

Candriam Index Arbitrage Classique en EUR

Categoria Morningstar™

Alt - Debt Arbitrage

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

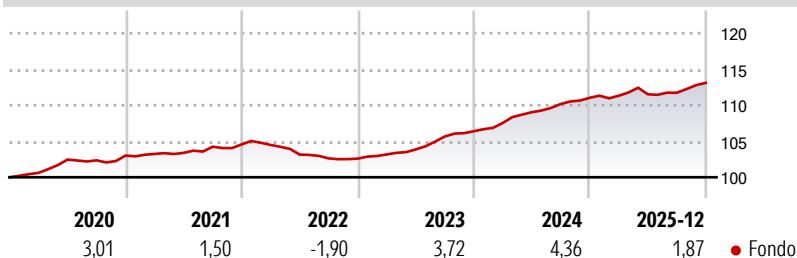
€STR capitalisé Jour TR EUR

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."

Rendimenti

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 %

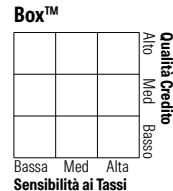
| | Fondo |
|----------------|-------|
| 3-Mesi | 0,59 |
| 6-Mesi | 1,22 |
| 1-Anno | 1,50 |
| 3-Anni Ann.ti | 3,14 |
| 5-Anni Ann.ti | 1,87 |
| 10-Anni Ann.ti | 1,27 |

Rendimenti aggiornati al 29/01/2026

Portafoglio 30/11/2025

Asset Allocation %

| Categoria | Netta |
|--------------|-------|
| Azioni | 2,85 |
| Obbligazioni | 81,24 |
| Liquidità | 15,89 |
| Altro | 0,02 |

Fixed Income Style

Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media

Fondo

-
-
B

Rendimenti Trimestrali %

| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------|-------|-------|-------|-------|
| 2026 | - | - | - | - |
| 2025 | 0,25 | 0,19 | 0,18 | 1,23 |
| 2024 | 1,08 | 1,39 | 1,04 | 0,79 |
| 2023 | 0,57 | 0,67 | 1,73 | 0,69 |
| 2022 | -0,07 | -1,28 | -0,51 | -0,04 |

Americhe

Europa

Asia

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 - Emergenti | 0,00 |

Anagrafica

| | |
|------------------------|------------------|
| Società di Gestione | Candriam |
| Telefono | +352 27975130 |
| Web | www.candriam.com |
| Data di Partenza | 09/09/2003 |
| Nome del Gestore | - |
| Data Inizio Gestione | 10/07/2012 |
| NAV (29/01/2026) | EUR 1.542,10 |
| Patrimonio Netto (Mln) | 170,38 EUR |

(30/11/2025)

Patrimonio Classe (Mln)

(28/01/2026)

69,26 EUR
Investimento Min. Ingresso
Investimento Min. Successivo