

Candriam Index Arbitrage R

| 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 <p>"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."</p> | | Rendimenti <table border="1"> <thead> <tr> <th>Periodo</th> <th>Rendimento (%)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>2020</td> <td>3,13</td> </tr> <tr> <td>2021</td> <td>1,64</td> </tr> <tr> <td>2022</td> <td>-1,74</td> </tr> <tr> <td>2023</td> <td>3,84</td> </tr> <tr> <td>2024</td> <td>4,48</td> </tr> <tr> <td>2025-12</td> <td>2,04</td> </tr> </tbody> </table> <p>● Fondo</p> | | Periodo | Rendimento (%) | 2020 | 3,13 | 2021 | 1,64 | 2022 | -1,74 | 2023 | 3,84 | 2024 | 4,48 | 2025-12 | 2,04 |
| Periodo | Rendimento (%) | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2020 | 3,13 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2021 | 1,64 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2022 | -1,74 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2023 | 3,84 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2024 | 4,48 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2025-12 | 2,04 | | | | | | | | | | | | | | | | |

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

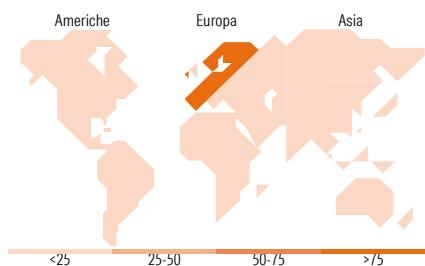
| Rend. Cumulati % | Fondo | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|--------------------------|-------|-------|-------|------|
| 3-Mesi | 0,64 | 2026 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 1,31 | 2025 | 0,30 | 0,23 | 0,22 | 1,28 |
| 1-Anno | 1,66 | 2024 | 1,11 | 1,40 | 1,08 | 0,82 |
| 3-Anni Ann.ti | 3,27 | 2023 | 0,61 | 0,71 | 1,73 | 0,73 |
| 5-Anni Ann.ti | 2,01 | 2022 | -0,04 | -1,23 | -0,47 | 0,00 |
| 10-Anni Ann.ti | - | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 29/01/2026

Portafoglio 30/11/2025



| | Fondo |
|-----------------------|--------------|
| Duration Effettiva | - |
| Maturity effettiva | - |
| Qualità Credito Media | B |



| 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 | |

| Ripartizione Geografica % | |
|----------------------------------|--------------|
| America | 3,81 |
| Stati Uniti | 3,81 |
| Canada | 0,00 |
| America Latina e Centrale | 0,00 |
| <hr/> | |
| 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 |
| <hr/> | |
| 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) | 7,37 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 | 18/09/2017 | Valuta del Fondo | EUR | Spese correnti | 0,24% |
| Nome del Gestore | - | UCITS | Si | Commissione di incentivo | 20,00% |
| Data Inizio Gestione | 10/07/2012 | Inc/Acc | Acc | | |
| NAV (29/01/2026) | EUR 113,84 | ISIN | FR0012088771 | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 170,38 EUR | | | | |
| (30/11/2025) | | | | | |