

## Candriam Diversified Futures U

Categoria Morningstar™		Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™																																										
Alt - Systematic Futures		Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR	€STR capitalisé Jour TR EUR	★★★																																										
Usato nel Report																																														
<b>Obiettivo d'Investimento Dichiarato</b>																																														
<p>"Candriam Diversified Futures è 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 valute), 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."</p>																																														
<b>Misure di Rischio</b>																																														
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)																																														
<b>Rendimenti</b>																																														
2020	2021	2022	2023	2024																																										
12,47	1,98	14,24	2,88	-1,29																																										
4,23	11,51	-12,28	10,99	11,17																																										
				6,47																																										
				-7,12																																										
				0,58																																										
				-0,58																																										
				137																																										
				118																																										
				119																																										
				105																																										
				136																																										
				137																																										
				118																																										
				100																																										
				82																																										
				64																																										
<b>Rend. Cumulati %</b> <b>Fondo</b> <b>Bmk</b> <b>Cat</b> <b>Rendimenti Trimestrali %</b> <b>Q1</b> <b>Q2</b> <b>Q3</b> <b>Q4</b>																																														
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																																														
<b>Portafoglio 30/09/2025</b>																																														
		<b>Asset Allocation %</b>	<b>Netta</b>	<b>Fixed Income Style Box™</b> <table border="1"> <tr> <td></td><td></td><td></td><td></td><td></td> </tr> </table> <b>Qualità Credito</b> <table border="1"> <tr> <td>Bassa</td><td>Med</td><td>Alto</td> </tr> <tr> <td>Med</td><td></td><td></td> </tr> <tr> <td>Alta</td><td></td><td></td> </tr> <tr> <td></td><td></td><td>Basso</td> </tr> </table> Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media																														Bassa	Med	Alto	Med			Alta					Basso	<b>Fondo</b>
Bassa	Med	Alto																																												
Med																																														
Alta																																														
		Basso																																												
<b>Ripartizione Geografica %</b> <b>Fondo</b>					Americhe	Europa	Asia																																							
<b>America</b> <b>Fondo</b>								<b>63,22</b>																																						
Stati Uniti					25-50	50-75	>75	63,02																																						
Canada					<25			0,12																																						
America Latina e Centrale								0,08																																						
<b>Europa</b> <b>Fondo</b>								<b>31,67</b>																																						
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																																						
<b>Asia</b> <b>Fondo</b>								<b>5,10</b>																																						
Giappone								5,03																																						
Australasia								0,00																																						
Asia - Paesi Sviluppati								0,03																																						
Asia - Emergente								0,00																																						
<b>Anagrafica</b>																																														
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.R.E.																																								
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)																																														