Candriam Diversified Futures N

Categoria Morningstar™

Alt - Systematic Futures

Benchmark Morningstar

Benchmark Dichiarato€STR capitalisé Jour TR EUR

Morningstar Rating™

**

Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR Usato nel Report

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 Rischi	0		
3Y Alpha	-6,13	3Y Sharpe Ratio	-0,61
3Y Beta	0,00	3Y Std Dev	10,18
3Y R-Squared	0,00	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-1,08	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	12,14	10Y Risk	-
Basati su Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)			



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,55	4,32	4,30	Trimestrali %				
6-Mesi	-2,12	9,62	6,46	2025	-7,53	-0,44	-0,55	-
1-Anno	-2,16	7,90	5,59	2024	2,05	-2,31	-3,86	2,40
3-Anni Ann.ti	-2,97	9,20	0,86	2023	-4,49	8,68	-0,68	-0,78
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	6,04	5,16	4,91	-2,85
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	-	-	-1,62	3,62
Rendimenti aggiornati al 27/10/20	025							

Portafoglio 31/07/2025



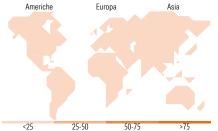


Fixed Income Sector Weightings %

Pondo

Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media B

Fondo



Titoli principali		
Nome	Settore	%
France (Republic Of)	_	11,52
Finland (Republic Of)	_	9,09
European Stability Mechanism	_	6,64
European Union	_	6,40
Belgium (Kingdom Of)	_	6,05
European Union	_	6,04
Austria (Republic of)	_	6,04
Spain (Kingdom of)	_	6,03
Candriam Monétaire SICAV Z C	_	4,68
Candriam L Multi-Asset	-	4,51
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		67,01
Numero Complessivo di Titoli Azionar	i	0
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	ionari	23

₩ Governativo	74,49
Societario	1,97
★ Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
🚅 Liquidità ed equivalenti	23,54
Derivati	0,01
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	97,08
	97,08 2,91
0 coupon	,
0 coupon Da 0 a 4 cedole	2,91
0 coupon Da 0 a 4 cedole Da 4 a 6 cedole	2,91 0,01
0 coupon Da 0 a 4 cedole Da 4 a 6 cedole Da 6 a 8 cedole	2,91 0,01 0,00

23	25 50	30 13	
Ripartizione Geo	ografica %		Fondo
America			0,00
Stati Uniti			-
Canada			-
America Latina e	Centrale		-
Europa			0,00
Regno Unito			=
Europa Occident	ale - Euro		=
Europa Occident	ale - Non Euro	ס	-
Europa dell'Est			-
Africa			-
Medio Oriente			-
Asia			0,00
Giappone			-
Australasia			-
Asia - Paesi Svilu	ıppati		-
Asia - Emergente)		-

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 (27/10/2025)	EUR 160,52
Patrimonio Netto (MIn)	164,02 EUR

Patrimonio Classe (Mln)	0,26 EUR
Domicilio	FRANCIA
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	FR0013202835

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