

Candriam Index Arbitrage R

Categoria Morningstar™

Alt - Debt Arbitrage

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

€STR capitalisé Jour TR EUR

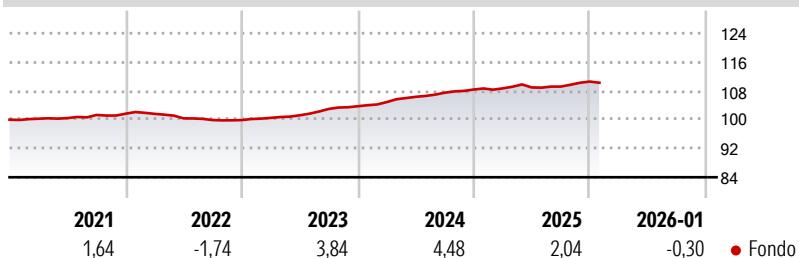
Morningstar Rating™

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."

Rendimenti



Misure di Rischio

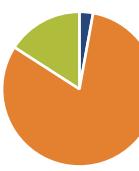
3Y Alpha	- 3Y Sharpe Ratio	0,25
3Y Beta	- 3Y Std Dev	1,02
3Y R-Squared	- 3Y Risk	-
3Y Info Ratio	- 5Y Risk	-
3Y Tracking Error	- 10Y Risk	-

Rend. Cumulati %

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

Portafoglio 30/11/2025



Asset Allocation %

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

Fixed Income Style



Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media

Fondo

-
-
B

Rendimenti Trimestrali %

	Q1	Q2	Q3	Q4
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

Americhe



Europa



Asia



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	10,54
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	Patrimonio Classe (Mln)	7,35 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+352 27975130	(30/01/2026)		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 (30/01/2026)	EUR 113,73	ISIN	FR0012088771		
Patrimonio Netto (Mln)	170,38 EUR				
(30/11/2025)					