Candriam Diversified Futures N

Categoria Morningstar™
Alt - Systematic Futures

Benchmark Morningstar
Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR
Usato nel Report

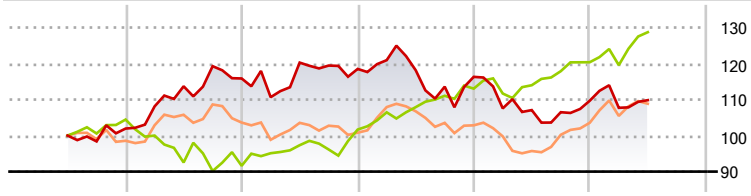
Benchmark Dichiarato
€STR capitalisé Jour TR EUR

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."

Rendimenti



	2021	2022	2023	2024	2025	2026-06
Fondo	-	13,65	2,28	-1,85	-5,69	0,13
Benchmark e Indici	-	-12,28	10,99	11,17	6,48	6,94
Categoria	-	7,19	-2,45	0,58	1,14	5,59

Misure di Rischio

3Y Alpha	-7,76	3Y Sharpe Ratio	-0,59
3Y Beta	0,34	3Y Std Dev	9,25
3Y R-Squared	5,74	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-1,28	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	9,94	10Y Risk	-

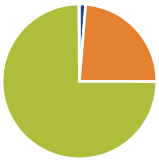
Basati su Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	1,03	6,78	6,05
6-Mesi	-1,16	6,75	5,13
1-Anno	2,53	12,92	7,71
3-Anni Ann.ti	-3,22	9,76	4,80
5-Anni Ann.ti	1,74	5,07	1,83
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 02/07/2026

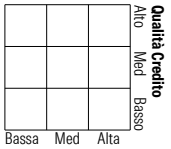
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-1,81	1,97	-	-
2025	-7,53	-0,44	-0,55	3,00
2024	2,05	-2,31	-3,86	2,40
2023	-4,49	8,68	-0,68	-0,78
2022	6,04	5,16	4,91	-2,85

Portafoglio 30/04/2026

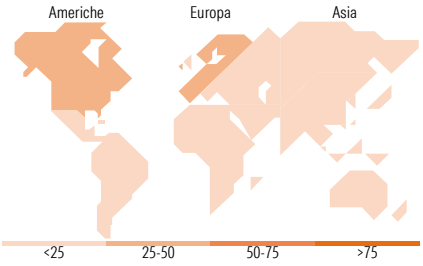


Asset Allocation %	Netta
Azioni	1,31
Obbligazioni	23,73
Liquidità	74,83
Altro	0,13

Fixed Income Style Box™



	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
Telefono	+352 27975130
Web	www.candriam.com
Data di Partenza	04/06/2021
Nome del Gestore	Steeve Brument
Data Inizio Gestione	16/11/2009
NAV (02/07/2026)	EUR 162,97
Patrimonio Netto (Mln) (30/04/2026)	146,33 EUR

Patrimonio Classe (Mln) (02/07/2026)	0,20 EUR
Domicilio	FRANCIA
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	FR0013202835

Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	1,85%
Spese correnti	1,86%
Commissione di incentivo	20,00%

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 prodotto; (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.

MORNINGSTAR