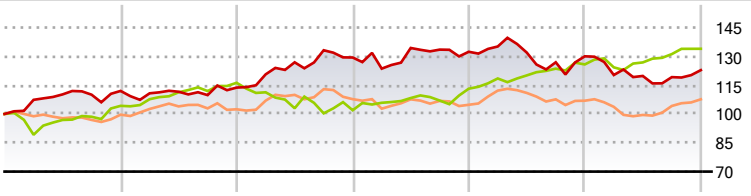
Candriam Diversified Futures Classique

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Alt - Systematic Futures	Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR Usato nel Report	€STR capitalisé Jour TR EUR	★★★★

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



2020	2021	2022	2023	2024	2025-12	
12,00	1,54	13,78	2,30	-1,79	-5,54	● Fondo
4,23	11,51	-12,28	10,99	11,17	6,48	● Benchmark e Indici
-0,07	2,56	7,19	-2,45	0,58	1,14	● Categoria

Misure di Rischio

3Y Alpha	-4,37	3Y Sharpe Ratio	-0,41
3Y Beta	0,03	3Y Std Dev	10,26
3Y R-Squared	0,03	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,96	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	11,72	10Y Risk	Med

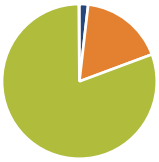
Basati su Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	6,93	1,28	2,99
6-Mesi	9,16	5,20	7,22
1-Anno	-1,72	6,19	6,51
3-Anni Ann.ti	-0,06	8,58	3,02
5-Anni Ann.ti	3,10	5,46	2,87
10-Anni Ann.ti	2,12	5,60	1,11

Rendimenti aggiornati al 29/01/2026

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-7,50	-0,39	-0,51	3,04
2024	2,08	-2,35	-3,82	2,45
2023	-4,50	8,72	-0,64	-0,84
2022	6,06	5,20	4,94	-2,82

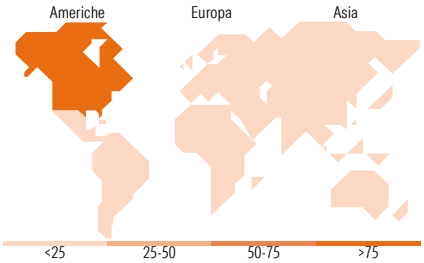
Portafoglio 30/11/2025



Asset Allocation %	Netta
● Azioni	1,82
● Obbligazioni	17,51
● Liquidità	80,53
● Altro	0,14

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	B



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
Telefono	+352 27975130
Web	www.candriam.com
Data di Partenza	16/11/2009
Nome del Gestore	Steeve Brument
Data Inizio Gestione	16/11/2009
NAV (29/01/2026)	EUR 13.044,94
Patrimonio Netto (Mln) (30/11/2025)	151,59 EUR
Patrimonio Classe (Mln) (28/01/2026)	9,54 EUR
Domicilio	FRANCIA
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	FR0010794792
Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	1,70%
Commissione di incentivo	20,00%

© 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.