

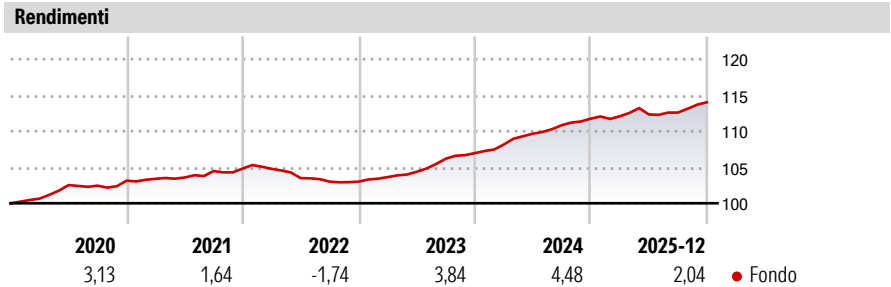
Candriam Index Arbitrage R

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 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."

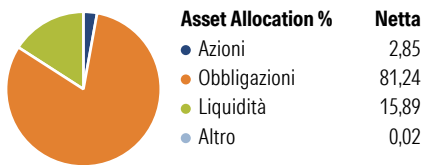
Misure di Rischio			
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	0,48
3Y Beta	-	3Y Std Dev	0,96
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-



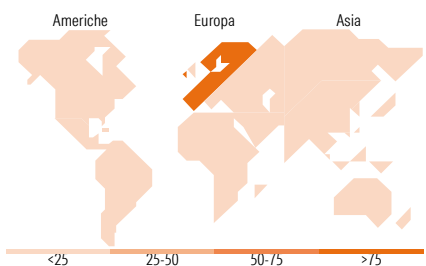
Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	0,64	Trimestrali %				
6-Mesi	1,31	2026	-	-	-	-
1-Anno	1,66	2025	0,30	0,23	0,22	1,28
3-Anni Ann.ti	3,27	2024	1,11	1,40	1,08	0,82
5-Anni Ann.ti	2,01	2023	0,61	0,71	1,73	0,73
10-Anni Ann.ti	-	2022	-0,04	-1,23	-0,47	0,00

Rendimenti aggiornati al 29/01/2026

Portafoglio 30/11/2025



Fixed Income Style		Fondo
Box™		
Qualità Credito	Duration Effettiva	-
	Maturità effettiva	-
	Qualità Credito Media	B
Alto		
Med		
Basso		
Bassa		
Med		
Alta		
Sensibilità ai Tassi		



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 - 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)					