

Unselbständiger Investmentfonds (FCP) nach
französischem Recht

HALBJAHRESBERICHT

CANDRIAM INDEX ARBITRAGE

zum 31. März 2025

Verwaltungsgesellschaft: CANDRIAM

Abschlussprüfer: PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDIT

CANDRIAM - 19-21 route d'Arlon - L-8009 Strassen - Großherzogtum Luxemburg

VERMÖGENSAUFSTELLUNG IN EUR

Elemente der Vermögensaufstellung	Betrag des Zwischenabschlusses (*)
a) Zulässige Wertpapiere im Sinne von Artikel L.214-20 Abschnitt I Punkt 1 des französischen Code Monétaire et Financier	7 454 700,00
b) Bankguthaben	16 615 957,62
c) Sonstige vom OGA gehaltene Vermögenswerte	237 543 906,61
d) Vermögenswerte im Bestand des OGA insgesamt (Zeilen a+b+c)	261 614 564,23
e) Passiva	-7 278 301,74
f) Nettoinventarwert (Zeilen d+e = Nettovermögen des OGA)	254 336 262,49

(*) Die Beträge weisen Vorzeichen auf.

ANZAHL DER IM UMLAUF BEFINDLICHEN ANTEILE UND NETTOINVENTARWERT JE ANTEIL

Anteil	Art des Anteils	Nettovermögen der Anteilsklasse	Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil CLASSIQUE EUR in EUR	C	108 019 875,73	71 025,375	1 520,86
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil I in EUR	C	7 492 299,82	4 465,715	1 677,73
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil R in EUR	C	24 296 718,98	216 684,668	112,12
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil R2 in EUR	C	60 414,19	357,188	169,13
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil RS in EUR	C	2 289 883,07	2 000,100	1 144,88
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil U in EUR	C	17 083 412,78	100 682,124	169,67
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil V in EUR	C	16 686 879,68	14 516,808	1 149,48
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil Z in EUR	C	78 406 778,24	45 669,732	1 716,82

ELEMENT DES WERTPAPIERBESTANDS

Elemente des Wertpapierbestands	Prozentsatz Nettovermögen (*)	Prozentsatz Vermögenswerte insgesamt (**)
A) Zulässige Wertpapiere und die Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden, im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Code Monétaire et financier. Und B) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem sonstigen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist und in einem Mitgliedsstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Unterzeichnerstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum liegt, gehandelt werden.	2,93	2,85
C) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer geregelten Wertpapierbörse eines Drittlandes amtlich notiert sind oder an einem sonstigen Markt eines Drittlandes gehandelt werden, die/der für das Publikum offen, anerkannt ist und ordnungsgemäß funktioniert, sofern diese Börse bzw. dieser Markt nicht auf einer von der Autorité des Marchés Financiers erstellten Liste der ausgeschlossenen Länder steht bzw. sofern die Wahl dieser Börse bzw. dieses Marktes in den gesetzlichen Vorschriften und/oder den Vertragsbedingungen oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist.	0,00	0,00
D) Zulässige Wertpapiere aus Neuemissionen im Sinne von Artikel R214-11 Abschnitt I Punkt 4 des französischen Code Monétaire et Financier.	0,00	0,00
E) Sonstige Vermögenswerte.	8,66	8,42

(*) Siehe f) in der Vermögensaufstellung

(**) Siehe d) in der Vermögensaufstellung

AUFTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE VON A), B), C) UND D) DES WERTPAPIERBESTANDS, NACH WÄHRUNG

Wertpapiere	Währung	Als Betrag (EUR)	Prozentsatz Nettovermögen (*)	Prozentsatz Vermögenswerte insgesamt (**)
Euro	EUR	7 454 700,00	2,93	2,85
INSGESAMT		7 454 700,00	2,93	2,85

(*) Siehe f) in der Vermögensaufstellung

(**) Siehe d) in der Vermögensaufstellung

AUFTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE VON A), B), C) UND D) DES WERTPAPIERBESTANDS, NACH SITZLAND DES EMITTENTEN

Land	Prozentsatz Nettovermögen (*)	Prozentsatz Vermögenswerte insgesamt (**)
NIEDERLANDE	0,97	0,94
DEUTSCHLAND	0,89	0,86
ITALIEN	0,44	0,43
BELGIEN	0,33	0,32
ÖSTERREICH	0,17	0,17
PORTUGAL	0,13	0,13
INSGESAMT	2,93	2,85

(*) Siehe f) in der Vermögensaufstellung

(**) Siehe d) in der Vermögensaufstellung

AUFTEILUNG DER SONSTIGEN VERMÖGENSWERTE VON E) DES WERTPAPIERBESTANDS, NACH ART

Art der Vermögenswerte	Prozentsatz Nettovermögen (*)	Prozentsatz Vermögenswerte insgesamt (**)
OGAW und vergleichbare Fonds aus anderen Mitgliedstaaten der Europäischen Union	8,66	8,42
Andere OGA und Investmentfonds	0,00	0,00
AIF und vergleichbare Fonds aus anderen Mitgliedstaaten der Europäischen Union	0,00	0,00
Sonstige	0,00	0,00
INSGESAMT	8,66	8,42

(*) Siehe f) in der Vermögensaufstellung

(**) Siehe d) in der Vermögensaufstellung

VERÄNDERUNGEN DES WERTPAPIERBESTANDS IM LAUFE DES ZEITRAUMS IN EUR

Elemente des Wertpapierbestands	Veränderungen (als Betrag)	
	Käufe	Verkäufe
A) Zulässige Wertpapiere und die Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden, im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Code Monétaire et financier. Und B) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem sonstigen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist und in einem Mitgliedsstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Unterzeichnerstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum liegt, gehandelt werden.	17 612 331,65	13 715 075,31
C) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer geregelten Wertpapierbörse eines Drittlandes amtlich notiert sind oder an einem sonstigen Markt eines Drittlandes gehandelt werden, die/der für das Publikum offen, anerkannt ist und ordnungsgemäß funktioniert, sofern diese Börse bzw. dieser Markt nicht auf einer von der Autorité des Marchés Financiers erstellten Liste der ausgeschlossenen Länder steht bzw. sofern die Wahl dieser Börse bzw. dieses Marktes in den gesetzlichen Vorschriften und/oder den Vertragsbedingungen oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist.	0,00	0,00
D) Zulässige Wertpapiere aus Neuemissionen im Sinne von Artikel R214-11 Abschnitt I Punkt 4 des französischen Code Monétaire et Financier.	0,00	0,00
E) Sonstige Vermögenswerte.	23 026 937,00	26 452 510,00

INFORMATION ÜBER VARIABLE VERWALTUNGSGEBÜHREN

	31/03/2025
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil CLASSIQUE EUR	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	478,91
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil I	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	904,16
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,01
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil R	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	240,11
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil R2	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	4,49
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,01
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil RS	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil U	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	146,20
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil V	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	335,04
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00

»Die oben ausgewiesene Höhe der variablen Verwaltungsgebühren entspricht der Summe aus Rückstellungen und Auflösungen von Rückstellungen, die das Nettovermögen in der Berichtsperiode beeinflusst haben.«

	31/03/2025
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil Z	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	704,58
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00

»Die oben ausgewiesene Höhe der variablen Verwaltungsgebühren entspricht der Summe aus Rückstellungen und Auflösungen von Rückstellungen, die das Nettovermögen in der Berichtsperiode beeinflusst haben.«

AUFSTELLUNG DER AKTIVA UND PASSIVA

Aufstellung der Bilanzpositionen

Bezeichnung der Wertpapiere nach Wirtschaftssektor (*)	Währung	Stückzahl/Ne nnwert	Zeitwert	% Nettover mögen
AKTIEN UND ÄHNLICHE WERTPAPIERE			7 454 700,00	2,93
An einem geregelten Markt gehandelte Aktien und ähnliche Wertpapiere			7 454 700,00	2,93
Versicherungen			1 709 170,00	0,67
AGEAS	EUR	15 000	830 250,00	0,32
ALLIANZ SE-REG	EUR	2 000	704 200,00	0,28
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG AG	EUR	300	174 720,00	0,07
Geschäftsbanken			2 250 820,00	0,89
BANCA MEDIOLANUM SPA	EUR	20 000	297 400,00	0,12
BCP BCO	EUR	600 000	334 320,00	0,13
ING GROEP NV	EUR	90 000	1 619 100,00	0,64
Bau- und Ingenieurwesen			392 500,00	0,15
HOCHTIEF AG	EUR	2 500	392 500,00	0,15
Medizinische Geräte und Materialien			744 150,00	0,29
SIEMENS HEALTHINEERS AG	EUR	15 000	744 150,00	0,29
Warenhäuser und sonstige			851 500,00	0,33
PROSUS NV	EUR	20 000	851 500,00	0,33
Luftfahrt- und Verteidigungsindustrie			247 000,00	0,10
HENSOLDT AG	EUR	4 000	247 000,00	0,10
Software			422 400,00	0,17
BRUNELLO CUCINELLI SPA	EUR	4 000	422 400,00	0,17
Kapitalmärkte			154 180,00	0,06
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	EUR	6 500	154 180,00	0,06
Baustoffe			397 980,00	0,16
BUZZI SPA	EUR	9 000	397 980,00	0,16
Diversifizierte Finanzdienstleistungen			285 000,00	0,11
BAWAG GROUP AG	EUR	3 000	285 000,00	0,11
ANTEILE AN OGA			22 031 990,00	8,66
OGAW			22 031 990,00	8,66
Kollektive Verwaltung			22 031 990,00	8,66
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z EUR ACC	EUR	2 000	2 814 260,00	1,11
CANDRIAM MONEY MARKET EURO AAA Z EUR ACC	EUR	7 000	7 965 300,00	3,13
CANDRIAM RISK ARBITRAGE Z EUR ACC	EUR	7 000	11 252 430,00	4,42
IN PENSION GENOMMENE WERTPAPIERE			203 141 148,00	79,87
An einem geregelten Markt gehandelte Anleihen und ähnliche Wertpapiere			203 141 148,00	79,87
Geschäftsbanken			79 624 507,00	31,31
EFSS 0.75% 03-05-27	EUR	21 920 000	21 242 672,00	8,35
EUROF 0.15 10/10/34	EUR	44 220 000	34 347 885,00	13,51
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU KFW 2.625% 26-04-29	EUR	23 300 000	24 033 950,00	9,45

Aufstellung der Bilanzpositionen

Bezeichnung der Wertpapiere nach Wirtschaftssektor (*)	Währung	Stückzahl/Ne nnwert	Zeitwert	% Nettover mögen
Versorger			123 516 641,00	48,56
BANQUE EUROPEAN D INVESTISSEMENT BEI ZCP 05-11-26	EUR	31 250 000	30 000 000,00	11,79
EUROPEAN FINL STABILITY FACIL 0.4% 31-05-26	EUR	12 580 000	12 269 400,00	4,82
EUROPEAN STABILITY MECHANISM 2.75% 15-09-34	EUR	17 540 000	17 504 920,00	6,88
EUROPEAN UNION 3.25% 04-07-34	EUR	24 055 000	25 000 000,00	9,83
EUROPEAN UNION 3.375% 04-10-38	EUR	6 033 000	6 000 000,00	2,36
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.15% 15-11-31	EUR	20 850 000	20 741 850,00	8,16
OAT 0% 250426 DEM	EUR	12 378 000	12 000 471,00	4,72
FORDERUNGEN AUS IN PENSION GENOMMENEN WERTPAPIEREN			937 544,13	0,37
Summe			233 565 382,13	91,83

(*) Der Wirtschaftszweig spiegelt die Hauptgeschäftstätigkeit des Emittenten des Finanzinstruments wider; die Angabe stammt aus zuverlässigen international anerkannten Quellen (hauptsächlich GICS und NACE).

Aufstellung der Devisentermingeschäfte

Art der Transaktion	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)			
	Aktiva	Passiva	Forderungen aus Devisen (+)		Verbindlichkeiten aus Devisen (-)	
			Währung	Betrag (*)	Währung	Betrag (*)
Summe	0,00	0,00		0,00		0,00

(*) Der Betrag wird gemäß den Bestimmungen des Reglements zur Darstellung von Risikopositionen bestimmt und in der Rechnungswährung angegeben.

Aufstellung der Finanztermingeschäfte

Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Aktien

Art des Geschäfts	Stückzahl/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
1. Futures				
DJES BANKS 0625	-575	170 629,64	0,00	-5 228 187,50
E-MIN RUS 200 0625	25	0,00	-53 271,15	2 345 746,16
EURO STOXX 50 0625	-93	151 969,88	0,00	-4 825 770,00
FTSE 100 FUT 0625	-26	22 339,42	0,00	-2 669 438,97
NASDAQ 100 E- 0625	-7	92 773,64	0,00	-2 519 468,62
ONK TOKYO NIK 0625	-7	742,88	0,00	-1 545 317,48
OSE TOPIX FUT 0625	0,00	0,00	0,00	0,00
SP 500 MINI 0625	-11	41 883,06	0,00	-2 878 436,86
XAE ENERGY SE 0625	15	23 212,78	0,00	1 371 551,56
XEUR FSMI SWI 0625	1	0,00	-4 111,95	130 557,15
Zwischensumme 1.		503 551,30	-57 383,10	-15 818 764,56
2. Optionen				
Zwischensumme 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Zwischensumme 3.		0,00	0,00	0,00
4. Sonstige Instrumente				
BC FLUTTER ENTERTAIN	13 500	0,00	-233 711,81	2 768 862,25
CFD BC ALBERTSO 1230	-86 000	0,00	-67 378,08	-1 750 731,35
CFD BC ALLISON 1230	1 350	0,00	-3 079,41	119 565,36
CFD BC BENTLEY 1230	3 150	0,00	-10 210,98	114 720,42
CFD BC BOOZ ALL 1230	1 250	1 012,54	0,00	121 019,26
CFD BC CARVANA 1230	721	2 658,23	0,00	139 554,42
CFD BC CLEARWAT 1230	4 500	0,00	-14 830,59	111 645,99
CFD BC COCA-COL 1230	-37 000	0,00	-47 786,24	-2 981 031,29
CFD BC CRH PLC 1230	10 000	0,00	-58 254,95	814 386,22
CFD BC DATADOG 1230	1 239	0,00	-12 853,74	113 794,84
CFD BC DUTCH BR 1230	2 000	0,00	-27 032,03	114 312,16
CFD BC ESSILORL 1230	650	0,00	-822,19	172 510,00
CFD BC GITLAB I 1230	2 250	0,00	-25 057,03	97 898,54
CFD BC INDIVIOR 1230	9 000	0,00	-2 801,15	79 401,96
CFD BC INDUSTRI 1230	3 500	0,00	-1 621,90	160 475,00
CFD BC INTERMED 1230	14 000	0,00	-64 575,49	326 892,51
CFD BC KADANT I 1230	-3 500	114 312,16	0,00	-1 091 635,81
CFD BC KROGER C 1230	6 700	0,00	-311,99	419 850,95
CFD BC OKTA INC 1230	1 200	0,00	-8 501,09	116 889,46
CFD BC QXO INC 1230	3 000	3 304,94	0,00	37 604,15
CFD BC ROBINHOO 1230	3 060	0,00	-8 790,85	117 901,50
CFD BC ROYALTY 1230	4 100	0,00	-10 361,97	118 156,82
CFD BC RYANAIR 1230	12 000	0,00	-20 371,20	223 500,00
CFD BC SAMSARA 1230	13 200	0,00	-37 839,66	468 391,04
CFD BC SOFI TEC 1230	10 000	0,00	-17 174,13	107 665,25
CFD BC SPROUTS 1230	3 500	64 317,44	0,00	494 575,08

Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Aktien

Art des Geschäfts	Stückzahl/Nennwert t	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
CFD BC SQUARE I 1230	2 262	0,00	-12 608,58	113 770,10
CFD BC TESCO PL 1230	40 000	0,00	-210,31	158 833,72
CFD BC VAR ENER 1230	110 000	21 556,31	0,00	327 791,20
CFD BC VEEVA SY 1230	550	6 456,21	0,00	117 937,88
CFD CGMD BLACKR 1230	3 000	0,00	-15 373,54	2 628 624,33
CFD CGMD M & T 1230	8 000	3 306,80	0,00	1 323 828,92
CFD CGMD US BAN 1230	60 000	0,00	-35 154,60	2 345 121,27
CFD CGMD VISA I 1230	-5 000	0,00	-68 971,95	-1 622 199,59
CFD CHA BFAM US 1230	1 100	0,00	-1 619,14	129 368,64
CFD CHAS ADM US 1230	-45 000	0,00	-80 143,49	-2 000 046,29
CFD CHAS GIS US 1230	-22 000	0,00	-23 780,04	-1 217 718,94
CFD CHAS HAL US 1230	-50 000	0,00	-29 503,80	-1 174 319,57
CFD CHAS SHW US 1230	-4 000	0,00	-19 433,07	-1 293 056,84
CFD CHAS SIKA C 1230	6 000	0,00	-401,78	1 338 425,32
CFD CH UNILEVER 1230	0,00	0,00	0,00	0,00
CFD CITI MAGN U 1230	3 850	0,00	-3 884,93	64 725,05
CFD CRH JPM USD 1230	1 400	0,00	-6 885,95	114 014,07
CFD JP ADIDAS 1230	-6 000	44 596,20	0,00	-1 300 200,00
CFD JP ADVANCED 1230	3 500	3 368,13	0,00	332 892,06
CFD JP CONOCOPH 1230	-27 000	0,00	-78 250,51	-2 625 013,89
CFD JP KONINKLI 1230	-5 000	0,00	-2 950,00	-172 800,00
CFD JPMC AMADEU 1230	-2 400	10 512,00	0,00	-169 200,00
CFD JPMC GENMAB 1230	-425	16 804,95	0,00	-76 334,34
CFD JPM COLOPLA 1230	-850	5 559,87	0,00	-82 395,52
CFD JPMC VOLVO 1230	-5 750	23 422,45	0,00	-155 372,46
CFD JPM IAG EUR 1230	109 000	0,00	-116 085,00	339 971,00
CFD JPM SWISS L 1230	-105	0,00	-681,14	-88 218,68
CFD JPX AGNC IN 1230	12 800	0,00	-8 413,26	113 519,72
CFD JPX APPLOVI 1230	502	0,00	-20 479,28	123 139,18
CFD JPX ARES MA 1230	876	0,00	-13 091,67	118 894,98
CFD JPX AXIS CA 1230	1 400	3 395,67	0,00	129 916,68
CFD JPX BELIMO 1230	400	0,00	-26 575,99	226 419,04
CFD JPX CAVA GR 1230	0,00	0,00	0,00	0,00
CFD JPX CHENIER 1230	620	6 186,53	0,00	132 816,15
CFD JPX CIE FI 1230	-8 000	115 092,86	0,00	-1 280 251,11
CFD JPX COINBAS 1230	630	0,00	-17 646,73	100 448,90
CFD JPX COREBRI 1230	4 000	0,00	-9 738,94	116 904,28
CFD JPX DRAFTKI 1230	-13 000	66 970,10	0,00	-399 675,99
CFD JPX ENTEGRI 1230	-14 000	192 714,50	0,00	-1 133 790,04
CFD JPX EXXON M 1230	24 000	75 439,36	0,00	2 642 399,56
CFD JPX HUBSPOT 1230	213	0,00	-22 146,79	112 650,22
CFD JPX JOHNSON 1230	0,00	0,00	0,00	0,00
CFD JPX KONINKL 1230	57 000	0,00	-108 300,00	1 332 090,00
CFD JPX LAM RES 1230	4 500	0,00	-26 552,17	302 860,58
CFD JPX MARTIN 1230	-1 000	8 437,33	0,00	-442 630,99

Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Aktien

Art des Geschäfts	Stückzahl/Nennwert t	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
CFD JPX MEDTRON 1230	-16 000	65 765,60	0,00	-1 331 012,78
CFD JPX MERCK & 1230	-45 000	161 879,74	0,00	-3 739 307,54
CFD JPX NATURGY 1230	11 000	9 240,00	0,00	282 920,00
CFD JPX NIKE IN 1230	22 000	0,00	-63 541,75	1 292 871,69
CFD JPX NOVARTI 1230	0,00	0,00	0,00	0,00
CFD JPX PEPSICO 1230	9 400	0,00	-52 647,66	1 304 791,71
CFD JPX PFIZER 1230	100 000	0,00	-87 752,27	2 345 861,88
CFD JPX RAIFFEI 1230	3 500	0,00	-5 530,00	83 020,00
CFD JPX ROCHE H 1230	-4 000	69 925,40	0,00	-1 215 799,11
CFD JPX SANOFI 1230	25 000	0,00	-104 936,30	2 548 000,00
CFD JPX SS&C TE 1230	1 500	0,00	-6 512,68	115 992,41
CFD JPX TECHNIP 1230	5 200	18 559,90	0,00	152 553,23
CFD JPX TERADYN 1230	3 250	0,00	-83 169,86	248 518,79
CFD JPX TRANSUN 1230	1 500	0,00	-9 277,07	115 242,55
CFD JPX VULCAN 1230	-2 000	13 488,61	0,00	-431 957,04
CFD LONN JP MOR 1230	-140	5 185,46	0,00	-79 422,44
CFD MSE FLUGHAF 1230	1 700	0,00	-24 190,43	372 105,68
CFD MSE WEIR GR 1230	13 000	0,00	-22 369,60	360 399,12
CFD UBS BROOKFI 1230	18 500	0,00	-11 823,92	829 776,89
CFD UBS DANONE 1230	2 500	0,00	-31,50	177 100,00
CFD UBS DOORDAS 1230	-12 000	87 126,09	0,00	-2 029 846,32
CFD UBS ELEMENT 1230	-35 000	84 645,44	0,00	-732 595,82
CFD UBS FAST RE 1230	6 000	0,00	-818,28	1 636 568,10
CFD UBS HSBC HD 1230	150 000	0,00	-14 267,79	1 566 409,75
CFD UBS KRATOS 1230	-27 000	27 764,86	0,00	-742 112,57
CFD UBS NATIONA 1230	15 000	297,54	0,00	180 946,41
CFD UBS RYMAN H 1230	-9 000	25 092,85	0,00	-761 858,92
CFD UBS SHOPIFY 1230	8 900	0,00	-42 757,31	785 897,52
CFD UBS TERNA-R 1230	-20 000	0,00	-1 250,00	-167 280,00
CFD UBS TOYOTA 1230	5 000	0,00	-5 540,66	80 974,09
CFD UBS WILLSCO 1230	-30 000	53 909,46	0,00	-772 079,24
CH NESTLE CHF 1230	-17 000	0,00	-13 162,44	-1 589 097,57
CH TOTALENERGIES EUR	-33 000	24 152,70	0,00	-1 968 780,00
JPM BP PLC 1230	380 000	0,00	-50 085,44	1 980 259,31
JPX DASSAULT SYSTEME	-2 150	9 137,50	0,00	-75 121,00
JPX DIAGEO PL 1230	-55 000	13 400,85	0,00	-1 323 982,79
JPX PERNOD RI 1230	15 000	0,00	-12 114,00	1 368 900,00
LVMH MOET HENNESSY L	2 060	0,00	-69 177,89	1 177 702,00
UBS BANKINTER 1230	123 000	21 172,50	0,00	1 260 135,00
UBS RESTAURAN 1230	13 700	0,00	-9 081,42	845 184,23
UBS SHELL PLC 1230	25 000	29 031,49	0,00	843 938,58
Zwischensumme 4.		1 509 200,57	-2 112 287,41	6 086 129,13
Summe		2 012 751,87	-2 169 670,51	-9 732 635,43

(*) Der Betrag wird gemäß den Bestimmungen des Reglements zur Darstellung von Risikopositionen bestimmt.

Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Aktien

Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Zinssätze

Art des Geschäfts	Stückzahl/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
1. Futures				
Zwischensumme 1.		0,00	0,00	0,00
2. Optionen				
Zwischensumme 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Zwischensumme 3.		0,00	0,00	0,00
4. Sonstige Instrumente				
Zwischensumme 4.		0,00	0,00	0,00
Summe		0,00	0,00	0,00

(*) Der Betrag wird gemäß den Bestimmungen des Reglements zur Darstellung von Risikopositionen bestimmt.

Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Wechselkurse

Art des Geschäfts	Stückzahl/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
1. Futures				
Zwischensumme 1.		0,00	0,00	0,00
2. Optionen				
Zwischensumme 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Zwischensumme 3.		0,00	0,00	0,00
4. Sonstige Instrumente				
Zwischensumme 4.		0,00	0,00	0,00
Summe		0,00	0,00	0,00

(*) Der Betrag wird gemäß den Bestimmungen des Reglements zur Darstellung von Risikopositionen bestimmt.

Aufstellung der Finanztermingeschäfte - auf das Kreditrisiko

Art des Geschäfts	Stückzahl/Nennwert t	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
1. Futures				
Zwischensumme 1.		0,00	0,00	0,00
2. Optionen				
Zwischensumme 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Zwischensumme 3.		0,00	0,00	0,00
4. Sonstige Instrumente				
Zwischensumme 4.		0,00	0,00	0,00
Summe		0,00	0,00	0,00

(*) Der Betrag wird gemäß den Bestimmungen des Reglements zur Darstellung von Risikopositionen bestimmt.

Aufstellung der Finanztermingeschäfte - andere Risikopositionen

Art des Geschäfts	Stückzahl/Nennwert t	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
1. Futures				
Zwischensumme 1.		0,00	0,00	0,00
2. Optionen				
Zwischensumme 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Zwischensumme 3.		0,00	0,00	0,00
4. Sonstige Instrumente				
CFD BARC LION U 1230	6 000	0,00	-4 610,26	41 492,32
CFD BC ABACUS L 1230	6 000	0,00	-1 777,45	41 603,41
CFD BC ABEONA T 1230	7 000	0,00	-2 138,49	30 846,14
CFD BC ACLARIS 1230	17 000	0,00	-6 767,27	24 078,87
CFD BC AMYLYX P 1230	12 000	5 998,89	0,00	39 326,05
CFD BC ATOMERA 1230	3 000	0,00	-3 693,76	11 067,39
CFD BC ATYR PHA 1230	13 500	0,00	-3 499,35	37 743,01
CFD BC BLAIZE H 1230	8 500	0,00	-7 239,40	15 895,20
CFD BC BUTTERFL 1230	13 600	0,00	-9 568,60	28 705,80
CFD BC C & F FI 1230	500	0,00	-5 174,97	31 193,30
CFD BC CALUMET 1230	7 900	0,00	-5 704,50	92 734,68
CFD BC CASELLA 1230	1 300	0,00	-2 707,83	134 200,15
CFD BC CITIZENS 1230	7 000	0,00	-2 656,92	29 485,28
CFD BC CLEARPOI 1230	3 800	0,00	-5 839,66	41 827,44
CFD BC CLOVER H 1230	52 000	0,00	-2 406,96	172 819,85
CFD BC COMPUTER 1230	2 500	0,00	-4 351,05	63 691,91
CFD BC CORVUS P 1230	4 900	0,00	-3 492,87	14 425,11
CFD BC CREDO TE 1230	3 250	0,00	-5 576,63	120 829,48
CFD BC DELCATH 1230	4 200	0,00	-2 410,66	49 496,39
CFD BC EHEALTH 1230	4 000	0,00	-7 257,92	24 736,16
CFD BC ELEDON P 1230	10 000	0,00	-5 878,54	31 197,93
CFD BC EMERGENT 1230	5 000	0,00	-9 118,68	22 495,83
CFD BC ETON PHA 1230	3 700	0,00	-7 021,85	44 460,29
CFD BC EXPENSIF 1230	12 000	0,00	-5 998,89	33 771,52
CFD BC FB BANCO 1230	4 000	0,00	-518,42	41 695,98
CFD BC FERROGLO 1230	12 000	3 777,08	0,00	41 214,59
CFD BC FINANCE 1230	2 500	0,00	-2 869,84	49 203,85
CFD BC FIRSTSUN 1230	1 200	0,00	-4 221,44	40 159,23
CFD BC FIRST UN 1230	1 100	0,00	-5 234,22	30 570,26
CFD BC FLOTEK I 1230	5 500	4 887,98	0,00	42 413,44
CFD BC GARRETT 1230	9 000	0,00	-10 581,37	69 737,09
CFD BC GENIUS S 1230	20 000	10 751,71	0,00	185 336,05
CFD BC GEVO INC 1230	30 000	0,00	-3 332,72	32 216,26
CFD BC GINKGO B 1230	5 400	0,00	-11 547,86	28 494,72
CFD BC GOSSAMER 1230	35 000	0,00	-2 592,11	35 641,55
CFD BC INHIBIKA 1230	12 000	0,00	-888,72	24 328,83
CFD BC INNVENTU 1230	3 500	0,00	-1 425,66	24 981,48
CFD BC LIFEVANT 1230	2 000	0,00	-4 147,38	26 995,00

Art des Geschäfts	Stückzahl/Nennwert t	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
CFD BC NATIONAL 1230	5 200	0,00	-3 417,89	35 430,48
CFD BC NAVIGATO 1230	3 500	0,00	-435,47	43 126,27
CFD BC ORUKA TH 1230	4 500	1 458,06	0,00	42 742,08
CFD BC REZOLUTE 1230	9 500	0,00	-10 905,39	25 504,54
CFD BC SENSEONI 1230	41 000	0,00	-8 118,77	24 902,89
CFD BC SILA REA 1230	6 700	7 443,07	0,00	165 670,25
CFD BC SUMMIT M 1230	1 200	0,00	-9 687,09	37 648,58
CFD BC TECTONIC 1230	900	0,00	-4 749,12	14 755,60
CFD CGMD CONCEN 1230	15 494	1 434,36	0,00	311 256,99
CFD CGMD SELECT 1230	19 200	0,00	-12 442,14	296 833,92
Zwischensumme 4.		35 751,15	-212 008,12	2 848 983,44
Summe		35 751,15	-212 008,12	2 848 983,44

(*) Der Betrag wird gemäß den Bestimmungen des Reglements zur Darstellung von Risikopositionen bestimmt.

Aufstellung der Finanztermingeschäfte oder Devisentermingeschäfte, die zur Absicherung einer Anteilsklasse eingesetzt werden

Diese Rubrik findet für den berichtenden OGA keine Anwendung.

Zusammenfassende Aufstellung

	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert
Gesamtaufstellung zulässiger Aktiva und Passiva (ohne Finanztermingeschäfte)	233 565 382,13
Aufstellung der Finanztermingeschäfte (ohne Geschäfte zur Absicherung ausgegebener Anteile):	
Summe Devisentermingeschäfte	0,00
Summe Finanztermingeschäfte - Aktien	-156 918,64
Summe Finanztermingeschäfte - Zinsen	0,00
Summe Finanztermingeschäfte - Wechselkurse	0,00
Summe Finanztermingeschäfte - Kreditrisiko	0,00
Summe Finanztermingeschäfte - Sonstige Risiken	-176 256,97
Aufstellung der Finanztermingeschäfte zur Absicherung ausgegebener Anteile	0,00
Sonstige Vermögenswerte (+)	26 000 679,08
Sonstige Verbindlichkeiten (-)	-4 896 623,11
Verbindlichkeiten aus Finanzierungen (-)	0,00
Summe = Nettovermögen	254 336 262,49

Bezeichnung der Anteilsklasse	Währung der Anteile	Anzahl der Anteile	Nettoinventarwert
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil CLASSIQUE EUR	EUR	71 025,375	1 520,86
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil I	EUR	4 465,715	1 677,73
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil R	EUR	216 684,668	112,12
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil R2	EUR	357,188	169,13
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil RS	EUR	2 000,100	1 144,88
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil U	EUR	100 682,124	169,67
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil V	EUR	14 516,808	1 149,48
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil Z	EUR	45 669,732	1 716,82

SFTR-Verordnung in EUR

Wertpapierverleihe	Wertpapierentleihe	In Pension gegebene Wertpapiere	In Pension genommene Wertpapiere	TRS
--------------------	--------------------	---------------------------------------	--	-----

1. Entlehene Titel und Rohstoffe

Betrag					
% des Nettovermögens*					

*% ohne Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente

2. Gebundenes Vermögen für jede Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und TRS, in absoluten Zahlen

Betrag				203 141 148,00	
% des Nettovermögens				79,87%	

3. Die 10 wichtigsten Emittenten von erhaltenen Sicherheiten (ohne Barmittel) für jede Art von Finanzierungsgeschäften

EUROPÄISCHE UNION				115 563 705,62	
EUROPÄISCHE INVESTITIONSBANK EUROPÄISCHE UNION				30 226 244,71	
DEUTSCHE REGIERUNG DEUTSCHLAND				24 054 581,81	
ITALIENISCHE REGIERUNG ITALIEN				20 905 028,89	
FRANZÖSISCHE REGIERUNG FRANKREICH				12 107 938,29	

Wertpapierverleihe	Wertpapierentleihe	In Pension gegebene Wertpapiere	In Pension genommene Wertpapiere	TRS
--------------------	--------------------	---------------------------------------	--	-----

4. Die 10 wichtigsten Gegenparteien, in absoluten Zahlen, Aktiva und Passiva ohne Aufrechnung

Caceis Bank France SA - LC				122 893 907,00	
Natixis				68 246 770,00	
BNP Paribas Securities Services SC - LC				12 000 471,00	

5. Art und Qualität der Sicherheiten (Sicherheitshinterlegung)

Art					
- Aktien					
- Anleihen				202 857 499,32	
- OGA					
- TCN					
- Barmittel				1 534 652,00	

Währung der Sicherheit					
Euro				204 392 151,32	

6. Abwicklung und Clearing von Kontrakten

Dreiseitig				X	
Zentrale Gegenpartei					
Bilateral				X	

Wertpapierverleihe	Wertpapierentleihe	In Pension gegebene Wertpapiere	In Pension genommene Wertpapiere	TRS
--------------------	--------------------	---------------------------------------	--	-----

7. Laufzeit der Sicherheit, aufgeschlüsselt nach Tranchen

Innerhalb 1 Tages					
1 Tag bis 1 Woche					
1 Woche bis 1 Monat					
1 Monat bis 3 Monate					
3 Monate bis 1 Jahr					
Mehr als 1 Jahr				202 857 499,32	
Offen					

8. Laufzeit der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und TRS, aufgeschlüsselt nach Tranchen

Innerhalb 1 Tages					
1 Tag bis 1 Woche					
1 Woche bis 1 Monat				203 141 148,00	
1 Monat bis 3 Monate					
3 Monate bis 1 Jahr					
Mehr als 1 Jahr					
Offen					

9. Angaben zur Weiterverwendung von Sicherheiten

Höchstbetrag (%)					
Eingesetzter Betrag (%)					
Erträge für den OGA infolge einer Wiederanlage von Barsicherheiten in Euro					

10. Angaben zum Umtausch von vom OGA erhaltenen Sicherheiten

CACEIS Bank					
Wertpapiere				202 857 499,32	
Barmittel				1 534 652,00	

11. Angaben zum Umtausch von vom OGA bereitgestellten Sicherheiten

Wertpapiere					
Barmittel					

Wertpapierverleihe	Wertpapierentleihe	In Pension gegebene Wertpapiere	In Pension genommene Wertpapiere	TRS
--------------------	--------------------	---------------------------------------	--	-----

12. Aufgeschlüsselte Angaben zu Erträgen und Kosten

Erträge					
- OGA				3 312 243,35	
- Verwaltungsgesellschaft					
- Dritte					
Kosten					
- OGA					
- Verwaltungsgesellschaft					
- Dritte					

13. Angaben zu Art und Qualität der Sicherheiten (Sicherheitshinterlegung)

Ausschließlich Barsicherheit.

14. Angaben zur Weiterverwendung von Sicherheiten

Die erhaltenen Barsicherheiten können vom OGA in echte Pensionsgeschäfte zum Kauf von Wertpapieren oder in für sein Vermögen infrage kommende Titel wieder angelegt werden, insbesondere in Beteiligungspapiere, Zinspapiere, Schuldpapiere oder Anteile von OGA. Die in Form von Wertpapieren erhaltenen Sicherheiten können verwahrt, verkauft oder als Sicherheit eingesetzt werden.

Der Höchstbetrag zur Weiterverwendung beläuft sich auf 100 % der erhaltenen Barmittel und Wertpapiere.

15. Angaben zur Verwahrung von vom OGA bereitgestellten Sicherheiten

Ausschließlich Barsicherheit.

16. Aufgeschlüsselte Angaben zu Erträgen und Kosten

Keine Wertpapierleih- und Pensionsgeschäfte.

Informationen an die Anteilinhaber in der Bundesrepublik Deutschland

Einrichtung gemäß Art. 92 Abs. 1 der Richtlinie 2009/65/EG in der Fassung der Richtlinie (EU) 2021/2261 beziehungsweise § 306a KAGB

Marcard, Stein & Co AG, Ballindamm 36, D-20095 Hamburg:

- Bei dieser Einrichtung können Aufträge zur Zeichnung, Rücknahme und zum Umtausch von Anteilen des FCP nach Maßgabe der in den Verkaufsunterlagen genannten Voraussetzungen eingereicht werden.
- Sämtliche für einen Anteilinhaber bestimmte Zahlungen, einschließlich der Rücknahmeerlöse und etwaiger Ausschüttungen, können auf seinen Wunsch hin über diese Einrichtung geleitet werden.
- Bei dieser Einrichtung können Informationen darüber eingeholt werden, wie die genannten Aufträge erteilt werden können und wie Rücknahmeerlöse ausgezahlt werden.
- Diese Einrichtung erleichtert den Zugang zu Verfahren und Vorkehrungen gemäß Artikel 15 der Richtlinie 2009/65/EG in der Fassung der Richtlinie (EU) 2021/2261 beziehungsweise § 28 Abs. 2 Nr. 1 KAGB in Bezug auf die Wahrnehmung von Anlegerrechten (Anlegerbeschwerden) und informiert darüber.
- Der Verkaufsprospekt, die Basisinformationsblätter, das Verwaltungsreglement des FCP, die letzten veröffentlichten Jahres- und Halbjahresberichte – auf Anfrage jeweils in Papierform – sowie sonstige Angaben und Unterlagen sind bei dieser Einrichtung kostenlos verfügbar.
- Der Nettoinventarwert pro Anteil, die Ausgabe-, Rücknahme-, und Umtauschpreise sind bei dieser Einrichtung kostenlos verfügbar.
- Die Einrichtung versorgt die Anleger mit relevanten Informationen in Bezug auf die Aufgaben, die die Einrichtung erfüllt, auf einem dauerhaften Datenträger.
- Diese Einrichtung fungiert als Kontaktstelle für die Kommunikation mit der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht.

Die Website www.candriam.com:

- Der Verkaufsprospekt, die Basisinformationsblätter, das Verwaltungsreglement des FCP, die letzten veröffentlichten Jahres- und Halbjahresberichte sowie sonstige Angaben und Unterlagen werden auf dieser Website veröffentlicht und sind dort kostenlos verfügbar.
- Der Nettoinventarwert pro Anteil sowie die Ausgabe-, Rücknahme-, und Umtauschpreise werden auf dieser Website veröffentlicht und sind dort kostenlos verfügbar.

Der Verwaltungsgesellschaft des FCP:

- Der Verkaufsprospekt, die Basisinformationsblätter, das Verwaltungsreglement des FCP, die letzten veröffentlichten Jahres- und Halbjahresberichte – auf Anfrage jeweils in Papierform – sowie sonstige Angaben und Unterlagen sind am Gesellschaftssitz der Verwaltungsgesellschaft des FCP kostenlos verfügbar.
- Der Nettoinventarwert pro Anteil sowie die Ausgabe-, Rücknahme-, und Umtauschpreise sind am Verwaltungsgesellschaft des FCP kostenlos verfügbar.

Etwaige Mitteilungen an die Anteilinhaber in Deutschland werden unter www.candriam.com veröffentlicht und an die Anteilinhaber an ihre im Anteilinhaberregister eingetragene Anschrift übersandt. In den folgenden Fällen wird eine Mitteilung per dauerhaftem Datenträger veröffentlicht: Die Aussetzung der Rücknahme der Anteile des Fonds; die Kündigung der Verwaltung des Fonds oder dessen Abwicklung; bei Änderungen von Anlagebedingungen, die mit den bisherigen Anlagegrundsätzen nicht vereinbar sind oder bei anlegerbenachteiligenden Änderungen von wesentlichen Anlegerrechten oder bei anlegerbenachteiligenden Änderungen, die die Vergütungen und Aufwendererstattungen betreffen, die aus dem Investmentvermögen entnommen werden können (einschließlich der Hintergründe der Änderungen sowie der Rechte der Anleger); die Verschmelzung des Fonds oder eines Teilfonds sowie die Umwandlung des Fonds oder eines Teilfonds in einen Feederfonds.

Hinweise für Anleger in Österreich

Kontakt- und Informationsstelle in Österreich

Kontakt- und Informationsstelle in Österreich gemäß den Bestimmungen nach EU-Richtlinie 2019/1160 Art. 92: Erste Bank der oesterreichischen Sparkassen AG

Am Belvedere 1,

A-1100 Wien

E-Mail: foreignfunds0540@erstebank.at