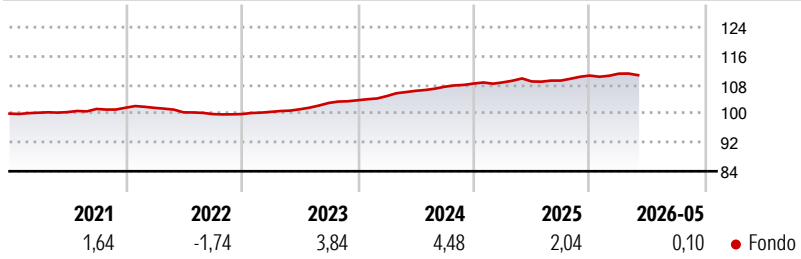
Candriam Index Arbitrage R

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



2021	2022	2023	2024	2025	2026-05	
1,64	-1,74	3,84	4,48	2,04	0,10	● Fondo

Misure di Rischio

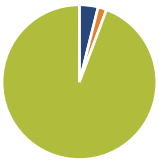
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	0,22
3Y Beta	-	3Y Std Dev	1,10
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	0,30
6-Mesi	0,77
1-Anno	1,93
3-Anni Ann.ti	3,12
5-Anni Ann.ti	2,07
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 25/06/2026

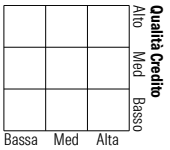
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	0,47	-	-	-
2025	0,30	0,23	0,22	1,28
2024	1,11	1,40	1,08	0,82
2023	0,61	0,71	1,73	0,73
2022	-0,04	-1,23	-0,47	0,00

Portafoglio 31/03/2026

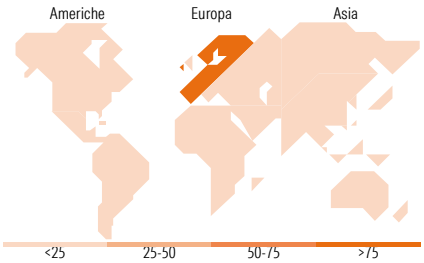


Asset Allocation %	Netta
Azioni	3,90
Obbligazioni	1,80
Liquidità	94,29
Altro	0,02

Fixed Income Style Box™



Fondo	
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	B



Titoli principali

Nome	Settore	%
Candriam Equities L Mrg...	—	3,79
Candriam Diversified Futures Z	—	1,76
ING Groep NV		0,68
Galderma Group AG Registered...		0,57
Allianz SE		0,52
Snam SpA		0,38
Nordex SE Akt. nach...		0,25
voestalpine AG		0,19
Eqsw Dia Ubs 1803 Jp Jpy	—	0,18
Sofina SA		0,18

% Primi 10 Titoli sul Patrimonio	8,50
Numero Complessivo di Titoli Azionari	149
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari	0

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	2,13
Societario	0,34
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	97,52
Derivati	0,01

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	24,96
Da 0 a 4 cedole	68,17
Da 4 a 6 cedole	6,87
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	**2,33**
Stati Uniti	2,33
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	**95,49**
Regno Unito	0,00
Europa Occidentale - Euro	81,95
Europa Occidentale - Non Euro	13,54
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	**2,18**
Giappone	2,18
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 (25/06/2026)	EUR 114,74
Patrimonio Netto (Mln) (31/03/2026)	163,01 EUR

Patrimonio Classe (Mln) (25/06/2026)	3,19 EUR
Domicilio	FRANCIA
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	FR0012088771

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

See disclosures for more details

© 2026 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.

MORNINGSTAR