Candriam Diversified Futures I

Categoria Morningstar™
Alt - Systematic Futures

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

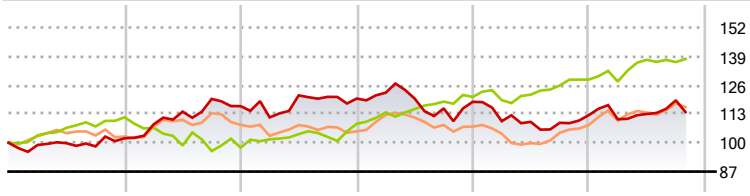
Benchmark Dichiarato
€STR capitalisé Jour TR EUR

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."

Rendimenti



	2021	2022	2023	2024	2025	2026-10
Fondo	2,01	14,24	2,94	-1,24	-5,07	1,22
Benchmark e Indici	11,51	-12,28	10,99	11,17	6,48	7,26
Categoria	2,56	7,19	-2,45	0,58	1,14	7,75

Misure di Rischio

3Y Alpha	-6,78	3Y Sharpe Ratio	-0,42
3Y Beta	0,33	3Y Std Dev	9,84
3Y R-Squared	4,13	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-1,23	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	10,50	10Y Risk	Med

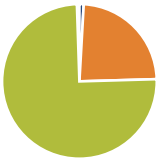
Basati su Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-1,08	-2,19	-0,17
6-Mesi	0,73	-0,20	-0,65
1-Anno	4,48	6,06	6,03
3-Anni Ann.ti	-1,32	8,71	5,10
5-Anni Ann.ti	1,87	3,65	2,06
10-Anni Ann.ti	2,21	5,35	1,44

Rendimenti aggiornati al 19/11/2026

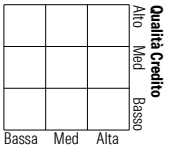
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-1,65	2,14	5,46	-
2025	-7,38	-0,27	-0,39	3,17
2024	2,19	-2,16	-3,70	2,58
2023	-4,35	8,89	-0,53	-0,64
2022	6,17	5,30	5,05	-2,73

Portafoglio 31/08/2026

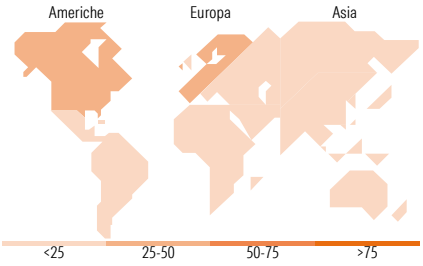


Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,89
Obbligazioni	23,65
Liquidità	74,94
Altro	0,52

Fixed Income Style Box™



	Fondo
Duration Effettiva	-8,93
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
France (Republic Of)	—	8,25
Belgium (Kingdom Of)	—	7,33
European Union	—	7,00
European Stability Mechanism	—	6,65
European Stability Mechanism	—	6,64
Finland (Republic Of)	—	6,59
Belgium (Kingdom Of)	—	6,31
Spain (Kingdom of)	—	5,98
Portugal (Republic Of)	—	5,63
Candriam L Alt Mlt Starts Z...	—	5,53
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		65,91
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		14

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	58,14
Societario	1,20
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	40,23
Derivati	0,42

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	94,61
Da 0 a 4 cedole	5,38
Da 4 a 6 cedole	0,01
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	**41,59**
Stati Uniti	41,55
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,04
Europa	**58,41**
Regno Unito	0,00
Europa Occidentale - Euro	45,76
Europa Occidentale - Non Euro	0,18
Europa dell'Est	12,47
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	**0,00**
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,00

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 (19/11/2026)	EUR 13.559,06
Patrimonio Netto (Mln) (31/08/2026)	150,01 EUR

Patrimonio Classe (Mln) (19/11/2026)	55,37 EUR
Domicilio	FRANCIA
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	FR0010813105

Investimento Min. Ingresso	250.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	1,19%
Spese correnti	1,20%
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