

Candriam Diversified Futures, I - Capitalisation (FR0010813105)

KAG: Candriam

ISIN: FR0010813105

Rücknahmepreis: 13399,20 EUR

Stand: 07.11.2024

Auflagedatum	16.11.09
Ausgabeaufschlag	1,00%
Konditionsdetails auf www.easybank.at	
Fondsvolumen	230.74 Mio.
Ertragstyp	thesaurierend
Letzte Ausschüttung	keine
Anlageregion	weltweit
Fondstyp	AI Managed Futures
Fondsmanager	Steeve Brument, Johann...
Kapitalanlagegesellschaft	
Candriam	
19-21 route d'Arlon	
8009 Strassen	
Luxemburg	
www.candriam.com	



Wertentwicklung*		1J	3J p.a.	5J p.a.
Performance	vor AGA	-6,43%	+2,57%	+4,35%
Performance	nach max. AGA	-7,35%	+2,23%	+4,14%
Kennzahlen*		1J	3J	5J
Sharpe Ratio		-1,03	-0,06	0,17
Volatilität		+9,23%	+8,49%	+7,92%

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

Fondsstrategie

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.

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.

Kommentar:

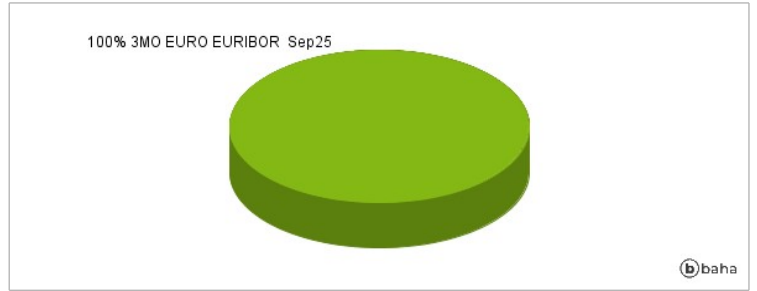
Fondsspezifische Information

Im Rahmen der Anlagestrategie kann überwiegend in Einlagen investiert werden. Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Aufgrund der Zusammensetzung des Fonds oder der verwendeten Managementtechniken weist der Fonds eine erhöhte Volatilität auf, d.h. die Anteilswerte sind auch innerhalb kurzer Zeiträume großen Schwankungen nach oben und nach unten ausgesetzt, wobei auch Kapitalverluste nicht ausgeschlossen werden können. Die Fondsbestimmungen des Candriam Diversified Futures, I - Capitalisation wurden durch die FMA bewilligt. Der Candriam Diversified Futures, I - Capitalisation kann mehr als 35 % des Fondsvermögens in Wertpapiere/Geldmarktinstrumente folgender Emittenten investieren: Mitgliedstaat des Europäischen Wirtschaftsraums (»EWR«) oder dessen öffentlichen Gebietskörperschaften oder von einer internationalen Einrichtung öffentlich-rechtlichen Charakters, der mindestens ein Mitgliedstaat des EWR angehört.

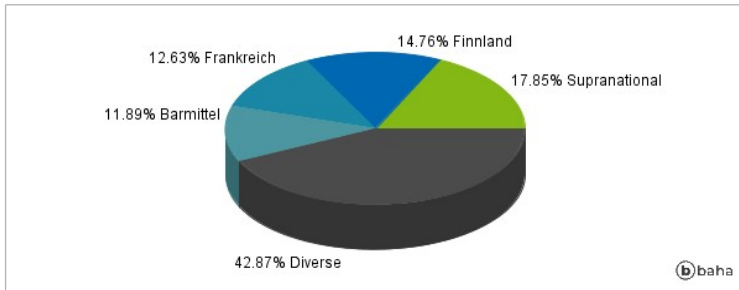
Anlagearten



Größte Positionen



Länderverteilung



Branchenverteilung



Historische Daten: 11/2024

Erstellt: 10.11.2024 02:28