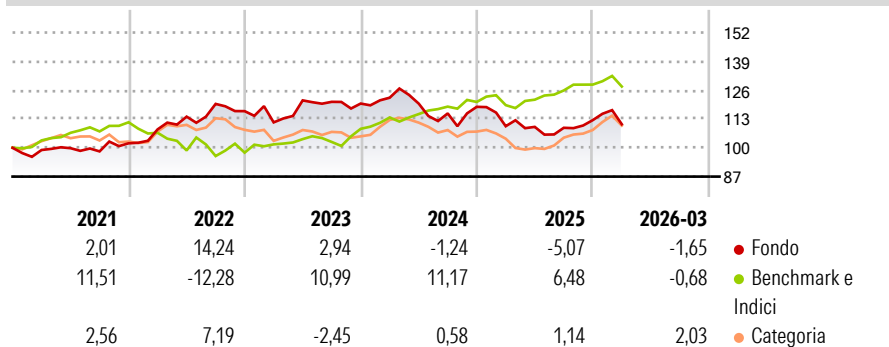
"Candriam Diversified Futures é un fondo UCITS che offre agli investitori professionisti un approccio di investimento sistematico di tipo quantitativo. Il fondo assumerà posizioni a lungo e a breve termine sulle principali asset classes (indici di borsa, tassi a breve termine, obbligazioni statali e 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	-4,57	3Y Sharpe Ratio	-0,27
3Y Beta	0,38	3Y Std Dev	9,95
3Y R-Squared	5,35	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,79	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	10,40	10Y Risk	Med

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

Rendimenti



Rend. Cumulati %

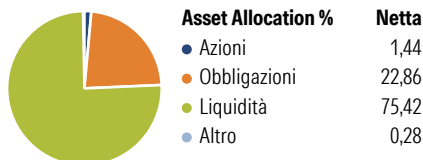
	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-2,23	-0,11	0,92
6-Mesi	0,47	3,31	1,92
1-Anno	0,16	14,48	10,71
3-Anni Ann.ti	-0,01	8,61	5,52
5-Anni Ann.ti	2,10	4,55	2,01
10-Anni Ann.ti	1,68	5,57	0,88

Rendimenti aggiornati al 09/04/2026

Rendimenti

	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 31/12/2025



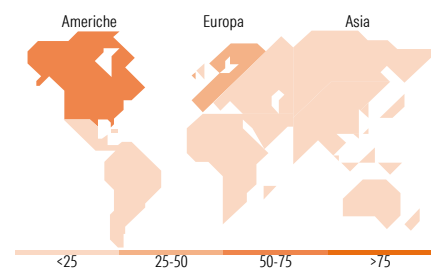
Fixed Income Style

Box™

Qualità Credito	Alto	Med	Basso
Alto			
Med			
Basso			

Sensibilità ai Tassi

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturità effettiva	-
Qualità Credito Media	B



Titoli principali

Nome	Settore	%
Austria (Republic of)	-	11,24
Finland (Republic Of)	-	8,13
Belgium (Kingdom Of)	-	7,77
European Stability Mechanism	-	7,50
European Union	-	7,22
European Union	-	6,82
France (Republic Of)	-	6,81
Spain (Kingdom of)	-	6,81
Candriam L Alt Mlt Starts Z...	-	5,28
Belgium (Kingdom Of)	-	4,43
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		71,99
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		15

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	58,80
Societario	1,84
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	38,91
Derivati	0,46

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	93,09
Da 0 a 4 cedole	6,91
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	56,62
Stati Uniti	56,62
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	40,42
Regno Unito	0,00
Europa Occidentale - Euro	40,39
Europa Occidentale - Non Euro	0,03
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	2,96
Giappone	2,95
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,01

Anagrafica

Società di Gestione	Candriam	Patrimonio Classe (Mln)	89,12 EUR	Investimento Min. Ingresso	250.000 EUR
Telefono	+352 27975130	(09/04/2026)		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 (09/04/2026)	EUR 13.312,80	ISIN	FR0010813105		
Patrimonio Netto (Mln)	146,58 EUR				

(31/12/2025)