

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

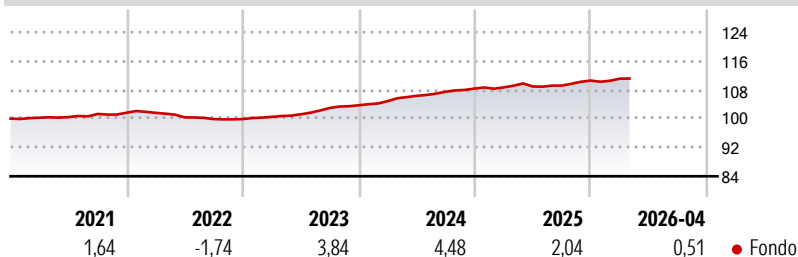
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

"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	0,39
3Y Beta	-	3Y Std Dev	1,03
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rendimenti



Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo
3-Mesi	1,17
6-Mesi	1,09
1-Anno	1,63
3-Anni Ann.ti	3,34
5-Anni Ann.ti	2,05
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 06/05/2026

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
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 31/12/2025



Asset Allocation %

Asset Class	Netta
Azioni	2,66
Obbligazioni	3,17
Liquidità	94,16
Altro	0,01

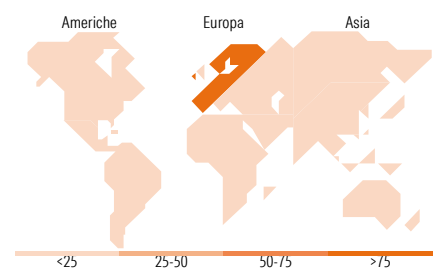
Fixed Income Style

Box™

Qualità Credito	Alto	Med	Basso
Bassa			
Med			
Alta			

Sensibilità ai Tassi

Stile	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturità effettiva	-
Qualità Credito Media	B



Titoli principali

Nome	Settore	%
Candriam Risk Arbitrage Z	-	4,03
Candriam Diversified Futures Z	-	1,77
Commerzbank AG		0,88
Telecom Italia SpA Az.di...		0,30
Bawag Group AG Ordinary Shares		0,28
Italgas SpA		0,26
KION GROUP AG		0,25
Eqsw Dia Jpg Amrz Sw Chf	-	0,08
Eqsw Dia Ubs Wdc Us Usd	-	0,07
Eqsw Dia Jpg Prim Us Usd	-	0,04
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		7,96
Numero Complessivo di Titoli Azionari		147
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		0

Fixed Income Sector Weightings %

Settore	Fondo
Governativo	2,82
Societario	0,19
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	96,98
Derivati	0,01

Coupon Range %

Range	Fondo
0 coupon	16,33
Da 0 a 4 cedole	57,60
Da 4 a 6 cedole	26,07
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 %

Regione	Fondo
America	5,80
Stati Uniti	5,80
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	90,78
Regno Unito	0,00
Europa Occidentale - Euro	90,78
Europa Occidentale - Non Euro	0,00
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	3,42
Giappone	3,42
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,00

Anagrafica

Società di Gestione	Candriam	Patrimonio Classe (Mln)	5,05 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+352 27975130	(06/05/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.candriam.com	Domicilio	FRANCIA	T.E.R.	0,24%
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 (06/05/2026)	EUR 114,58	ISIN	FR0012088771		
Patrimonio Netto (Mln)	164,15 EUR				

(31/12/2025)