

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

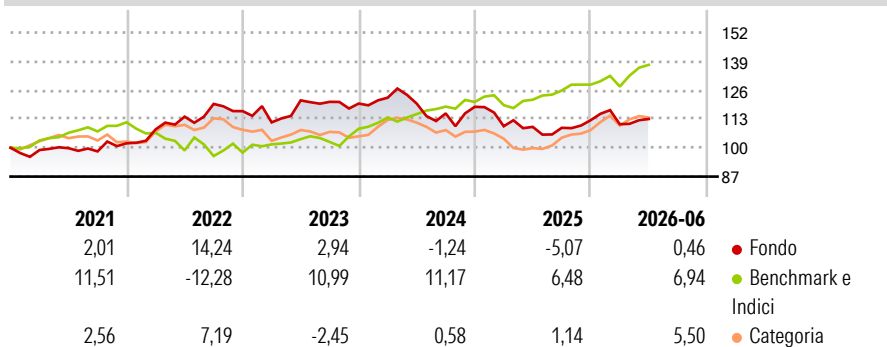
"Candriam Diversified Futures é un fondo UCITS che offre agli investitori professionisti un approccio di investimento sistematico di tipo quantitativo. Il fondo assumerà posizioni a lungo e a breve termine sulle principali asset classes (indici di borsa, tassi a breve termine, obbligazioni statali e 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	-7,13	3Y Sharpe Ratio	-0,52
3Y Beta	0,34	3Y Std Dev	9,25
3Y R-Squared	5,75	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	-1,22	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	9,94	10Y Risk	Med

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

Rendimenti



Rend. Cumulati %

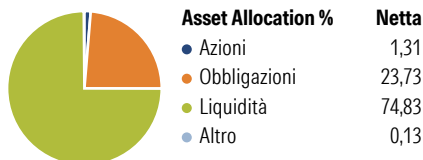
	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	3,43	4,98	2,53
6-Mesi	1,30	4,93	3,86
1-Anno	5,42	12,10	10,81
3-Anni Ann.ti	-2,04	10,18	5,22
5-Anni Ann.ti	3,17	5,01	2,49
10-Anni Ann.ti	1,87	5,77	1,16

Rendimenti aggiornati al 08/07/2026

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-1,65	2,14	-	-
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 30/04/2026



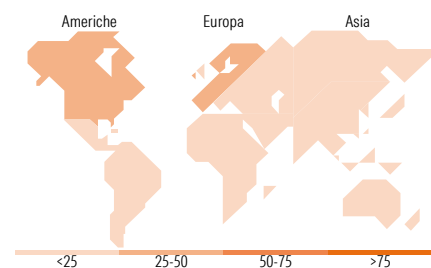
Fixed Income Style

Box™

Qualità Credito	Alto	Med	Basso
Alta			
Med			
Bassa			

Sensibilità ai Tassi

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	B



Titoli principali

Nome	Settore	%
Belgium (Kingdom Of)	—	12,27
European Stability Mechanism	—	9,86
Finland (Republic Of)	—	8,20
European Union	—	7,13
European Union	—	6,82
France (Republic Of)	—	6,80
Spain (Kingdom of)	—	6,09
Candriam L Alt Mlt Starts Z...	—	5,53
Italy (Republic Of)	—	4,84
Finland (Republic Of)	—	4,41
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		71,95
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		15

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	66,13
Societario	1,35
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	32,26
Derivati	0,26

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	94,36
Da 0 a 4 cedole	5,64
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	46,30
Stati Uniti	46,05
Canada	0,17
America Latina e Centrale	0,08
Europa	53,66
Regno Unito	4,42
Europa Occidentale - Euro	35,59
Europa Occidentale - Non Euro	4,68
Europa dell'Est	7,44
Africa	0,01
Medio Oriente	1,51
Asia	0,04
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,02
Asia - Emergente	0,02

Anagrafica

Società di Gestione	Candriam	Patrimonio Classe (Mln)	90,82 EUR	Investimento Min. Ingresso	250.000 EUR
Telefono	+352 27975130	(08/07/2026)		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 (08/07/2026)	EUR 13.697,80	ISIN	FR0010813105		
Patrimonio Netto (Mln)	146,33 EUR				

(30/04/2026)

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.