

# 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

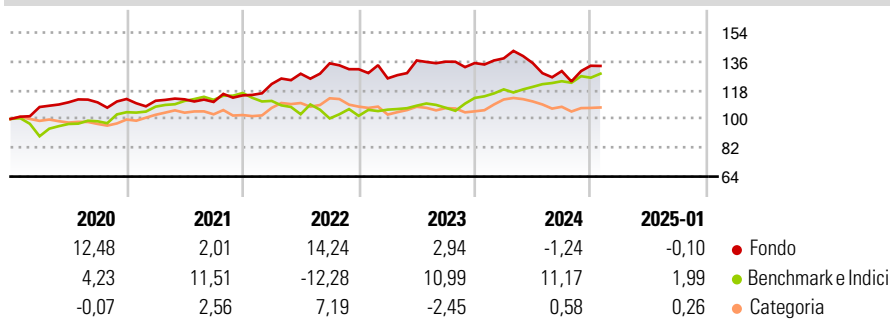
"Candriam Diversified Futures é un fondo UCITS che offre agli investitori professionisti un approccio di investimento sistematico di tipo quantitativo. Il fondo assumerà posizioni a lungo e a breve termine sulle principali asset classes (indici di borsa, tassi a breve termine, obbligazioni statali e 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	3,99	3Y Sharpe Ratio	0,29
3Y Beta	-0,42	3Y Std Dev	10,34
3Y R-Squared	11,28	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,05	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	15,50	10Y Risk	Med

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

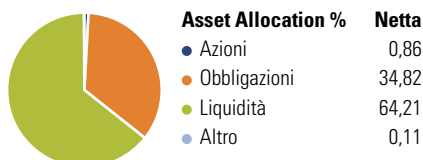
### Rendimenti



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	7,16	4,51	3,55	2025	-	-	-	-
6-Mesi	3,74	7,22	3,24	2024	2,19	-2,16	-3,70	2,58
1-Anno	-1,08	11,81	5,12	2023	-4,35	8,89	-0,53	-0,64
3-Anni Ann.ti	4,50	4,72	2,65	2022	6,17	5,30	5,05	-2,73
5-Anni Ann.ti	5,53	4,80	2,02	2021	-0,99	0,81	-1,45	3,70
10-Anni Ann.ti	2,89	4,86	0,54					

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

### Portafoglio 30/11/2024



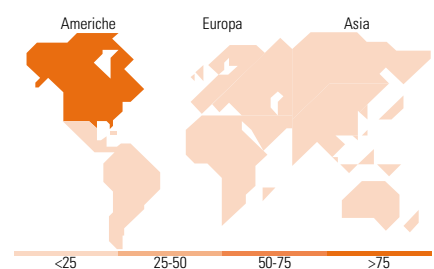
### Fixed Income

#### Style Box™


Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva  
Maturity effettiva  
Qualità Credito Media

### Fondo



### Titoli principali

Nome	Settore	%
Germany (Federal Republic Of)	—	9,57
France (Republic Of)	—	6,73
France (Republic Of)	—	6,34
European Stability Mechanism	—	6,34
European Stability Mechanism	—	6,33
Candriam Monétaire SICAV Z C	—	5,92
Spain (Kingdom of)	—	5,14
Belgium (Kingdom Of)	—	4,22
European Union	—	4,22
Finland (Republic Of)	—	4,21
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		59,00
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		19

### Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	62,80
Societario	1,32
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	35,79
Derivati	0,09

### Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	95,74
Da 0 a 4 cedole	4,03
Da 4 a 6 cedole	0,23
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
<b>America</b>	<b>86,40</b>
Stati Uniti	85,32
Canada	0,03
America Latina e Centrale	1,05
<b>Europa</b>	<b>1,52</b>
Regno Unito	0,11
Europa Occidentale - Euro	1,38
Europa Occidentale - Non Euro	0,01
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,02
<b>Asia</b>	<b>12,08</b>
Giappone	0,00
Australasia	11,96
Asia - Paesi Sviluppati	0,04
Asia - Emergente	0,07

### Anagrafica

Società di Gestione	Candriam	Patrimonio Classe (Mln)	106,42 EUR	Investimento Min. Ingresso	250.000 EUR
Telefono	+352 27975130	(03/02/2025)		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 (03/02/2025)	EUR 14.114,66	ISIN	FR0010813105		
Patrimonio Netto (Mln)	236,36 EUR				

(30/11/2024)