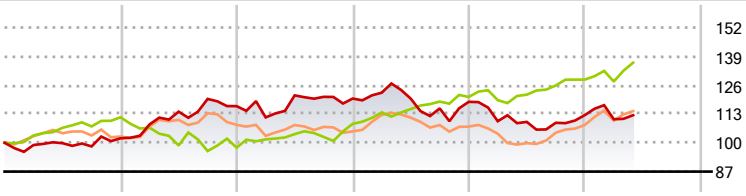
Candriam Diversified Futures I

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



2021	2022	2023	2024	2025	2026-05	
2,01	14,24	2,94	-1,24	-5,07	-0,02	Fondo
11,51	-12,28	10,99	11,17	6,48	5,94	Benchmark e Indici
2,56	7,19	-2,45	0,58	1,14	6,06	Categoria

Misure di Rischio

3Y Alpha	-5,54	3Y Sharpe Ratio	-0,30
3Y Beta	0,38	3Y Std Dev	9,93
3Y R-Squared	5,94	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-1,01	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	10,45	10Y Risk	Med

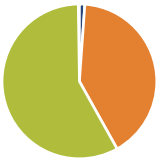
Basati su Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	1,25	7,45	5,89
6-Mesi	0,32	6,24	6,87
1-Anno	4,43	12,74	12,71
3-Anni Ann.ti	-1,97	9,92	6,09
5-Anni Ann.ti	2,19	5,11	2,28
10-Anni Ann.ti	2,30	5,97	1,31

Rendimenti aggiornati al 25/06/2026

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-1,65	-	-	-
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

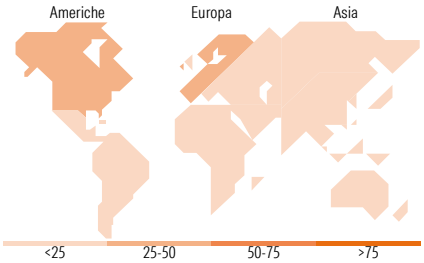
Portafoglio 31/03/2026



Asset Allocation %	Netta
Azioni	1,13
Obbligazioni	40,76
Liquidità	57,87
Altro	0,24

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	B



Titoli principali

Nome	Settore	%
Belgium (Kingdom Of)	—	12,24
Netherlands (Kingdom Of)	—	11,25
European Stability Mechanism	—	9,83
Finland (Republic Of)	—	8,17
European Union	—	7,11
France (Republic Of)	—	6,78
Spain (Kingdom of)	—	6,07
Candriam L Alt Mlt Starts Z...	—	5,47
Finland (Republic Of)	—	4,40
Candriam Monétaire SICAV Z C	—	3,97
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		75,29
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		18

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	80,04
Societario	1,34
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	18,70
Derivati	-0,08

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	96,79
Da 0 a 4 cedole	3,21
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	**46,98**
Stati Uniti	46,90
Canada	0,08
America Latina e Centrale	0,00
Europa	**53,02**
Regno Unito	0,03
Europa Occidentale - Euro	48,59
Europa Occidentale - Non Euro	0,00
Europa dell'Est	4,40
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 (25/06/2026)	EUR 13.496,30
Patrimonio Netto (Mln) (31/03/2026)	146,48 EUR
Patrimonio Classe (Mln) (25/06/2026)	89,37 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.	1,20%
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.