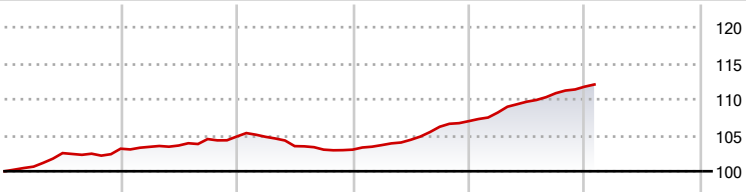
Candriam Index Arbitrage R

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Alt - Debt Arbitrage	Not Categorized Usato nel Report	€STR capitalisé Jour TR EUR	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."

Rendimenti



2020	2021	2022	2023	2024	2025-01	
3,13	1,64	-1,74	3,84	4,48	0,27	● Fondo

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-0,34
3Y Beta	-	3Y Std Dev	1,09
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	0,82
6-Mesi	2,08
1-Anno	4,55
3-Anni Ann.ti	2,12
5-Anni Ann.ti	2,29
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

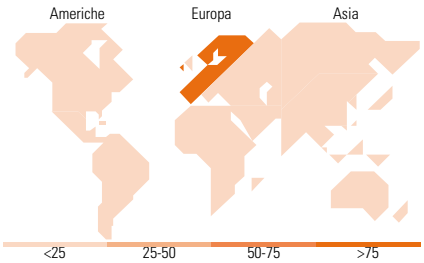
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	1,11	1,40	1,08	0,82
2023	0,61	0,71	1,73	0,73
2022	-0,04	-1,23	-0,47	0,00
2021	0,25	0,17	0,87	0,33

Portafoglio 30/11/2024

Asset Allocation %	Netta
● Azioni	1,87
● Obbligazioni	84,61
● Liquidità	13,51
● Altro	0,01

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
European Investment Bank 0%	—	10,46
SI-Europe 3.25% 04/07/34-3	—	8,74
SI-Kfw 0.625% 22/02/27-3	—	8,34
European Financial Stability...	—	7,39
Italy (Republic Of) 2.95%	—	7,01
SI-Esm 2.625% 18/09/29-1	—	6,97
SI-Eurofima 0.15% 10/10/34-10	—	6,13
SI-Eurofima 0.15% 10/10/34-11	—	6,13
SI-Europe 3.25% 04/07/34-4	—	5,47
European Financial Stability...	—	4,29
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		70,95
Numero Complessivo di Titoli Azionari		155
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		14

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	38,85
Societario	47,47
Cartolarizzazioni	0,56
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	13,11
Derivati	0,01

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	20,78
Da 0 a 4 cedole	79,21
Da 4 a 6 cedole	0,01
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	**0,49**
Stati Uniti	0,49
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	**99,51**
Regno Unito	0,00
Europa Occidentale - Euro	99,51
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
Telefono	+352 27975130
Web	www.candriam.com
Data di Partenza	18/09/2017
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	10/07/2012
NAV (03/02/2025)	EUR 112,16
Patrimonio Netto (Mln) (30/11/2024)	286,94 EUR
Patrimonio Classe (Mln) (03/02/2025)	22,99 EUR
Domicilio	FRANCIA
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	FR0012088771
Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,35%
Spese correnti	0,24%
Commissione di incentivo	20,00%

© 2025 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.