DATOS FUNDAMENTALES PARA EL INVERSOR

El presente documento recoge los datos fundamentales sobre este fondo que el inversor debe conocer. No se trata de material de promoción comercial. La ley exige que se facilite esta información para ayudarle a comprender la naturaleza del fondo y los riesgos que comporta invertir en él. Es aconsejable que lea el documento para poder tomar una decisión fundada sobre la conveniencia o no de invertir en él.

CANDRIAM
A NEW YORK LIFE INVESTMENTS COMPANY

Candriam Index Arbitrage, IIC

Participaciones C - Capitalización: FR0010016477

Autoridad competente:Autoridad de los Mercados Financieros
Sociedad Gestora: Candriam

OBJETIVOS Y POLITICA DE INVERSION

Objetivo de gestión: Durante el periodo de inversión aconsejado y en el marco de su gestión totalmente discrecional, el fondo pretende lograr un rendimiento superior al €STR (Euro Short Term Rate) Capitalizado y una volatilidad (indicador de las fluctuaciones tanto al alza como a la baja del valor del fondo) anualizada inferior al 5% en condiciones normales de mercado.

Índice de referencia: €STR (Euro Short Term Rate) Capitalizado

El fondo se gestiona de forma activa y el proceso de inversión conlleva la referencia a un índice de referencia.

Utilización del índice:

- para calcular la comisión de rendimiento para ciertas clases de acciones,

- para establecer una comparación de la rentabilidad.

Estrategia de inversión:

la gestión de la cartera se estructura en torno a una estrategia prudente del fondo de cartera mediante obligaciones e instrumentos del mercado monetario, y también en torno a una estrategia dinámica.

La estrategia dinámica de inversión es una estrategia de arbitraje sobre las acciones, concretamente en el marco de reajustes de índices, de operaciones sobre títulos (por ejemplo, sociedades afectadas por una escisión) o de depreciación de los activos negociados.

La estrategia de arbitraje consiste en aprovechar los diferenciales de precios constatados (o anticipados) entre mercados, sectores, monedas y/o instrumentos.

El Fondo no posee un objetivo de inversión sostenible y no promueve unas características específicamente medioambientales y/o sociales.

El equipo de gestión puede utilizar productos derivados como las permutas, los futuros, las opciones, las permutas de incumplimiento crediticio, etc., que están especialmente asociados a los riesgos de renta variable, de tipos de interés y de cambio. Asimismo, puede recurrir a contratos de permuta de rendimiento total (“Total Return Swap”) o a otros instrumentos financieros derivados que presentan las mismas características. Los derivados se emplean con fines de exposición (compradora o vendedora), de cobertura o de arbitraje.

Principales activos negociados:

Acciones mundiales y participaciones o acciones de “fondos cerrados” en las que se invierte directamente o mediante productos derivados.

En el marco de la estrategia del Fondo de cartera: bonos y otros títulos de deuda e instrumentos del mercado monetario, de todo tipo de emisores, que, en el momento de su adquisición, cuenten con una calificación a corto plazo de A-2 como mínimo (o equivalente) otorgada por una agencia de calificación (es decir, emisores considerados de buena calidad).

Frecuencia de los reembolsos: Bajo pedido, a diario, en Francia.

Las solicitudes se aceptan hasta las 12:00 en CACEIS BANK, y se abonarán en 3 días laborables.

Asignación de resultados: Capitalización.

Recomendación: Es posible que este fondo no sea idóneo para los inversores que prevean retirar su aportación en 3 años.

PERFIL DE RIESGO Y REMUNERACIÓN

Riesgo más bajo — Riesgo más alto

Rentabilidad potencialmente más baja — Rentabilidad potencialmente más alta

1	2	**3**	4	5	6	7

- El nivel de riesgo refleja el máximo entre, la volatilidad histórica del fondo por una parte y por otra, la volatilidad equivalente a la derivada del límite de riesgo adoptado por el fondo. La volatilidad indica la medida en la que el valor del fondo puede fluctuar tanto al alza como a la baja.
- Este nivel de riesgo 3 se deriva esencialmente de la exposición al riesgo de la renta variable.
- Los datos históricos, tales como los utilizados en el cálculo del indicador sintético, pueden no constituir una indicación fiable del futuro perfil de riesgo del OIC.
- La categoría indicada podrá evolucionar con el tiempo.
- La categoría de riesgo más bajo no significa que tenga "riesgo cero".
- No existe ninguna garantía ni mecanismo de protección del capital.

Los riesgos más importante para el fondo no considerados en este indicador son los siguientes:

- **Riesgo de contraparte:** teniendo en cuenta que el fondo puede utilizar productos derivados de común acuerdo y/o técnicas para la gestión eficaz de la cartera, estos productos y/o técnicas pueden representar un riesgo de contraparte, es decir, situaciones en las que ésta no pueda responder a sus obligaciones con respecto al fondo.Este riesgo de contraparte puede estar, en su caso, parcial o totalmente cubierto por la recepción de garantías.
- **Riesgo vinculado a los instrumentos financieros derivados**: su uso conlleva un riesgo asociado a sus subyacentes y puede acentuar los movimientos bajistas a causa del efecto de apalancamiento que se deriva de ello. En caso de estrategia de cobertura, es imposible que sea perfecta.

GASTOS

GASTOS NO RECURRENTES PERCIBIDOS CON ANTERIORIDAD O CON POSTERIORIDAD A LA INVERSION	
Gastos de entrada	1.00%
Gastos de salida	1.00%
El porcentaje indicado es el máximo que puede retenerse de su capital antes de su correspondiente inversión y antes de la distribución de la renta correspondiente a su inversión.	
GASTOS DETRAIDOS DEL FONDO A LO LARGO DE UN AÑO	
Gastos corrientes	0.40%
GASTOS DETRAIDOS DEL FONDO EN DETERMINADAS CONDICIONES ESPECIFICAS	
Comisión de rentabilidad	0.08% - (El porcentaje representa el importe de la comisión de rendimiento facturado el último ejercicio, que corresponde al 20% anual del rendimiento total obtenido por el fondo que supere el valor de referencia definido para esta comisión, es decir, el Eonia capitalizado. A partir del 01/10/2021, aplicación de una comisión de rendimiento extraordinario del 20% calculada según la metodología High Water Mark Permanent basada en el rendimiento extraordinario de la VNI con respecto al indicador de referencia, es decir €STR (Euro Short Term Rate) Capitalizado, con un «floor» de 0 y cuyas condiciones se encuentran definidas en el folleto).

Los gastos y comisiones abonados por los inversores sirven para cubrir los costes de explotación del fondo, incluyendo los costes de comercialización y de distribución de sus participaciones y reducen el crecimiento potencial de las inversiones.

Gastos de entrada y de salida:

Las cifras indicadas son los niveles máximos y en algunos casos, el inversor liquida un importe inferior.

El inversor puede solicitar a su asesor o a su distribuidor que le comunique el importe efectivo.

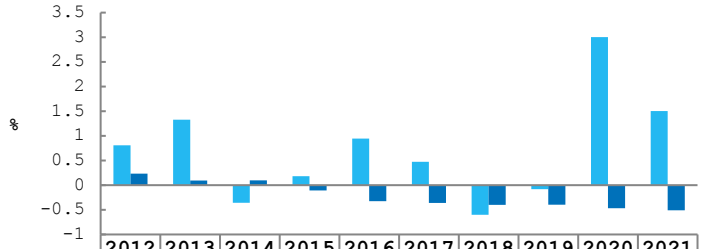
Gastos corrientes:

La cifra comunicada se funda en los gastos del ejercicio anterior, con cierre en septiembre 2021 y puede variar de un año a otro.

Los gastos corrientes no incluyen: las comisiones de rendimiento extraordinario ni los gastos de intermediación, salvo los gastos de entrada y/o de salida abonados por el OIC en el momento de la compra o la venta de participaciones de otro instrumento de inversión colectiva.

Si desea más información sobre los gastos, podrá consultar las secciones correspondientes del folleto accesible mediante www.candriam.com.

RENTABILIDAD HISTORICA



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

Las rentabilidades pasadas no presuponen rentabilidades futuras.

Rentabilidades netas anualizadas, excluyendo los gastos puntuales deducidos antes o después de la inversión.

Año de creación de la participación: 2003.

Moneda: EUR.

A partir del 01/10/2021, el índice «Eonia Capitalizado» ha sido sustituido por el «€STR (Euro Short Term Rate) Capitalizado».

INFORMACION PRACTICA

Banco depositario: CACEIS BANK.

Este documento describe una categoría de participaciones de Candriam Index Arbitrage. El folleto y los informes periódicos se establecen para todas las categorías. Las demás categorías de participaciones existentes se enumeran en el folleto.

Los inversores podrán recibir información adicional sobre el fondo solicitando el folleto y los informes periódicos correspondientes, de forma gratuita y en todo momento, al domicilio social de la Sociedad Gestora y consultándolos directamente en la página Web www.candriam.com. Estos documentos se encuentran disponibles en uno de los idiomas aceptados por la autoridad local de todos y cada uno de los países en los que el fondo ha sido autorizado para comercializar sus participaciones o en un idioma habitual de la esfera financiera internacional.

Cualquier otra información de utilidad y concretamente, el valor liquidativo de las participaciones, podrá obtenerse en los lugares indicados más arriba.

La legislación fiscal del estado miembro de origen del fondo puede tener una incidencia en la situación fiscal personal del inversor.

Los detalles de la política de remuneración actualizada, incluidas la composición del comité de remuneraciones, una descripción de la forma en la que se calculan las remuneraciones y los beneficios, así como la coherencia de esta política con la consideración de los riesgos e impactos de sostenibilidad, se encuentran disponibles en el sitio web de Candriam a través del enlace https://www.candriam.com/siteassets/legal-and-disclaimer/external_disclosure_remuneration_policy.pdf.

Se podrá obtener gratuitamente un ejemplar impreso de esta información previa petición.

La responsabilidad de Candriam se limitará a las declaraciones recogidas en el presente documento y sus traducciones que sean engañosas, inexactas o incoherentes con respecto a las partes correspondientes del Folleto.

Este fondo está autorizado en Francia y está regulado por la Autorité des Marchés Financiers.
Los presentes datos fundamentales para el inversor son exactos a 16/09/2022.