

Candriam Index Arbitrage Classique en EUR

Categoria Morningstar™
Alt - Debt Arbitrage

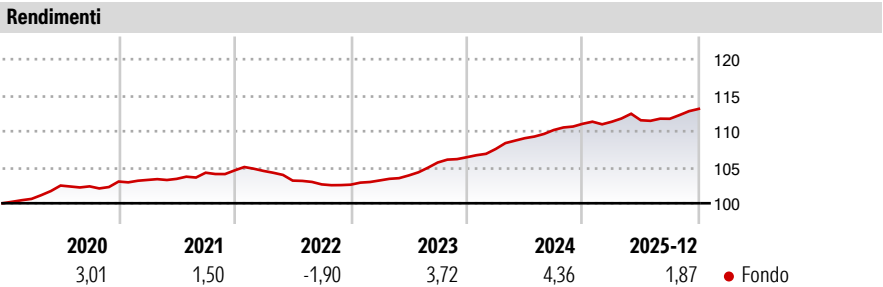
Benchmark Morningstar
Not Categorized
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato
€STR capitalisé Jour TR EUR

Morningstar Rating™
Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato
"Candriam Index Arbitrage è un fondo UCITS il cui obiettivo è l'outperformance di Eonia sul periodo di investimento consigliato, principalmente mediante l'uso di strategie di arbitraggio e tramite l'applicazione del monitoraggio dei rischi, con la prospettiva di limitare la volatilità del fondo. I gestori del fondo implementano un processo di investimento market-neutral, che comprende strategie di arbitraggio statistiche discrezionali sui titoli azionari, applicando analisi quantitative integrate da analisi qualitative."

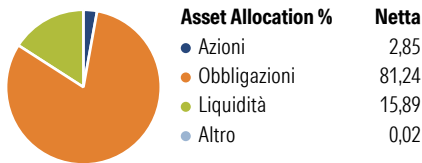
Misure di Rischio			
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	0,33
3Y Beta	-	3Y Std Dev	0,98
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-



Rend. Cumulati %		Fondo	Rendimenti				
			Trimestrali %				
			Q1	Q2	Q3	Q4	
3-Mesi		0,59	-	-	-	-	-
6-Mesi		1,22	-	-	-	-	-
1-Anno		1,50	0,25	0,19	0,18	1,23	-
3-Anni Ann.ti		3,14	1,08	1,39	1,04	0,79	-
5-Anni Ann.ti		1,87	0,57	0,67	1,73	0,69	-
10-Anni Ann.ti		1,27	-0,07	-1,28	-0,51	-0,04	-

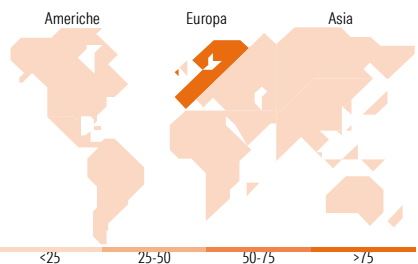
Rendimenti aggiornati al 29/01/2026

Portafoglio 30/11/2025



Fixed Income Style		Fondo
Box™		
Duration Effettiva		-
Maturity effettiva		-
Qualità Credito Media		B

Qualità Credito: Alto, Med, Basso
Sensibilità ai Tassi: Basso, Med, Alta



Titoli principali		
Nome	Settore	%
European Investment Bank 0%	-	17,62
SI-Europe 3.25% 04/07/34-12	-	10,68
European Financial Stability...	-	8,82
France (Republic Of) 3.5%	-	8,80
International Bank for...	-	8,59
SI-Europe 0% 04/07/29-4	-	7,20
European Financial Stability...	-	7,04
Italy (Republic Of) 1.1%	-	4,70
Italy (Republic Of) 2.65%	-	4,70
Candriam Risk Arbitrage Z	-	3,88
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		82,05
Numero Complessivo di Titoli Azionari		111
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		9

Fixed Income Sector Weightings %		Fondo
Governativo		70,54
Societario		12,82
Cartolarizzazioni		0,00
Enti Locali		0,00
Liquidità ed equivalenti		16,64
Derivati		0,01
Coupon Range %		Fondo
0 coupon		31,21
Da 0 a 4 cedole		67,79
Da 4 a 6 cedole		1,00
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
America		3,81
Stati Uniti		3,81
Canada		0,00
America Latina e Centrale		0,00
Europa		91,00
Regno Unito		0,00
Europa Occidentale - Euro		91,00
Europa Occidentale - Non Euro		0,00
Europa dell'Est		0,00
Africa		0,00
Medio Oriente		0,00
Asia		5,19
Giappone		5,19
Australasia		0,00
Asia - Paesi Sviluppati		0,00
Asia - Emergente		0,00

Anagrafica

Società di Gestione	Candriam	Patrimonio Classe (Mln)	69,26 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+352 27975130	(28/01/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.candriam.com	Domicilio	FRANCIA	T.E.R.	-
Data di Partenza	09/09/2003	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,40%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	20,00%
Data Inizio Gestione	10/07/2012	Inc/Acc	Acc		
NAV (29/01/2026)	EUR 1.542,10	ISIN	FR0010016477		
Patrimonio Netto (Mln)	170,38 EUR				

(30/11/2025)