

Candriam Index Arbitrage Z

Morningstar Categorie Index

—

Benchmark van het fonds

€STR capitalisé Jour TR EUR

Morningstar Rating™

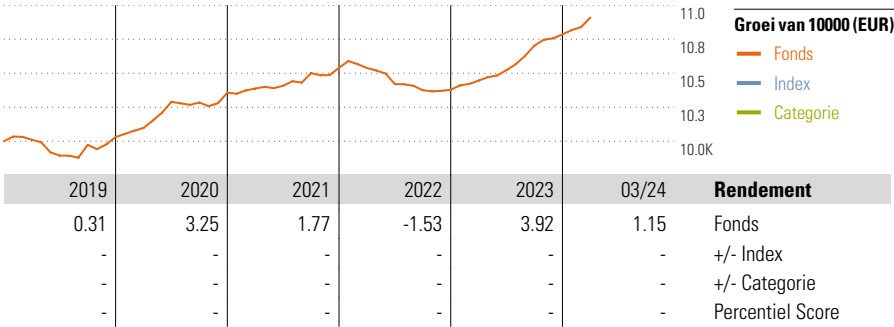
—

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	0.50
Beta	-	Std Deviatie	1.09
R-kwadraat	-	3-jr Risico	-
Informatie Ratio	-	5-jr Risico	-
Tracking Error	-	10-jr Risico	-

Rendementen (26 apr 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	1.48	-	-
6 Maanden	2.21	-	-
1 jaar	4.82	-	-
3 jr gean.	1.76	-	-
5 jr gean.	1.90	-	-

Kwartaalrendementen

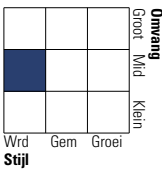
	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	1.15	-	-	-
2023	0.65	0.74	1.71	0.77
2022	-0.01	-1.12	-0.44	0.03
2021	0.29	0.20	0.89	0.37
2020	0.66	1.90	-0.05	0.70

Portefeuille 29 feb 2024

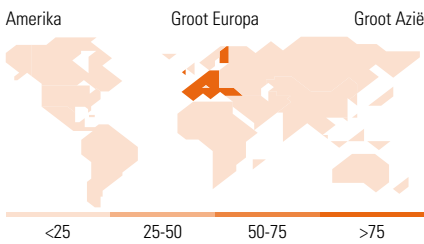
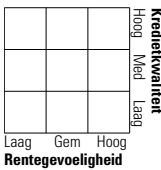
Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	3.05	0.61	2.44
Obligaties	75.63	0.00	75.63
Kas/ geldmarkt	23.85	1.97	21.87
Overig	0.06	0.00	0.06

Morningstar Style Box

Stijl Aandelen



Stijl vastrentend



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
European Investment Bank...	—	9.34
Italy (Republic Of)...	—	8.32
France (Republic Of)...	—	8.32
European Investment Bank...	—	8.32
SI-Eurofima 0.15%...	—	7.28
SI-Europe 0%...	—	7.28
Candriam Money Market Euro Z Acc	—	6.16
SI-Esm 1.8% 02/11/46-42046-11-02	—	5.19
European Financial Stability...	—	3.96
European Investment Bank...	—	3.90
Totaal Aantal Aandelen		118
Totaal Aantal Obligaties		15
% Van Vermogen In Top 10 Posities		68.07

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	62.21
Basismaterialen	19.28
Cyclische consumentenproducten	7.30
Financiële dienstverlening	33.04
Vastgoed	2.59
Licht Cyclisch	31.58
Communicatiediensten	4.24
Energie	18.45
Industrie	8.88
Technologie	0.01
Defensief	6.21
Defensieve consumptiegoederen	-
Gezondheidszorg	-
Nutsbedrijven	6.21

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	0.03
Verenigde Staten	0.03
Canada	0.00
Latijns Amerika	0.00
Groot Europa	99.97
Verenigd Koninkrijk	0.00
West Europa – Euro	96.61
West Europa – Niet Euro	0.00
Emerging Europa	3.36
Midden-Oosten / Afrika	0.00
Groot Azië	0.00
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	1 sep 2010	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Emmanuel Terraz	ISIN	FR0010896217		
Aanvangsdatum	9 sep 2003				
Koers (26 apr 2024)	EUR 1,663.45				
Fondsvermogen (mln)	EUR 108.72				