

# Candriam Index Arbitrage Classique en EUR

**Categoria Morningstar™**

Alt - Debt Arbitrage

**Benchmark Morningstar**

Not Categorized

Usato nel Report

**Benchmark Dichiarato**

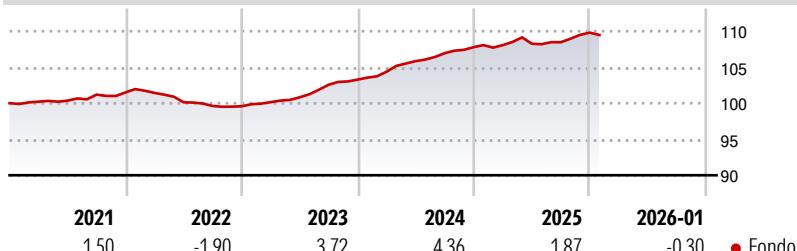
€STR capitalisé Jour TR EUR

**Morningstar Rating™**

Senza rating

**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

"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."

**Rendimenti**

**Misure di Rischio**

3Y Alpha	- 3Y Sharpe Ratio	0,11
3Y Beta	- 3Y Std Dev	1,04
3Y R-Squared	- 3Y Risk	-
3Y Info Ratio	- 5Y Risk	-
3Y Tracking Error	- 10Y Risk	-

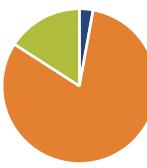
**Rend. Cumulati %**

	Fondo
3-Mesi	0,31
6-Mesi	1,04
1-Anno	1,56
3-Anni Ann.ti	3,07
5-Anni Ann.ti	1,80
10-Anni Ann.ti	1,29

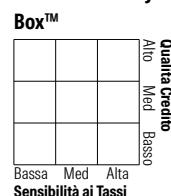
Rendimenti aggiornati al 23/02/2026

**Rendimenti Trimestrali %**

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	0,25	0,19	0,18	1,23
2024	1,08	1,39	1,04	0,79
2023	0,57	0,67	1,73	0,69
2022	-0,07	-1,28	-0,51	-0,04

**Portafoglio 30/11/2025**


	Netta
Azioni	2,85
Obbligazioni	81,24
Liquidità	15,89
Altro	0,02

**Fixed Income Style**


Duration Effettiva  
Maturity effettiva  
Qualità Credito Media

**Fondo**

-  
-


**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 - Emergenti	0,00

**Anagrafica**

Società di Gestione	Candriam
Telefono	+352 27975130
Web	www.candriam.com
Data di Partenza	09/09/2003
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	10/07/2012
NAV (23/02/2026)	EUR 1.541,53
Patrimonio Netto (Mln)	170,38 EUR

(30/11/2025)

Patrimonio Classe (Mln)	67,12 EUR
(23/02/2026)	
Domicilio	FRANCIA
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	FR0010016477

Investimento Min. Ingresso -  
Investimento Min. Successivo -  
T.E.R. 0,40%  
Spese correnti 0,40%  
Commissione di incentivo 20,00%