

WESENTLICHE ANLEGERINFORMATIONEN

Gegenstand dieses Dokuments sind wesentliche Informationen für den Anleger über diesen Fonds. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen die Wesensart dieses Fonds und die Risiken einer Anlage in diesen zu erläutern. Wir raten Ihnen zur Lektüre dieses Dokuments, so dass Sie eine fundierte Anlageentscheidung treffen können.

Candriam Diversified Futures, FCP

Anteile I - Thesaurierung: FR0010813105

Zuständige Behörde: Autorité des Marchés Financiers

Verwaltungsgesellschaft: Candriam

ZIELE UND ANLAGEPOLITIK

Anlageziel: Der Dachfonds ist darauf ausgerichtet, innerhalb der empfohlenen Anlagedauer und im Rahmen der systematischen Portfolioverwaltung unter normalen Marktbedingungen bei einer annualisierten Volatilität (Kennziffer zur Messung der Schwankungen des Fondswertes nach oben und nach unten) von weniger als 12 % durch die Anlage in die angegebenen wesentlichen Anlagekategorien eine absolute Performance über dem kapitalisierten €STR zu erzielen.

Benchmark: €STR kapitalisiert

Der Fonds wird aktiv verwaltet, und der Anlageprozess impliziert die Angabe einer Benchmark.

Verwendung der Benchmark:

– für die Berechnung der Performancegebühr für bestimmte Anteilsklassen,

– zu Zwecken des Performancevergleichs.

Anlagestrategie:

Die Portfolioverwaltung stützt sich auf eine vorsichtige Basisstrategie, bei der Anleihen und Geldmarktinstrumente eingesetzt werden, und eine dynamische Strategie.

Die Portfolioverwaltung stützt sich auf eine vorsichtige Basisstrategie, bei der Anleihen und Geldmarktinstrumente eingesetzt werden, und eine dynamische Strategie.

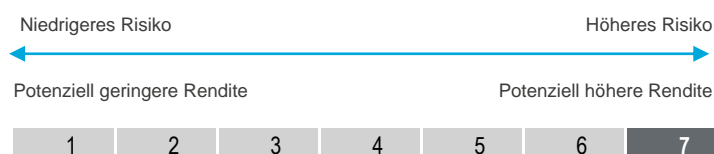
Die dynamische Strategie beruht auf systematischen Strategien, die quantitative Modelle heranziehen, mit denen Kauf- oder Verkaufssignale für die einzelnen Vermögenswerte generiert werden können. Zurzeit werden drei Strategien angewendet, die kaum miteinander korrelieren:

* die Trendfolgestrategie, die die wichtigste Strategie darstellt und auf statistischen und technischen Analysen beruht, um unabhängig von den Prognosen für diese Märkte die aussichtsreichsten Markttendenzen zu erkennen;

* eine Contrarian-Strategie, die antizyklisch investiert und dabei von Über- und Untertreibungen an den Märkten profitiert; und

* ein Verfahren zur Mustererkennung, das auf einer kurzfristigen statistischen Analyse beruht mit dem Ziel zu bestimmen, ob die jüngsten Marktbewegungen schon früher einmal stattgefunden haben. Das

RISIKO- UND ERTRAGSPROFIL



• Das Risikoprofil stellt den höchsten Wert zwischen der historischen Wertschwankung des Fonds auf der einen Seite und der Wertschwankung, die der für den Fonds festgelegten Risikobeschränkung entspricht, auf der anderen Seite dar. Die Volatilität gibt an, in welchem Maße der Wert des Fonds nach oben und unten schwanken kann.

• Dieses Risikoniveau 7 ist im Wesentlichen auf die Ausrichtung auf das Aktien-, Zins- und Währungsrisiko zurückzuführen.

• Die historischen Daten, wie die, die zur Berechnung des synthetischen Indikators verwendet werden, begründen keine verlässliche Aussage über das künftige Risikoprofil des OGA.

• Die angegebene Einstufung kann sich im Laufe der Zeit verändern.

• Die niedrigste Risikokategorie kann nicht mit einer risikolosen Anlage gleichgesetzt werden.

• Für diesen Fonds gibt es keinerlei Kapitalgarantie oder Kapitalschutzmechanismen.

Mit dem Fonds sind folgende wichtigen Risiken verbunden, die in dem angegebenen Risikoindikator nicht berücksichtigt sind:

• **Arbitragerisiko:** Der Fonds kann ein Verfahren einsetzen, mit dem Unterschiede zwischen den notierten (oder erwarteten) Kursen zweier Wertpapiere/Sektoren/Märkte/Währungen nutzt. Eine nachteilige Entwicklung solcher Arbitragepositionen (d. h. steigende Kurse bei Short-

Eingehen von Positionen wird bei dieser Strategie davon abhängig gemacht, ob dies in der Vergangenheit profitabel gewesen wäre.

Diese Anteilsklasse wird über den Einsatz von Derivaten systematisch gegen das Währungsrisiko abgesichert.

Der Fonds hat kein nachhaltiges Anlageziel und bewirbt ökologische und/oder soziale Merkmale nicht ausdrücklich.

Das Fondsmanagement kann Derivate, wie Futures, Optionen und Devisentermingeschäfte, einsetzen – insbesondere auf Zinsen, Staatsanleihen, Börsenindizes und Devisen. Darüber hinaus können Total Return Swap-Kontrakte oder andere derivative Finanzinstrumente eingesetzt werden, die dieselben Eigenschaften bieten. Derivate werden zu Zwecken der Exposition (Long oder Short), Absicherung oder Arbitrage eingesetzt.

Wesentliche Anlagekategorien:

Aktien-, Volatilitäts-, Zins- und Währungsindizes über Derivate (Futures und Optionen).

Im Rahmen der Basisstrategie: Anleihen, sonstige verbriefte Schuldtitel und Geldmarktinstrumente von Emittenten aller Kategorien, die zum Zeitpunkt des Erwerbs von einer Ratingagentur mit einem kurzfristigen Rating von mindestens A-2 (oder gleichwertig) eingestuft werden (d. h. von Emittenten mit sehr guter Bonität).

Häufigkeit der Rücknahmen: Auf Anfrage, täglich, in Frankreich.

Anträge werden bis 12 Uhr bei der CACEIS BANK angenommen und werden innerhalb von drei Geschäftstagen (T+3) abgewickelt.

Ergebnisverwendung: Thesaurierung.

Empfehlung: Dieser Fonds eignet sich möglicherweise nicht für Anleger, die ihr Kapital innerhalb des folgenden Zeitraums aus dem Fonds entnehmen möchten: binnen 3 Jahren.

oder fallende Kurse bei Long-Engagement) kann dazu führen, dass der Nettoinventarwert des Fonds sinkt.

• **Ausfallrisiko:** Der Fonds kann außerbörslich gehandelte Derivate und/oder Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung einsetzen. Diese Produkte und/oder Techniken können mit einem Ausfallrisiko verbunden sein (d. h. mit dem Risiko, dass ein Kontrahent nicht in der Lage ist, seine Verpflichtungen gegenüber dem Fonds zu erfüllen). Dieses Ausfallrisiko kann durch den Erhalt von Sicherheiten möglicherweise ganz oder teilweise abgesichert werden.

• **Risiko in Verbindung mit derivativen Finanzinstrumenten:** Ihre Verwendung birgt ein Risiko in Verbindung mit den jeweiligen Basiswerten. Die dem Derivat inhärente Hebelwirkung kann das Abwärtsrisiko verstärken. Darüber hinaus besteht das Risiko einer Fehlbewertung.

• **Schwellenmarktrisiken:** In Schwellenländern können politische, rechtliche und steuerliche Unsicherheiten oder sonstige Ereignisse auftreten, die sich auf die Anlagen des Fonds negativ auswirken können. Die Anlagen in diesen Ländern sind Marktentwicklungen unterworfen, die unter Umständen abrupt ausfallen als an den großen internationalen Handelsplätzen und können unter bestimmten Marktbedingungen erheblich steigende Kursspreads aufweisen. Diese Anlagen können sich als weniger liquide erweisen und nur mit Verzögerung zu angemessenen Preisen veräußerbar sein. Die Wechselkurse der Schwellenländer können sich abrupt und in erheblichem Maße ändern.

• **Risiko in Verbindung mit hohen Hebeleffekten:** Die Verwendung eines potenziell hohen Hebels kann eine beträchtliche Volatilität zur Folge haben, und der Fonds kann je nach Höhe des eingesetzten Hebels hohe Verluste erleiden.

• **Modellrisiko:** Die Auswahl der Wertpapiere im Bestand des Fonds erfolgt im Wesentlichen auf der Grundlage quantitativer Modelle. Es besteht das Risiko, dass diese Modelle nicht absolut effizient sind oder sich unter bestimmten Marktbedingungen als mangelhaft erweisen.

KOSTEN

| EINMALIGE KOSTEN VOR UND NACH DER ANLAGE | |
|---|---|
| Ausgabeaufschläge | 1.00% |
| Rücknahmeaufschläge | 1.00% |
| Der angegebene Prozentsatz stellt den Höchstsatz dar, der von Ihrer Anlage vor der Anlage bzw. vor der Auszahlung Ihrer Rendite abgezogen wird. | |
| KOSTEN, DIE VOM FONDS IM LAUFE DES JAHRES ABGEZOGEN WERDEN | |
| Laufende Kosten | 1.20% |
| KOSTEN, DIE DER FONDS UNTER BESTIMMTEN UMSTÄNDEN ZU TRAGEN HAT | |
| An die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren | 0.61% - (20 % pro Jahr der vom Fonds erwirtschafteten Rendite über dem Referenzwert für diese Gebühr, d. h. dem EONIA. Ab dem 01.01.2021 Anwendung einer »High-Watermark« und einer »Hurdle Rate«, deren Bedingungen in diesem Prospekt dargelegt werden.) Ab dem 01.01.2022 kommt eine Performancegebühr von 20 % zur Anwendung, die nach der High Water Mark Permanent-Methodik berechnet wird. Sie beruht auf der Outperformance des NIW gegenüber der Benchmark, d. h. dem €STR (Euro Short Term Rate) kapitalisiert, gedeckelt auf 0. Die Bedingungen der Performancegebühr sind im Verkaufsprospekt festgelegt. |

Die vom Anleger getragenen Kosten und Gebühren werden für den Betrieb des Fonds, einschließlich der Vermarktung und des Vertriebs seiner Anteile, verwendet. Diese Kosten beschränken das potenzielle Anlagewachstum.

Ausgabeauf- und Rücknahmeaufschläge:

Die angegebenen Kosten sind Höchstwerte, d. h., sie können im Einzelfall niedriger sein.

Die tatsächliche Höhe der Kosten können Sie bei Ihrem Berater oder Ihrer Vertriebsstelle erfragen.

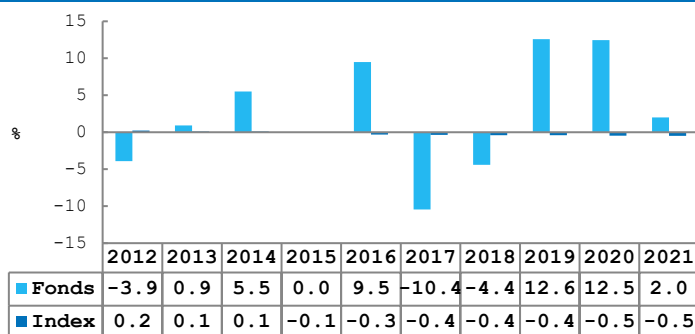
Laufende Kosten:

Die laufenden Kosten können von Jahr zu Jahr schwanken. Der angegebene Wert bezieht sich auf das letzte Geschäftsjahr, das im Dezember 2021 endete.

Nicht enthalten in den laufenden Kosten sind: die Performancegebühren und die Vermittlungsgebühren; hiervon ausgenommen sind Ausgabeaufschläge und/oder Rücknahmegebühren, die der OGA beim Kauf bzw. Verkauf von Anteilen an einem anderen Organismus für gemeinsame Anlagen zahlen muss.

Weitere Informationen zu den Kosten sind in den maßgeblichen Abschnitten im Prospekt zu finden, der abgerufen werden kann unter: www.candriam.com.

WERTENTWICKLUNG IN DER VERGANGENHEIT



Die Wertentwicklung in der Vergangenheit erlaubt keine Aussage über die künftige Entwicklung.

Die Performance Daten verstehen sich annualisiert vor Abzug von einmaligen Kosten, die vor oder nach der Anlage entstehen.

Jahr der Auflegung der Anteilsklasse: 2009.

Währung: EUR.

Benchmark: €STR kapitalisiert.

* Die Wertentwicklung wurde unter Bedingungen erzielt, die nicht länger bestehen.

PRAKTISCHE INFORMATIONEN

Depotbank: CACEIS BANK.

Dieses Dokument beschreibt eine Anteilsklasse des Candriam Diversified Futures. Der Prospekt und die periodischen Berichte werden für die Gesamtheit aller Anteilsklassen erstellt. Die übrigen Anteilsklassen sind im Prospekt aufgelistet.

Zusätzliche Informationen über den Fonds sind im Prospekt und in den periodischen Berichten zu finden, die auf Anfrage kostenfrei am Sitz der Verwaltungsgesellschaft erhältlich sind und jederzeit auf folgender Website abgerufen werden können: www.candriam.com. Diese Dokumente sind in einer von den Aufsichtsbehörden des jeweiligen Vertriebslandes des Fonds zugelassenen Sprache oder in einer in der internationalen Finanzwelt gebräuchlichen Sprache erhältlich.

Alle weiteren praktischen Informationen, insbesondere der Nettoinventarwert der Anteile, sind bei den vorstehend angegebenen Stellen erhältlich.

Die Steuervorschriften im Herkunftsmitgliedstaat des Fonds können die persönliche Steuerlage des Anlegers beeinflussen.

Die Einzelheiten der aktualisierten Vergütungspolitik, darunter die Zusammensetzung des Vergütungsausschusses sowie eine Beschreibung, wie die Vergütung und die sonstigen Zuwendungen berechnet werden und wie diese Politik mit der Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsrisiken und den Auswirkungen auf Nachhaltigkeit vereinbar ist, sind auf der Website von Candriam über den Link https://www.candriam.com/siteassets/legal-and-disclaimer/external_disclosure_remuneration_policy.pdf verfügbar.

Auf Anfrage wird kostenlos eine Papierversion zur Verfügung gestellt.

Candriam kann lediglich auf der Grundlage einer in diesem Dokument oder dessen Übersetzungen enthaltenen Erklärung haftbar gemacht werden, die irreführend, unrichtig oder nicht mit den einschlägigen Teilen des Prospekts vereinbar ist.

Dieser Fonds ist in Frankreich zugelassen und wird durch die Autorité des Marchés Financiers reguliert.

Diese wesentlichen Informationen für den Anleger sind zutreffend und entsprechen dem Stand vom 02.07.2022.