

Candriam Diversified Futures U

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

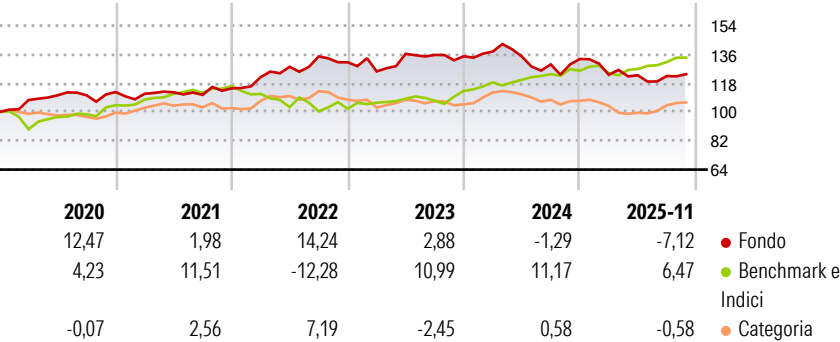
"Candriam Diversified Futures é un fondo UCITS che offre agli investitori professionisti un approccio di investimento sistematico di tipo quantitativo. Il fondo assumerà posizioni a lungo e a breve termine sulle principali asset classes (indici di borsa, tassi a breve termine, obbligazioni statali e 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	-4,56	3Y Sharpe Ratio	-0,43
3Y Beta	0,03	3Y Std Dev	10,15
3Y R-Squared	0,04	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,84	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	11,88	10Y Risk	-

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

Rendimenti



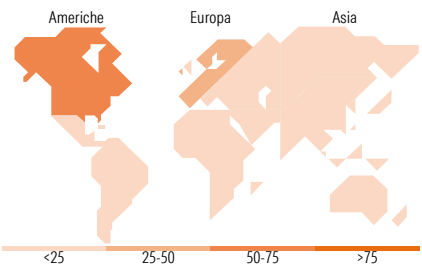
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	4,95	2,67	3,42	2025	-7,38	-0,26	-0,39	-
6-Mesi	2,77	5,23	4,24	2024	2,19	-2,21	-3,70	2,58
1-Anno	-3,90	4,71	2,55	2023	-4,35	8,82	-0,54	-0,61
3-Anni Ann.ti	-1,45	8,41	1,77	2022	6,17	5,30	5,05	-2,73
5-Anni Ann.ti	2,27	5,22	2,74	2021	-0,99	0,86	-1,45	3,63
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 08/12/2025

Portafoglio 30/09/2025



Fixed Income Style Box™	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	B
Qualità Credito	
Alto	
Med	
Basso	
Sensibilità ai Tassi	
Bassa	
Med	
Alta	



Titoli principali		
Nome	Settore	%
Austria (Republic of)	—	10,33
Finland (Republic Of)	—	9,42
France (Republic Of)	—	7,54
European Stability Mechanism	—	6,88
European Union	—	6,63
Belgium (Kingdom Of)	—	6,27
European Union	—	6,26
Spain (Kingdom of)	—	6,25
Candriam Monétaire SICAV Z C	—	4,85
Candriam L Multi-Asset...	—	4,79
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		69,24
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		18

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
■ Governativo	74,27
■ Societario	1,51
■ Cartolarizzazioni	0,00
■ Enti Locali	0,00
■ Liquidità ed equivalenti	23,99
■ Derivati	0,23
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	96,58
Da 0 a 4 cedole	3,42
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	63,22
Stati Uniti	63,02
Canada	0,12
America Latina e Centrale	0,08
Europa	31,67
Regno Unito	0,05
Europa Occidentale - Euro	31,58
Europa Occidentale - Non Euro	0,03
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	5,10
Giappone	5,03
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,03
Asia - Emergente	0,04

Anagrafica

Società di Gestione	Candriam	Patrimonio Classe (Mln)	3,16 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+352 27975130	(08/12/2025)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.candriam.com	Domicilio	FRANCIA	T.E.R.	-
Data di Partenza	25/01/2018	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 (08/12/2025)	EUR 192,40	ISIN	FR0013201886		
Patrimonio Netto (Mln)	158,78 EUR				

(30/09/2025)