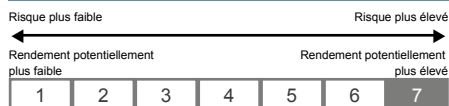


Candriam Diversified Futures

Classe: Instit. (EUR)

Overall Morningstar Rating™ : ★★★★★

PROFIL DE RISQUE/RENDEMENT



Le niveau de risque mentionné reflète la volatilité de l'historique du Fonds, éventuellement complété de celui de son cadre de référence. La volatilité indique dans quelle mesure la valeur du Fonds peut fluctuer à la hausse comme à la baisse.

- La catégorie affichée pourra évoluer dans le temps.
- Les données historiques ne présagent pas du profil de risque futur.
- La catégorie la plus faible ne signifie pas "sans risque".
- Il n'existe ni garantie ni mécanisme de protection de capital.

DONNÉES STATISTIQUES*

	1 an	3 ans	Création
Corrélation JPM GBI EMU EUR	-0.26	0.20	0.31
Corrélation MSCI Europe EUR PI	0.78	0.12	-0.01
Volatilité (%)	9.81	8.30	9.22
Ratio de Sharpe	0.43	1.23	0.20
Meilleure perf. Mensuelle (%)	4.52	8.47	8.84
Moins bonne perf. Mensuelle (%)	-2.01	-3.42	-6.12
Max Drawdown (%)	-4.72	-6.86	-25.14
Délai de recouvr. (jours)	88.00	95.00	584.00

*Performance vs. Eonia

PERFORMANCES EN EUR (%)

Cumulées	Fonds	Indice	Δ
1 mois	0.89	-0.04	0.93
3 mois	2.41	-0.14	2.55
6 mois	3.52	-0.26	3.78
YTD	1.15	-0.09	1.24
1 an	7.56	-0.51	8.06
3 ans	32.22	-1.38	33.60
5 ans	18.73	-2.10	20.82
Début	23.82	-	-

STRATÉGIE D'INVESTISSEMENT

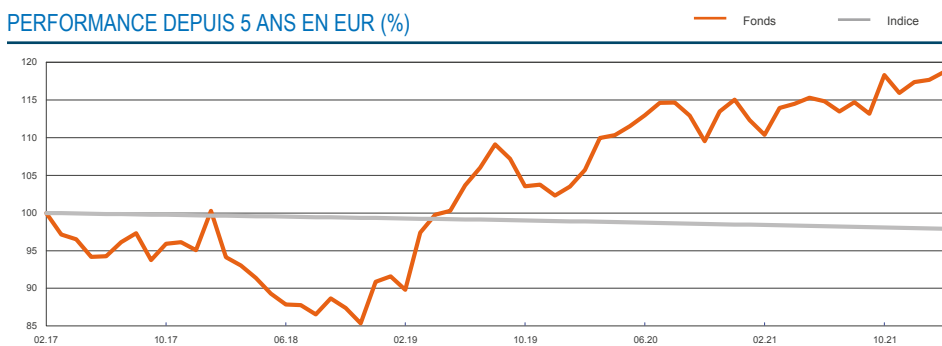
Candriam Diversified Futures est un fonds UCITS qui offre aux investisseurs une approche d'investissement systématique et quantitative. Il intervient à l'achat comme à la vente sur les principales classes d'actifs (indices actions, taux courts, taux longs et devises), en fonction des signaux générés par les trois principales stratégies mises en œuvre dans le fonds : suivi des tendances, retournement de tendance et reconnaissance de forme. L'excédent de liquidité dans le fonds est investi dans des titres du marché monétaire à court terme bénéficiant d'une bonne notation.

Depuis le 9 Mai 2012, la stratégie d'investissement ainsi que l'objectif de volatilité ont changé de façon significative.

Le fonds est géré de manière active, en référence à l'indice mentionné à la page 2. Pour plus d'informations sur la définition de cet indice et son utilisation, veuillez consulter le DICI du fonds.

HORIZON D'INVESTISSEMENT: 3 ANS

PERFORMANCE DEPUIS 5 ANS EN EUR (%)

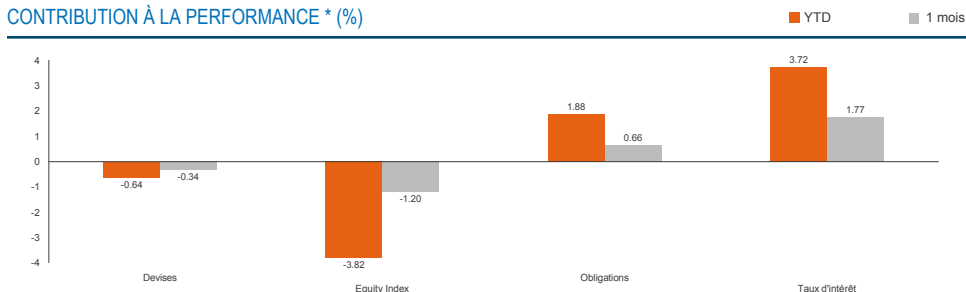


Toutes les performances passées présentées sur cette page ne présagent pas des performances futures et ne sont pas constantes dans le temps. Les VNI sont fournies par la comptabilité et les indices par des data providers officiels.

PERFORMANCES MENSUELLES & ANNUELLES (%)

ANNÉE	Jan	Fév	Mars	Avril	Mai	Juin	Juill	Août	Sept	Oct	Nov	Déc	ANNUELLES
2018	5.47	-6.12	-1.16	-1.80	-2.26	-1.63	-0.10	-1.37	2.45	-1.45	-2.33	6.48	-4.42
2019	0.80	-1.97	8.47	2.44	0.51	3.39	2.25	2.92	-1.75	-3.42	0.22	-1.39	12.59
2020	1.14	2.14	4.02	0.36	1.08	1.26	1.49	0.03	-1.52	-3.01	3.62	1.39	12.46
2021	-2.38	-1.74	3.21	0.51	0.71	-0.40	-1.20	1.07	-1.31	4.52	-2.01	1.25	2.01
2022	0.26	0.89											1.15

CONTRIBUTION À LA PERFORMANCE * (%)



*contribution à la performance nette après déduction des frais.

FOR PROFESSIONAL INVESTORS ONLY

Au cas où la performance est exprimée dans une autre devise que celle en vigueur dans le pays de résidence de l'investisseur, les rendements pourraient augmenter ou diminuer en raison des fluctuations de la devise. Candriam recommande aux investisseurs de consulter sur son site www.candriam.com les informations clés pour l'investisseur, le prospectus et tout autre information pertinente avant d'investir dans un de ses fonds y inclue la valeur liquidative des fonds. Ces informations sont disponibles en anglais ou dans une langue nationale pour chaque pays où le fonds est autorisé à la commercialisation.

Candriam Diversified Futures

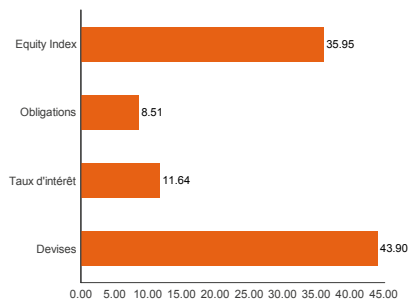
Classe: Instit. (EUR)

Overall Morningstar Rating™ : ★★★★★

CARACTÉRISTIQUES

Date de création	16.11.2009
Forme juridique	FCP de droit français (UCITS IV)
Indice de référence	ESTR Capi
Commission de gestion (max. en %)	1.20
Type de part(s)	Cap
Total actif net (M EUR)	242.33
VNI par action cap. (EUR)	12382.15
Devise de valorisation	EUR
Valorisation	Quotidienne (J)
ISIN Code	C FR0010813105
Ticker Bloomberg	C DEXDIFI FP Equity
Ticker Reuters	C FR0010813105.LUF

DÉPOSIT PAR CAT. DE FUTURES (%)



ANALYSE DU RISQUE

	01.2022	02.2022
Var (99% / 1 journée) (%)	-2.28	-1.54
Margin to equity (%) (1)	7.22	5.38

COMMENTAIRE DU GESTIONNAIRE

Les commentaires sur ce fonds sont disponibles sur le site internet www.candriam.com

INFORMATIONS PRATIQUES

Heure limite de réception des ordres	J avant 12h
Date de règlement de souscription	J+3
Date de règlement de rachat	J+3
Commission de surperformance (%)	20% de perf. > Obj.



Catégorie Morningstar™ : EAA Fund Systematic
(01.2022) Trend EUR

© 2007 Morningstar, Inc. Tous droits réservés. Certaines informations contenues dans ce document sont la propriété de Morningstar et/ou de ses fournisseurs d'informations. Elles sont présentées sans garantie d'exactitude, d'exhaustivité ou d'actualité. Il est interdit de les reproduire et de les redistribuer.

FOR PROFESSIONAL INVESTORS ONLY

Ce document est publié pour information uniquement, il ne constitue pas une offre d'achat ou de vente d'instruments financiers, ni un conseil en investissement et ne confirme aucune transaction, sauf convention contraire expresse. Bien que Candriam sélectionne soigneusement les données et sources utilisées, des erreurs ou omissions ne peuvent pas être exclues a priori. Candriam ne peut être tenue responsable de dommages directs ou indirects résultant de l'utilisation de ce document. Les droits de propriété intellectuelle de Candriam doivent être respectés à tout moment; le contenu de ce document ne peut être reproduit sans accord écrit préalable.