

# 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

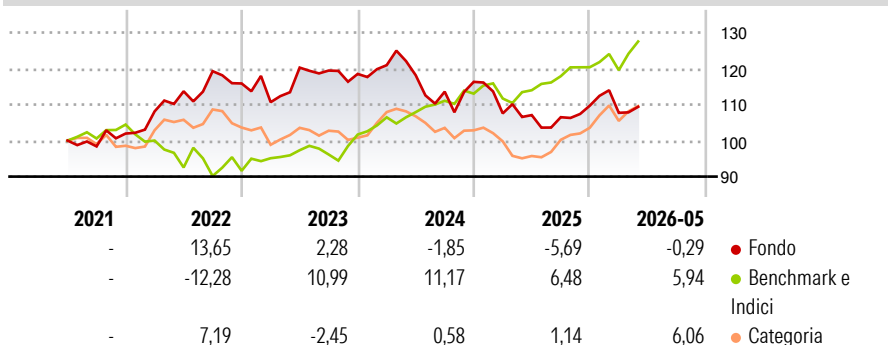
"Candriam Diversified Futures é un fondo UCITS che offre agli investitori professionisti un approccio di investimento sistematico di tipo quantitativo. Il fondo assumerà posizioni a lungo e a breve termine sulle principali asset classes (indici di borsa, tassi a breve termine, obbligazioni statali e 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	-6,19	3Y Sharpe Ratio	-0,36
3Y Beta	0,38	3Y Std Dev	9,92
3Y R-Squared	5,93	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-1,07	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	10,45	10Y Risk	-

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

### Rendimenti



### Rend. Cumulati %

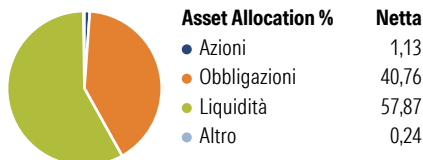
	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	1,08	7,45	5,89
6-Mesi	-0,01	6,24	6,87
1-Anno	3,75	12,74	12,71
3-Anni Ann.ti	-2,59	9,92	6,09
5-Anni Ann.ti	1,57	5,11	2,28
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 25/06/2026

### Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-1,81	-	-	-
2025	-7,53	-0,44	-0,55	3,00
2024	2,05	-2,31	-3,86	2,40
2023	-4,49	8,68	-0,68	-0,78
2022	6,04	5,16	4,91	-2,85

### Portafoglio 31/03/2026



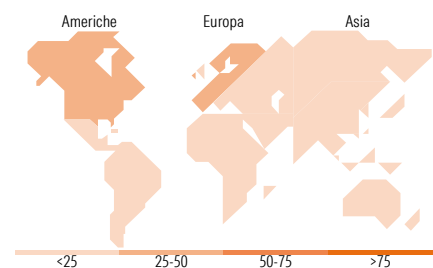
### Fixed Income Style

#### Box™

Qualità Credito	Alto	Medio	Basso
Alta			
Med			
Bassa			

Sensibilità ai Tassi

	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
<b>America</b>	<b>46,98</b>
Stati Uniti	46,90
Canada	0,08
America Latina e Centrale	0,00
<b>Europa</b>	<b>53,02</b>
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
<b>Asia</b>	<b>0,00</b>
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,00

### Anagrafica

Società di Gestione	Candriam	Patrimonio Classe (Mln)	0,20 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+352 27975130	(25/06/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.candriam.com	Domicilio	FRANCIA	T.E.R.	1,85%
Data di Partenza	04/06/2021	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	1,86%
Nome del Gestore	Steeve Brument	UCITS	Si	Commissione di incentivo	20,00%
Data Inizio Gestione	16/11/2009	Inc/Acc	Acc		
NAV (25/06/2026)	EUR 163,43	ISIN	FR0013202835		
Patrimonio Netto (Mln)	146,48 EUR				

(31/03/2026)

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 prodotte; (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.