

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

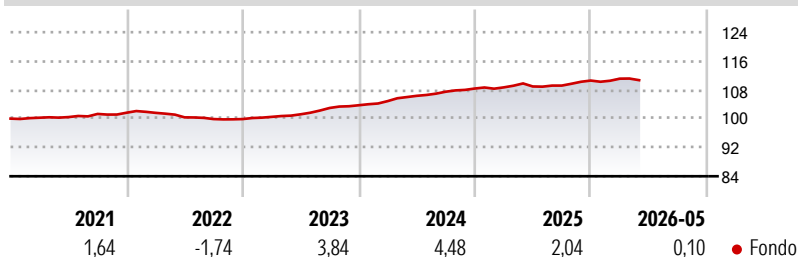
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

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

Rendimenti



Rend. Cumulati %

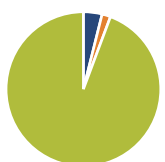
Periodo	Fondo
3-Mesi	0,26
6-Mesi	0,90
1-Anno	1,81
3-Anni Ann.ti	3,16
5-Anni Ann.ti	2,08
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 23/06/2026

Rendimenti

Periodo	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 %

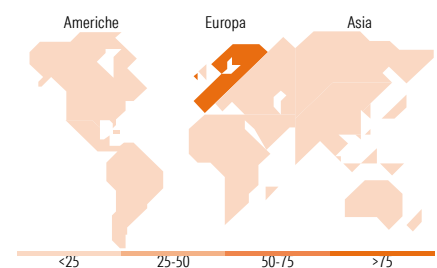
Azioni	3,90
Obbligazioni	1,80
Liquidità	94,29
Altro	0,02

Fixed Income Style

Box™

Qualità Credito	Alto	Medio	Basso
Sensibilità ai Tassi	Bassa	Med	Alta

Duration Effettiva	-
Maturità 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 %

Settore	Fondo
🏠 Governativo	2,13
⚙️ Societario	0,34
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
🏠 Enti Locali	0,00
🏠 Liquidità ed equivalenti	97,52
🏠 Derivati	0,01

Coupon Range %

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 %

Regione	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	Patrimonio Classe (Mln)	3,50 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+352 27975130	(23/06/2026)		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 (23/06/2026)	EUR 114,86	ISIN	FR0012088771		
Patrimonio Netto (Mln)	163,01 EUR				

(31/03/2026)

[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 prodotte; (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.