INFORMAZIONI CHIAVE PER GLI INVESTITORI

Il presente documento contiene le informazioni chiave di cui tutti gli investitori devono disporre in relazione a questo fondo. Non si tratta di un documento promozionale. Le informazioni contenute nel presente documento, richieste dalla legge, hanno lo scopo di aiutarvi a capire la natura di questo fondo e i rischi ad esso connessi. Si raccomanda di prenderne visione, in modo da operare una scelta informata in merito all'opportunità di investire.

CANDRIAM
A NEW YORK LIFE INVESTMENTS COMPANY

Candriam Index Arbitrage, FCI

Quote C - Capitalizzazione: FR0010016477

Autorità competente: Autorité des Marchés Financiers
Società di gestione: Candriam

OBIETTIVI E POLITICA D'INVESTIMENTO

Obiettivo di gestione: Sulla durata di investimento consigliata e nell'ambito di una gestione completamente discrezionale, il fondo ha l'obiettivo di realizzare una performance superiore all'indice €STR (Euro Short Term Rate) Capitalizzato e una volatilità (indicatore delle fluttuazioni al rialzo o al ribasso del valore del fondo) annualizzata inferiore al 5% in condizioni normali di mercato.

Indicatore di riferimento: €STR (Euro Short Term Rate) Capitalizzato

Il fondo è gestito in modo attivo e il processo d'investimento implica la designazione di un indice di riferimento.

Utilizzo dell'indice:

- Per fini di calcolo della commissione di performance. per talune classi di azioni,

- per fini di confronto tra le performance.

Strategia d'investimento:

La gestione del portafoglio si articola attorno ad una strategia prudente del fondo di portafoglio tramite obbligazioni e strumenti del mercato monetario, e ad una strategia dinamica.

La strategia dinamica di investimento consiste in una strategia di arbitraggio sulle azioni, specie nell'ambito di riadeguamenti degli indici, di operazioni su titoli (quali società oggetto di una scissione) o di riduzione di valore degli attivi trattati.

La strategia di arbitraggio consiste nel trarre vantaggio dagli scostamenti di prezzo rilevati (o previsti) tra mercati e/o settori e/o valute e/o strumenti.

Il fondo non ha un obiettivo d'investimento sostenibile e non promuove in modo specifico caratteristiche ambientali e/o sociali.

Il team di gestione può ricorrere a prodotti derivati come swap, future, opzioni, CDS,... legati soprattutto ai rischi azionari, di tasso d'interesse, cambio. È anche possibile ricorrere a Total Return Swap (contratti di cambio sul rendimento globale), o altri strumenti finanziari derivati che presentano le medesime caratteristiche. L'utilizzo dei derivati è per fini di esposizione (buy o sell), di copertura o di arbitraggio.

Principali attivi trattati:

Azioni mondiali e quote/azioni di "fondi chiusi", investite direttamente e/o tramite prodotti derivati.

Nell'ambito della strategia del fondo di portafoglio: obbligazioni e altri titoli di credito, nonché strumenti del mercato monetario, emessi da qualunque tipo di emittente con rating a breve termine minimo A-2 (o equivalente) all'acquisizione, assegnato da un'agenzia di valutazione creditizia (ossia da emittenti ritenuti di buona qualità).

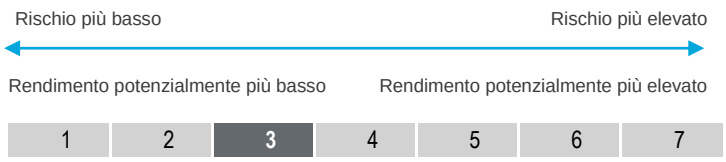
Frequenza dei riscatti: Su richiesta, ogni giorno, in Francia.

Le richieste saranno accettate fino alle ore 12.00 presso CACEIS BANK e saranno evase entro i tre giorni lavorativi successivi.

Destinazione degli utili: Capitalizzazione.

Raccomandazione: Questo fondo potrebbe non essere indicato per gli investitori che prevedono di ritirare il proprio capitale entro 3 anni.

PROFILO DI RISCHIO E DI RENDIMENTO



- Il livello di rischio riflette il massimo tra la volatilità storica del fondo da una parte, e la volatilità equivalente a quella derivante dal limite di rischio adottato dal fondo dall'altra parte. La volatilità indica in che misura il valore del fondo può fluttuare al rialzo o al ribasso.
- Questo livello di rischio 3 è riconducibile essenzialmente all'esposizione al rischio azionario.
- I dati storici, come quelli utilizzati per calcolare l'indicatore sintetico, potrebbero non costituire un'indicazione affidabile del profilo di rischio futuro dell'OIC.
- La categoria indicata potrebbe evolvere nel tempo.
- Categoria a rischio più basso non significa "senza rischio".
- Non esiste né garanzia né meccanismo di protezione del capitale.

Il rischi rilevanti per il fondo non considerati in questo indicatore sono i seguenti:

- **Rischio di controparte:** il fondo ha la facoltà di utilizzare i prodotti derivati negoziati fuori borsa e/o tecniche di gestione efficace del portafoglio; tali prodotti e/o tecniche possono comportare un rischio di controparte, qualora quest'ultima non sia in grado di onorare i propri impegni nei confronti del fondo.Il rischio di controparte può essere eventualmente coperto, in toto o in parte, tramite la ricezione di garanzie.
- **Rischio legato agli strumenti finanziari derivati**: il loro utilizzo comporta un rischio legato ai sottostanti e può accentuare alcuni movimenti al ribasso attraverso l'effetto leva che ne deriva.In caso di strategia di copertura, questa può risultare imperfetta.

SPESE

SPESE UNA TANTUM PRELEVATE PRIMA O DOPO L'INVESTIMENTO	
Spesa di sottoscrizione	1.00%
Spesa di rimborso	1.00%
Percentuale massima che può essere prelevata dal vostro capitale prima che venga investito e prima che il rendimento dell'investimento sia distribuito.	
SPESE PRELEVATE DAL FONDO IN UN ANNO	
Spese correnti	0.40%
SPESE PRELEVATE DAL FONDO A DETERMINATE CONDIZIONI SPECIFICHE	
Commissioni legate al rendimento	0.08% - (La percentuale rappresenta l'importo delle commissioni legate al rendimento applicate nel corso dell'ultimo esercizio e corrispondenti al 20% annuo di qualsiasi rendimento realizzato dal fondo che superi il valore di riferimento definito per questa commissione, ossia Eonia capitalizzato. A decorrere dal 01/10/2021, introduzione di una commissione di sovraperformance del 20% calcolata secondo la metodologia High Water Mark Permanent che si basa sulla sovraperformance del NAV rispetto all'indice di riferimento, nella fattispecie €STR (Euro Short Term Rate) Capitalizzato con livello minimo 0 e le cui condizioni sono definite nel prospetto).

Le spese e commissioni corrisposte dagli investitori sono usate per coprire i costi di gestione del fondo, compresi i costi legati alla commercializzazione e alla distribuzione delle sue quote, e riducono la crescita potenziale degli investimenti.

Spese di sottoscrizione e di rimborso:

Le cifre comunicate sono sempre cifre massime e, in alcuni casi, è possibile che l'investitore esborsi un importo inferiore.

L'investitore può informarsi circa l'importo effettivo presso il suo consulente finanziario o distributore.

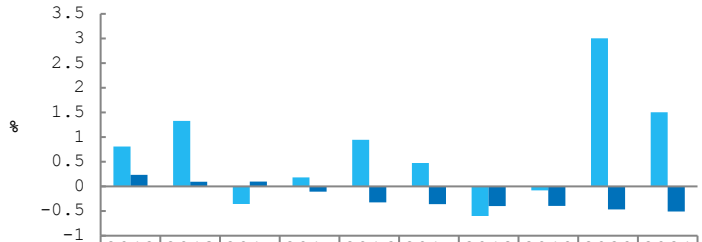
Spese correnti:

L'importo delle spese correnti si basa sulle spese dell'anno precedente, conclusosi al settembre 2021, e può eventualmente variare da un anno all'altro.

Le spese correnti non includono: le commissioni di sovraperformance e le spese d'intermediazione, salvo nel caso di spese di sottoscrizione e/o rimborso pagate dall'OIC in occasione dell'acquisto o della vendita di quote di un altro veicolo di gestione collettiva.

Ulteriori dettagli sulle spese sono disponibili nelle corrispondenti sezioni del prospetto accessibile tramite www.candriam.com.

RISULTATI OTTENUTI NEL PASSATO



	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021
Fondi	0.8	1.3	-0.4	0.2	0.9	0.5	-0.6	-0.1	3.0	1.5
Indice	0.2	0.1	0.1	-0.1	-0.3	-0.4	-0.4	-0.4	-0.5	-0.5

Le performance passate non sono indicative delle performance future.

Risultati netti annualizzati escluse spese una tantum prelevate prima o dopo l'investimento.

Anno di creazione della quota: 2003.

Valuta: EUR.

A partire dal 01/10/2021, l'indice "Eonia Capitalizzato" è stato sostituito da "€STR (Euro Short Term Rate) Capitalizzato".

INFORMAZIONI PRATICHE

Banca depositaria: CACEIS BANK.

Il presente documento descrive una categoria di quote di Candriam Index Arbitrage. Il prospetto e le relazioni periodiche sono redatti per l'insieme delle categorie. Esistono altre categorie di quote, il cui elenco è riportato nel prospetto.

Informazioni supplementari sul fondo sono fornite nel prospetto e nelle relazioni periodiche, disponibili gratuitamente su richiesta presso la sede legale della Società di Gestione e consultabili sul sito internet www.candriam.com. Tali documenti sono disponibili in una delle lingue accettate dall'autorità locale di ciascun paese in cui il fondo è autorizzato a commercializzare le sue quote o in una lingua usuale nel settore della finanza internazionale.

Qualsiasi altra informazione pratica, e in particolare il valore di liquidazione delle quote, è disponibile nei luoghi indicati sopra.

La legislazione fiscale dello Stato membro di origine del fondo può avere un impatto sulla posizione fiscale personale dell'investitore.

Le informazioni di dettaglio relative alla politica di remunerazione aggiornata, compresa la composizione del comitato per la remunerazione, una descrizione delle modalità di calcolo delle remunerazioni e dei benefici e di come questa politica sia coerente con la considerazione dei rischi e impatti di sostenibilità, sono pubblicate sul sito internet di Candriam al link: https://www.candriam.com/siteassets/legal-and-disclaimer/external_disclosure_remuneration_policy.pdf.

Su richiesta, sarà messa gratuitamente a disposizione una copia cartacea.

Candriam può essere ritenuta responsabile sulla base delle dichiarazioni contenute nel presente documento e delle relative traduzioni solo nel caso in cui dette dichiarazioni risultino fuorvianti, inesatte o incoerenti rispetto alle corrispondenti parti del prospetto.

Il presente fondo è autorizzato in Francia ed è regolamentato dall'Autorité des Marchés Financiers.
Le informazioni chiave per gli investitori qui riportate sono esatte alla data del 16/09/2022.