

# Candriam Index Arbitrage Classique en EUR

Morningstar Categorie Index

—

Benchmark van het fonds

€STR capitalisé Jour TR EUR

Morningstar Rating™

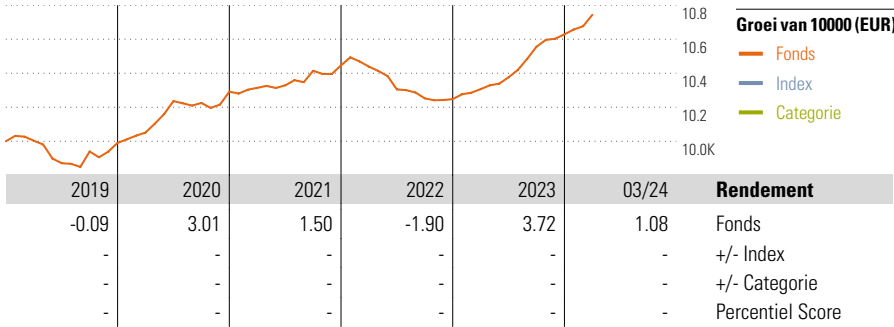
—

Morningstar Categorie™

Alt - Debt Arbitrage

Beleggingsdoelstelling

"Candriam Index Arbitrage is een UCITS-fonds. De doelstelling ervan is om beter te presteren dan de Eonia-rente over de aanbevolen beleggingstermijn, en dit voornamelijk door arbitragestrategieën toe te passen en door toepassing van een risicocontrole om de volatiliteit van het fonds te beperken. De fondsbeheerders hanteren een marktneutraal beleggingsproces, bestaande uit statistische arbitragestrategieën die naar eigen oordeel op de aandelenmarkten toegepast worden en waarbij gebruik gemaakt wordt van kwantitatieve...



Risicomaatstaven

|                  |                |      |
|------------------|----------------|------|
| Alpha            | - Sharpe Ratio | 0.19 |
| Beta             | - Std Deviatie | 1.12 |
| R-kwadraat       | - 3-jr Risico  | -    |
| Informatie Ratio | - 5-jr Risico  | -    |
| Tracking Error   | - 10-jr Risico | -    |

Rendementen (25 apr 2024)

|            | Rend % | +/-Idx | +/-Cat |
|------------|--------|--------|--------|
| 3 Maanden  | 1.51   | -      | -      |
| 6 Maanden  | 2.05   | -      | -      |
| 1 jaar     | 4.67   | -      | -      |
| 3 jr gean. | 1.47   | -      | -      |
| 5 jr gean. | 1.61   | -      | -      |

Kwartaalrendementen

|      | 1e kw | 2e kw | 3e kw | 4e kw |
|------|-------|-------|-------|-------|
| 2024 | 1.08  | -     | -     | -     |
| 2023 | 0.57  | 0.67  | 1.73  | 0.69  |
| 2022 | -0.07 | -1.28 | -0.51 | -0.04 |
| 2021 | 0.22  | 0.14  | 0.83  | 0.31  |
| 2020 | 0.60  | 1.84  | -0.11 | 0.65  |

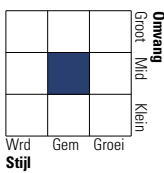
Portefeuille 31 jan 2024

Assetverdeling

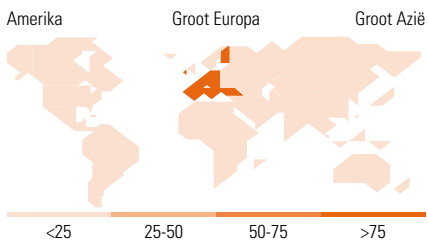
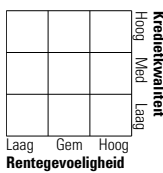
|                | % Long | % Short | % Netto |
|----------------|--------|---------|---------|
| Aandelen       | 2.12   | 0.48    | 1.64    |
| Obligaties     | 84.35  | 0.00    | 84.35   |
| Kas/ geldmarkt | 14.15  | 0.18    | 13.97   |
| Overig         | 0.04   | 0.00    | 0.04    |

Morningstar Style Box

Stijl Aandelen



Stijl vastrentend



Top 10 Onderliggende posities

|                                   | Sector | % Port |
|-----------------------------------|--------|--------|
| European Investment Bank...       | —      | 8.86   |
| Italy (Republic Of)...            | —      | 7.90   |
| France (Republic Of)...           | —      | 7.89   |
| European Investment Bank...       | —      | 7.89   |
| SI-Eurofima 0.15%...              | —      | 6.91   |
| SI-Europe 0%...                   | —      | 6.91   |
| Candriam Money Market Euro Z Acc  | —      | 5.84   |
| SI-Esm 1.8% 02/11/46-42046-11-02  | —      | 4.93   |
| European Financial Stability...   | —      | 3.76   |
| European Investment Bank...       | —      | 3.70   |
| Totaal Aantal Aandelen            |        | 97     |
| Totaal Aantal Obligaties          |        | 17     |
| % Van Vermogen In Top 10 Posities |        | 64.60  |

Sectorverdeling

|                                | % Aand       |
|--------------------------------|--------------|
| <b>Cyclisch</b>                | <b>42.28</b> |
| Basismaterialen                | 12.50        |
| Cyclische consumentenproducten | 9.71         |
| Financiële dienstverlening     | 17.71        |
| Vastgoed                       | 2.36         |
| <b>Licht Cyclisch</b>          | <b>21.41</b> |
| Communicatiediensten           | 8.32         |
| Energie                        | 2.63         |
| Industrie                      | 7.59         |
| Technologie                    | 2.87         |
| <b>Defensief</b>               | <b>36.31</b> |
| Defensieve consumptiegoederen  | -            |
| Gezondheidszorg                | 30.37        |
| Nutsbedrijven                  | 5.94         |

Regioverdeling

|                         | % Aand       |
|-------------------------|--------------|
| <b>Amerika</b>          | <b>3.23</b>  |
| Verenigde Staten        | 3.23         |
| Canada                  | 0.00         |
| Latijns Amerika         | 0.00         |
| <b>Groot Europa</b>     | <b>96.77</b> |
| Verenigd Koninkrijk     | 0.00         |
| West Europa – Euro      | 96.77        |
| West Europa – Niet Euro | 0.00         |
| Emerging Europa         | 0.00         |
| Midden-Oosten / Afrika  | 0.00         |
| <b>Groot Azië</b>       | <b>0.00</b>  |
| Japan                   | 0.00         |
| Australazië             | 0.00         |
| Azië - Ontwikkeld       | 0.00         |
| Azië - Emerging         | 0.00         |

Fondsinformatie

|                     |                  |                |              |                    |   |
|---------------------|------------------|----------------|--------------|--------------------|---|
| Fondsgroep          | Candriam         | Vestigingsland | Frankrijk    | Min Aanvangsbedrag | - |
| Telefoon            | +352 27975130    | Fondsvaluta    | EUR          | Min Additioneel    | - |
| Website             | www.candriam.com | UCITS          | ja           |                    |   |
| Oprichtingsdatum    | 9 sep 2003       | Inc/Acc        | Acc          |                    |   |
| Fondsmanager        | Emmanuel Terraz  | ISIN           | FR0010016477 |                    |   |
| Aanvangsdatum       | 9 sep 2003       |                |              |                    |   |
| Koers (25 apr 2024) | EUR 1,477.28     |                |              |                    |   |
| Fondsvermogen (mln) | EUR 121.77       |                |              |                    |   |