

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

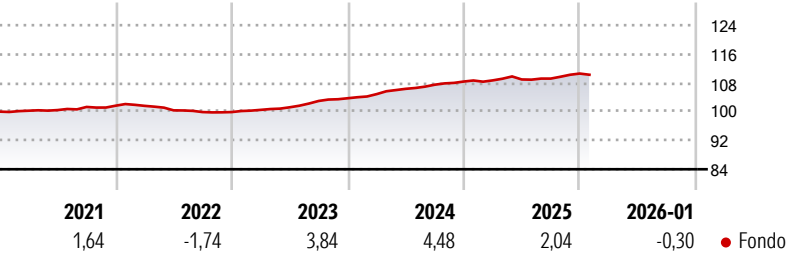
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

"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	0,25
3Y Beta	-	3Y Std Dev	1,02
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rendimenti



Rend. Cumulati %

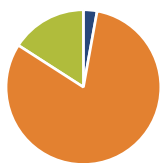
	Fondo
3-Mesi	0,50
6-Mesi	1,25
1-Anno	1,52
3-Anni Ann.ti	3,23
5-Anni Ann.ti	1,99
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 30/01/2026

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2026	-	-	-	-
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 30/11/2025



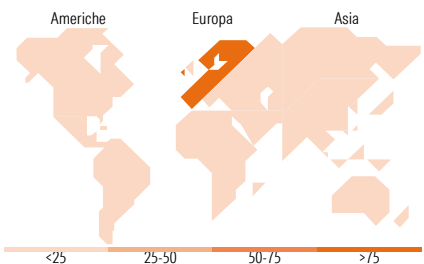
Asset Allocation %	Netta
● Azioni	2,85
● Obbligazioni	81,24
● Liquidità	15,89
● Altro	0,02

Fixed Income Style

Box™

	Qualità Credito
	Alto
	Med
	Basso
	Bassa
	Med
	Alta
	Sensibilità ai Tassi

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	B



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
Telefono	+352 27975130
Web	www.candriam.com
Data di Partenza	18/09/2017
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	10/07/2012
NAV (30/01/2026)	EUR 113,73
Patrimonio Netto (Mln)	170,38 EUR

Patrimonio Classe (Mln)	7,35 EUR
(30/01/2026)	
Domicilio	FRANCIA
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	FR0012088771

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

(30/11/2025)