Candriam Index Arbitrage R

Categoria Morningstar™

Alt - Debt Arbitrage

Benchmark Morningstar

Not Categorized
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato €STR capitalisé Jour TR EUR

ELID

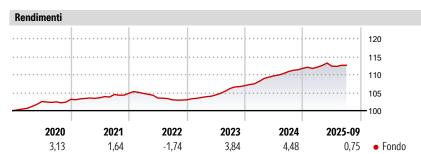
Morningstar Rating™

Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

"Candriam Index Arbitrage é un fondo UCITS il cui obietivo 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	0,09
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	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	0,45	Trimestrali %				
6-Mesi	0,73	2025	0,30	0,23	0,22	-
1-Anno	1,94	2024	1,11	1,40	1,08	0,82
3-Anni Ann.ti	3,13	2023	0,61	0,71	1,73	0,73
5-Anni Ann.ti	2,04	2022	-0,04	-1,23	-0,47	0,00
10-Anni Ann.ti Rendimenti aggiornati al 15/10/2025	-	2021	0,25	0,17	0,87	0,33

Portafoglio 31/07/2025





Fixed Income Sector Weightings %

Prondo

Duration Effettiva

Maturity effettiva

Qualità Credito Media

B

Fondo



Titoli principali		
Nome Se	ettore	%
European Investment Bank 0%	_	27,34
SI-Europe 3.25% 04/07/34-10	_	11,37
European Financial Stability	_	9,66
SI-Esm 2.75% 15/09/34-2	_	8,00
France (Republic Of) 0.75%	_	7,96
SI-Esm 2.75% 15/09/34-3	_	7,95
Italy (Republic Of) 1.5%	_	7,28
SI-Europe 2.75% 04/02/33-6	_	5,59
European Investment Bank 3.5%	_	5,46
European Financial Stability	_	5,46
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		96,06
Numero Complessivo di Titoli Azionari		105
Numero Complessivo di Titoli Obbligazion	nari	12

Cartolarizzazioni 0,00 Liquidità ed equivalenti -16,90 Derivati 0,01 Coupon Range % Fondo 0 coupon 27,89 Da 0 a 4 cedole 69,46 Da 4 a 6 cedole 2,65 Da 6 a 8 cedole 0,00 Da 8 a 10 cedole 0,00 Da 10 a 12 cedole 0,00	₩ Governativo	116,02
☑ Enti Locali 0,00 ☑ Liquidità ed equivalenti -16,90 ☑ Derivati 0,01 Coupon Range % Fondo 0 coupon 27,89 Da 0 a 4 cedole 69,46 Da 4 a 6 cedole 2,65 Da 6 a 8 cedole 0,00 Da 8 a 10 cedole 0,00 Da 10 a 12 cedole 0,00	Societario	0,87
□ Liquidità ed equivalenti -16,90 □ Derivati 0,01 Coupon Range % Fondo 0 coupon 27,89 Da 0 a 4 cedole 69,46 Da 4 a 6 cedole 2,65 Da 6 a 8 cedole 0,00 Da 8 a 10 cedole 0,00 Da 10 a 12 cedole 0,00	★ Cartolarizzazioni	0,00
Coupon Range % Fondo 0 coupon 27,89 Da 0 a 4 cedole 69,46 Da 4 a 6 cedole 2,65 Da 6 a 8 cedole 0,00 Da 8 a 10 cedole 0,00 Da 10 a 12 cedole 0,00	Enti Locali	0,00
Coupon Range % Fondo 0 coupon 27,89 Da 0 a 4 cedole 69,46 Da 4 a 6 cedole 2,65 Da 6 a 8 cedole 0,00 Da 8 a 10 cedole 0,00 Da 10 a 12 cedole 0,00	🚅 Liquidità ed equivalenti	-16,90
0 coupon 27,89 Da 0 a 4 cedole 69,46 Da 4 a 6 cedole 2,65 Da 6 a 8 cedole 0,00 Da 8 a 10 cedole 0,00 Da 10 a 12 cedole 0,00	Derivati	0,01
Da 0 a 4 cedole 69,46 Da 4 a 6 cedole 2,65 Da 6 a 8 cedole 0,00 Da 8 a 10 cedole 0,00 Da 10 a 12 cedole 0,00	Coupon Range %	Fondo
Da 4 a 6 cedole 2,65 Da 6 a 8 cedole 0,00 Da 8 a 10 cedole 0,00 Da 10 a 12 cedole 0,00	0 coupon	27,89
Da 6 a 8 cedole 0,00 Da 8 a 10 cedole 0,00 Da 10 a 12 cedole 0,00	Da 0 a 4 cedole	69,46
Da 8 a 10 cedole 0,00 Da 10 a 12 cedole 0,00	Da 4 a 6 cedole	2,65
Da 10 a 12 cedole 0,00	Da 6 a 8 cedole	0,00
	Da 8 a 10 cedole	0,00
Oltre 12 cedole 0,00	Da 10 a 12 cedole	0,00
	Oltre 12 cedole	0,00

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	1,65
Stati Uniti	1,65
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	98,35
Regno Unito	0,00
Europa Occidentale - Euro	88,55
Europa Occidentale - Non Euro	9,79
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
Telefono	+352 27975130
Web	www.candriam.com
Data di Partenza	18/09/2017
Nome del Gestore	=
Data Inizio Gestione	10/07/2012
NAV (15/10/2025)	EUR 113,04
Patrimonio Netto (MIn)	219,99 EUR

Patrimonio Classe (MIn)	10,08 EUR
(15/10/2025)	
Domicilio	FRANCIA
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	FR0012088771

Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	=
T.E.R.	0,37%
Spese correnti	0,24%
Commissione di incentivo	20,00%