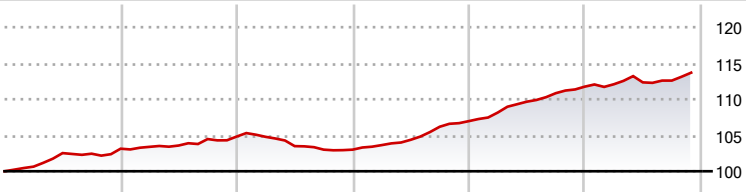
Candriam Index Arbitrage R

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Alt - Debt Arbitrage	Not Categorized Usato nel Report	€STR capitalisé Jour TR EUR	Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

"Candriam Index Arbitrage é un fondo UCITS il cui obietivo é 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



2020	2021	2022	2023	2024	2025-11	
3,13	1,64	-1,74	3,84	4,48	1,74	● Fondo

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	0,41
3Y Beta	-	3Y Std Dev	0,97
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	0,60
6-Mesi	0,40
1-Anno	1,87
3-Anni Ann.ti	3,37
5-Anni Ann.ti	2,01
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 17/12/2025

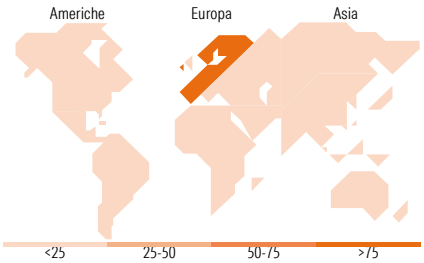
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	0,30	0,23	0,22	-
2024	1,11	1,40	1,08	0,82
2023	0,61	0,71	1,73	0,73
2022	-0,04	-1,23	-0,47	0,00
2021	0,25	0,17	0,87	0,33

Portafoglio 30/09/2025

Asset Allocation %	Netta
● Azioni	3,42
● Obbligazioni	2,87
● Liquidità	93,69
● Altro	0,03

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	B



Titoli principali Nome	Settore	%
Candriam Money Market Euro...	—	4,51
Candriam Risk Arbitrage Z	—	3,15
Candriam Diversified Futures Z	—	1,34
Munchener...		0,39
ING Groep NV		0,38
Mercedes-Benz Group AG		0,36
Intesa Sanpaolo		0,35
Commerzbank AG		0,32
Hochtief AG		0,27
Buzzi SpA		0,20
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		11,27
Numero Complessivo di Titoli Azionari		100
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		0

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	3,09
Societario	0,53
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	96,39
Derivati	0,00

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	31,82
Da 0 a 4 cedole	35,96
Da 4 a 6 cedole	32,22
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	**0,11**
Stati Uniti	0,11
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	**97,91**
Regno Unito	0,00
Europa Occidentale - Euro	97,91
Europa Occidentale - Non Euro	0,00
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	**1,98**
Giappone	1,98
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 (17/12/2025)	EUR 113,60
Patrimonio Netto (Mln) (30/09/2025)	208,97 EUR
Patrimonio Classe (Mln) (17/12/2025)	8,27 EUR
Domicilio	FRANCIA
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	FR0012088771
Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,37%
Spese correnti	0,24%
Commissione di incentivo	20,00%

© 2025 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 prodotto; (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.