

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

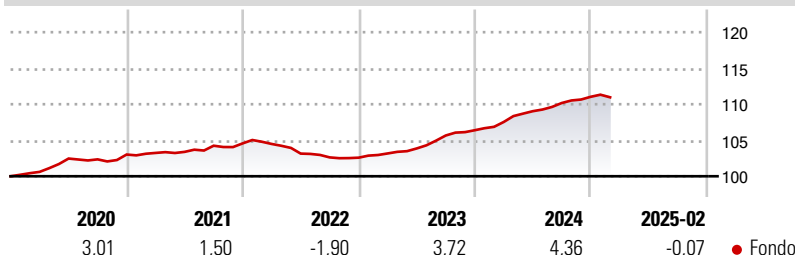
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

"Candriam Index Arbitrage é un fondo UCITS il cui obiettivo é 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	-0,62
3Y Beta	-	3Y Std Dev	1,12
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rendimenti



Rend. Cumulati %

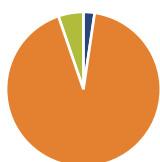
Periodo	Fondo
3-Mesi	0,27
6-Mesi	1,28
1-Anno	3,79
3-Anni Ann.ti	1,98
5-Anni Ann.ti	2,03
10-Anni Ann.ti	1,13

Rendimenti aggiornati al 10/03/2025

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2025	-	-	-	-
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
2021	0,22	0,14	0,83	0,31

Portafoglio 31/12/2024



Asset Allocation %

Asset Class	Netta
Azioni	2,34
Obbligazioni	92,41
Liquidità	5,25
Altro	0,01

Fixed Income

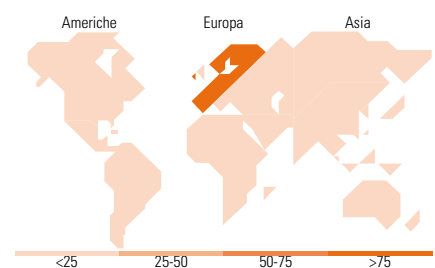
Style Box™

Qualità Credito	Basso	Med	Alta
Bassa			
Med			
Alta			

Sensibilità ai Tassi

Fondo

Duration Effettiva	-
Maturità effettiva	-
Qualità Credito Media	B



Titoli principali

Nome	Settore	%
European Investment Bank 0%	-	11,46
SI-Europe 3.25% 04/07/34-3	-	9,58
SI-Kfw 0.625% 22/02/27-3	-	9,14
European Financial Stability...	-	8,10
SI-Esm 2.625% 18/09/29-1	-	7,64
SI-Eurofima 0.15% 10/10/34-10	-	6,71
SI-Eurofima 0.15% 10/10/34-11	-	6,71
SI-Eurofima 0.15% 10/10/34-12	-	6,66
SI-Europe 3.25% 04/07/34-4	-	6,00
European Financial Stability...	-	4,70
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		76,70
Numero Complessivo di Titoli Azionari		141
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		14

Fixed Income Sector Weightings %

Settore	Fondo
Governativo	35,59
Societario	59,03
Cartolarizzazioni	0,61
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	4,77
Derivati	0,01

Coupon Range %

Range	Fondo
0 coupon	21,46
Da 0 a 4 cedole	78,54
Da 4 a 6 cedole	0,00
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 %

Regione	Fondo
America	1,35
Stati Uniti	1,35
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	98,65
Regno Unito	0,00
Europa Occidentale - Euro	98,65
Europa Occidentale - Non Euro	0,00
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	0,00
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,00

Anagrafica

Società di Gestione	Candriam	Patrimonio Classe (Mln)	109,22 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+352 27975130	(11/03/2025)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.candriam.com	Domicilio	FRANCIA	T.E.R.	0,48%
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 (10/03/2025)	EUR 1.517,31	ISIN	FR0010016477		
Patrimonio Netto (Mln)	262,64 EUR				

(31/12/2024)