

Candriam Diversified Futures N

Categoria Morningstar™

Alt - Systematic Futures

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

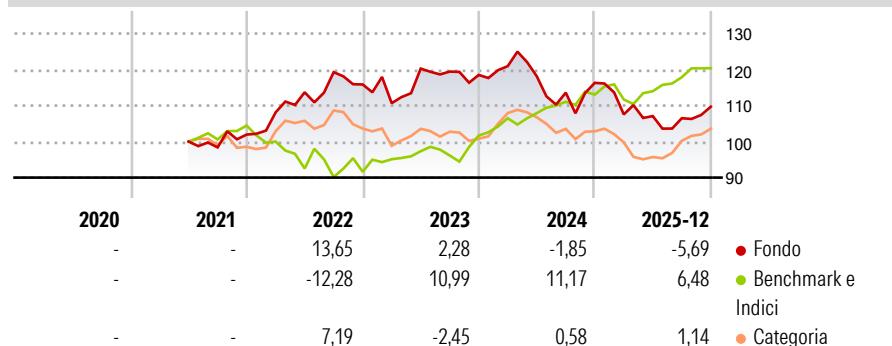
€STR capitalisé Jour TR EUR

Morningstar Rating™

★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

"Candriam Diversified Futures 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 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

Misure di Rischio

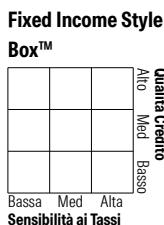
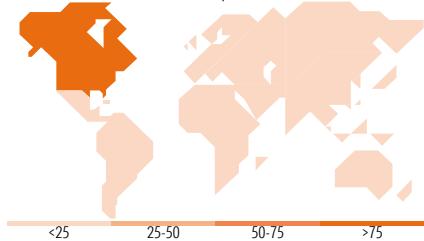
3Y Alpha	-4,47	3Y Sharpe Ratio	-0,42
3Y Beta	0,03	3Y Std Dev	10,24
3Y R-Squared	0,03	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,97	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	11,69	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %
Fondo
Bmk
Cat
Rendimenti Trimestrali %
Q1
Q2
Q3
Q4
3-Mesi
5,96
1,28
2,99
6-Mesi
8,30
5,20
7,22
1-Anno
-1,81
6,19
6,51
3-Anni Ann.ti
-0,23
8,58
3,02
5-Anni Ann.ti
-
-
-
10-Anni Ann.ti
-
-
-

Rendimenti aggiornati al 28/01/2026

Portafoglio 30/11/2025

Fixed Income Style Box™
Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media
Fondo
Americhe
Europa
Asia

Titoli principali

Nome	Settore	%
Austria (Republic of)	-	10,85
Finland (Republic Of)	-	7,85
European Stability Mechanism	-	7,23
European Union	-	6,97
Belgium (Kingdom Of)	-	6,59
European Union	-	6,58
France (Republic Of)	-	6,57
Spain (Kingdom of)	-	6,57
Candriam L Alt Mlt Starts Z...	-	5,07
Belgium (Kingdom Of)	-	4,28
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		68,56
Numeri Complessivo di Titoli Azionari	0	
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari	15	

Fixed Income Sector Weightings %

Governativo	56,87
Societario	1,54
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	41,13
Derivati	0,45

Coupon Range %

Fondo	
0 coupon	92,02
Da 0 a 4 cedole	7,98
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	77,68
Stati Uniti	77,60
Canada	0,02
America Latina e Centrale	0,05
Europa	19,52
Regno Unito	0,03
Europa Occidentale - Euro	19,36
Europa Occidentale - Non Euro	0,12
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,01
Medio Oriente	0,00
Asia	2,80
Giappone	2,74
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,05
Asia - Emergenti	0,01

Anagrafica

Società di Gestione	Candriam
Telefono	+352 27975130
Web	www.candriam.com
Data di Partenza	04/06/2021
Nome del Gestore	Steeve Brument
Data Inizio Gestione	16/11/2009
NAV (28/01/2026)	EUR 169,53
Patrimonio Netto (Mln)	151,59 EUR

(30/11/2025)

Patrimonio Classe (Mln)
(28/01/2026)
Domicilio
Valuta del Fondo
UCITS
Inc/Acc
ISIN
FR0013202835

0,26 EUR
FRANCIA
EUR
Si
Acc

Investimento Min. Ingresso
Investimento Min. Successivo
T.E.R.
Spese correnti
Commissione di incentivo

-
-
-
1,86%
20,00%