

Candriam Risk Arbitrage C

Morningstar Categorie Index

—

Benchmark van het fonds

€STR capitalisé Jour TR EUR

Morningstar Rating™

—

Morningstar Categorie™

Alt - Event Driven

Beleggingsdoelstelling

Candriam Risk Arbitrage is an absolute performance and a low-volatility UCITS IV fund, which implements arbitrage strategies on securities of companies that experience specific “Special Situations”. These are events likely to create discontinuity in the price of an asset (mergers, restructuring, etc.). Candriam Risk Arbitrage primarily invests in the European and North American markets. Its target is to outperform the Eonia over an 18-month investment horizon while maintaining low volatility (< 5 %).

Risicomaatstaven

Alpha	- Sharpe Ratio	-0.48
Beta	- Std Deviatie	2.27
R-kwadraat	- 3-jr Risico	-
Informatie Ratio	- 5-jr Risico	-
Tracking Error	- 10-jr Risico	-

Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling

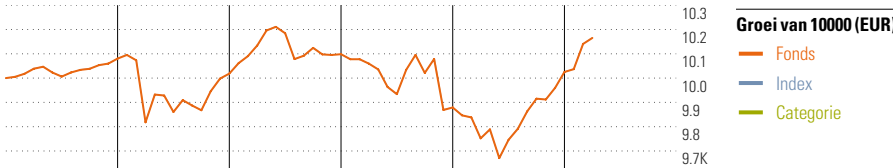
	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	11.17	0.34	10.84
Obligaties	68.80	0.00	68.80
Kas/ geldmarkt	20.44	0.07	20.36
Overig	0.00	0.00	0.00

Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
SI-Europe 0.45%...	—	16.50
European Investment Bank...	—	11.17
SI-Esm 1.2% 23/05/33-32033-05-23	—	11.01
SI-Kfw 0.625%...	—	10.97
European Financial Stability...	—	10.92
Candriam Monétaire SICAV Z C	—	9.87
France (Republic Of)...	—	4.56
Greenvolt - Energias...	💡	3.76
Applus Services SA	⚙️	3.29
Euronav NV	🔥	2.24
Totaal Aantal Aandelen		49
Totaal Aantal Obligaties		6
% Van Vermogen In Top 10 Posities		84.28

Fondsinformatie

Fondsgroep	Candriam
Telefoon	+352 27975130
Website	www.candriam.com
Oprichtingsdatum	28 mrt 1996
Fondsmanager	Fabienne CRETIN-FUMERON
Aanvangsdatum	1 sep 2018
Koers (23 apr 2024)	EUR 2,561.17
Fondsvermogen (mln)	EUR 14.71



	2019	2020	2021	2022	2023	03/24	Rendement
	0.80	-0.61	0.80	-2.17	1.48	1.40	Fonds
	-	-	-	-	-	-	+/- Index
	-	-	-	-	-	-	+/- Categorie
	-	-	-	-	-	-	Percentiel Score

Rendementen (23 apr 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	2.11	-	-
6 Maanden	3.22	-	-
1 jaar	4.34	-	-
3 jr gean.	0.21	-	-
5 jr gean.	0.37	-	-

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	1.40	-	-	-
2023	-1.29	-0.06	1.74	1.11
2022	-0.39	-1.25	0.88	-1.42
2021	1.16	0.50	-0.59	-0.26
2020	-2.60	0.43	0.07	1.53

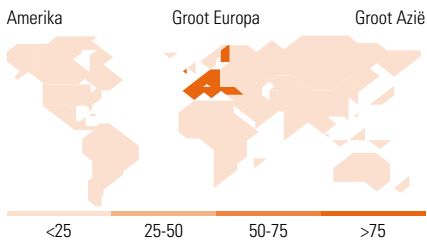
Morningstar Style Box

Stijl Aandelen

	Wrd	Gem	Groei
Omvang			
Groot			
Mid			
Klein			

Stijl vastrentend

	Laag	Gem	Hoog
Kredietkwaliteit			
Hoog			
Med			
Laag			



Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	0.03
Basismaterialen	-
Cyclische consumentenproducten	-
Financiële dienstverlening	-
Vastgoed	0.03
Licht Cyclisch	51.21
Communicatiediensten	-
Energie	20.73
Industrie	30.48
Technologie	-
Defensief	48.76
Defensieve consumptiegoederen	-
Gezondheidszorg	-
Nutsbedrijven	48.76

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	0.00
Verenigde Staten	0.00
Canada	0.00
Latijns Amerika	0.00
Groot Europa	100.00
Verenigd Koninkrijk	0.00
West Europa – Euro	100.00
West Europa – Niet Euro	0.00
Emerging Europa	0.00
Midden-Oosten / Afrika	0.00
Groot Azië	0.00
Japan	0.00
Australazië	0.00
Azië - Ontwikkeld	0.00
Azië - Emerging	0.00