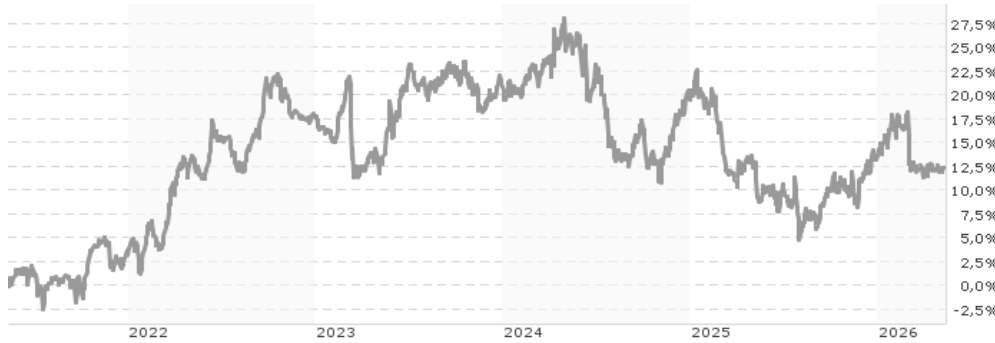


Candriam Diversified Futures, R - Capitalisation / FR0013305190 / A2PGKZ / Candriam

Aktuell 11.05.2026 ¹	Region	Branche	Ausschüttungsart	Typ
167,50 EUR	weltweit	AI Managed Futures	thesaurierend	Alternative Investm.



Risikokennzahlen

SRI	1	2	3	4	5	6	7
-----	---	---	---	---	----------	---	---

Jahresperformance

2025	-5,07%
2024	-1,18%
2023	+2,95%
2022	+13,98%

Performanceergebnisse der Vergangenheit lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Entwicklung zu.

Stammdaten		Konditionen		Sonstige Kennzahlen	
Fondart	Einzelfond	Ausgabeaufschlag	0,60%	Mindestveranlagung	EUR 0,00
Kategorie	Alternative Investments	Managementgebühr	1,20%	Sparplan	Nein
Fondsunterkategorie	AI Managed Futures	Depotgebühr	-	UCITS / OGAW	Ja
Ursprungsland	Frankreich	Tilgungsgebühr	0,00%	Gewinnbeteiligung	20,00%
Tranchenvolumen	(11.05.2026) EUR 466064,220	Sonstige lfd. Kosten (15.04.2026)	1,20%	Umschichtgebühr	-
Gesamt-Fondsvolumen	(11.05.2026) EUR 146,84 Mio.	Transaktionskosten	1,20%	Fondsgesellschaft	
Auflegedatum	16.11.2009	Candriam			
KESSt-Meldefonds	Ja	19-21 route d'Arlon, 8009, Strassen			
Beginn des Geschäftsjahres	01.01.	Luxemburg			
Nachhaltigkeitsfondsart	-	www.candriam.com			
Fondsmanager	Steeve Brument				
	Johann Mauchand, Roland Juhel				
Thema	-				

Performance	1M	6M	YTD	1J	2J	3J	5J	seit Beginn
Performance	-0,31%	+0,38%	-1,09%	+2,91%	-10,84%	-0,36%	+11,71%	+11,79%
Performance p.a.	-	-	-	+2,91%	-5,59%	-0,12%	+2,24%	+2,16%
Performance p.a. nach max. AGA	-	-	-	+1,89%	-6,05%	-0,45%	+2,04%	+1,96%
Sharpe Ratio	-1,60	-0,17	-0,61	0,08	-0,86	-0,27	0,00	-0,01
Volatilität	3,88%	8,76%	8,63%	8,80%	9,08%	8,86%	8,45%	8,46%
Schlechtester Monat	-	-5,44%	-5,44%	-5,44%	-5,44%	-5,44%	-6,15%	-6,15%
Bester Monat	-	+2,55%	+2,55%	+2,83%	+5,25%	+6,10%	+6,10%	+6,10%
Maximaler Verlust	-0,69%	-5,81%	-5,81%	-5,86%	-17,13%	-18,11%	-18,11%	-18,11%

Vertriebszulassung

Österreich, Deutschland, Schweiz;

1. Wichtiger Hinweis zum Aktualisierungsstand: Das angegebene Datum bezieht sich ausschließlich auf die Berechnung des NAV.

RISIKOHINWEISE: Die Informationen auf dieser Seite dienen ausschließlich zu Informationszwecken und sollten weder als Verkaufsangebot noch als Aufforderung zum Kauf des Wertpapiers oder einer Empfehlung zugunsten des Wertpapiers verstanden werden. Die baha GmbH und die BAWAG P.S.K. Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse Aktiengesellschaft übernehmen trotz sorgfältigster Recherche keinerlei Haftung für die Richtigkeit der angegebenen Daten.
Factsheet erstellt von: www.baha.com am 12.05.2026 17:54

Candriam Diversified Futures, R - Capitalisation / FR0013305190 / A2PGKZ / Candriam

Investmentstrategie

Die Portfolioverwaltung stützt sich auf eine vorsichtige Strategie, bei der Anleihen und Geldmarktinstrumente eingesetzt werden, und auf eine dynamische Strategie. Die dynamische Strategie beruht auf systematischen Strategien auf Basis von quantitativen Modellen, aus denen Kauf- oder Verkaufssignale für Vermögenswerte abgeleitet werden können. Zurzeit werden drei Strategien angewendet, die kaum miteinander korrelieren: * die Hauptstrategie - als Trendfolgestrategie bezeichnet -, die auf statistischen und technischen Analysen beruht, mit deren Hilfe die besten Markttrends unabhängig von den Erwartungen auf diesen Märkten bestimmt werden sollen, * eine gegenläufige Strategie, die gegen die Haupttrends setzt, indem sie aus übermäßigen Auf- und Abwärtsentwicklungen der Märkte profitiert, * und schließlich ein Formerkennungsmodell, bei dem mit Hilfe einer statistischen Analyse festgestellt werden soll, ob sich die aktuellen Bewegungen der Märkte bereits zu einem früheren Zeitpunkt ereignet haben. Das Eingehen von Positionen wird bei dieser Strategie davon abhängig gemacht, ob dies in der Vergangenheit profitabel gewesen wäre. Der Fonds hat kein nachhaltiges Anlageziel und bewirbt ökologische und/oder soziale Merkmale nicht ausdrücklich.

Fondsspezifische Informationen

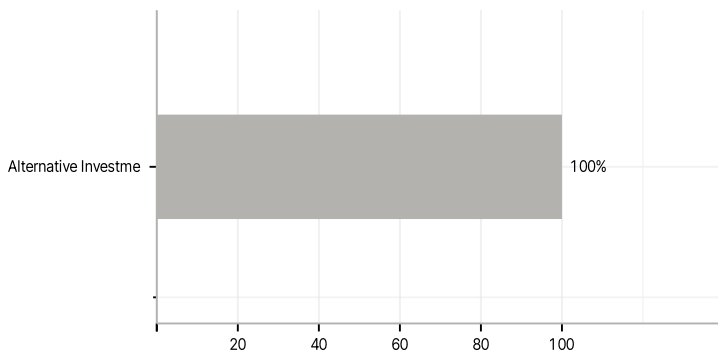
Im Rahmen der Anlagestrategie kann überwiegend in Einlagen investiert werden. Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Die Fondsbestimmungen des Candriam Diversified Futures, R - Capitalisation wurden durch die FMA bewilligt. Der Candriam Diversified Futures, R - Capitalisation kann mehr als 35 % des Fondsvermögens in Wertpapiere/Geldmarktinstrumente folgender Emittenten investieren: von einem Mitgliedstaat des Europäischen Wirtschaftsraums (»EWR«) oder dessen öffentlichen Gebietskörperschaften oder von einer internationalen Einrichtung öffentlich-rechtlichen Charakters, der mindestens ein Mitgliedstaat des EWR angehört, begeben oder garantiert werden.

Investmentziel

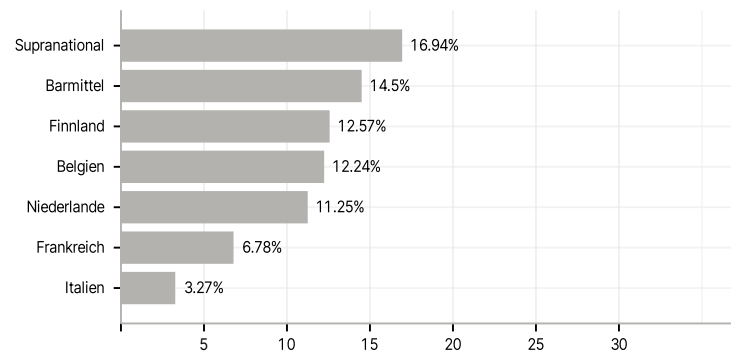
Über die empfohlene Anlagedauer strebt der Fonds im Rahmen seines systematischen Managements unter normalen Marktbedingungen durch Investitionen in die wesentlichen Anlagen eine höhere absolute Performance als €STR (Euro Short Term Rate) Capitalized und eine annualisierte Volatilität (Indikator für Auf- oder Abwärtsschwankungen des Fondswerts) von weniger als 12 % an.

Veranlagungsstruktur

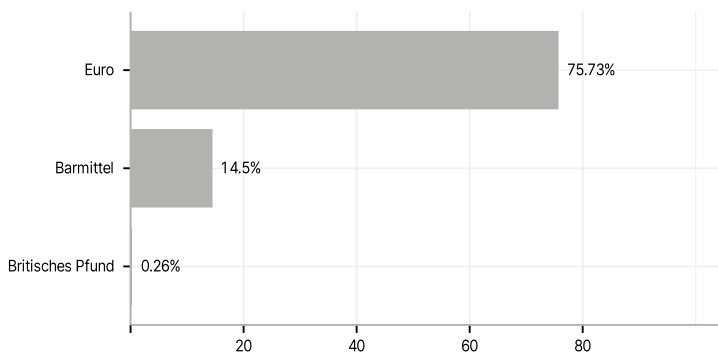
Anlagearten



Länder



Währungen



Größte Positionen

