

Unselbständiger Investmentfonds (FCP)
nach französischem Recht

HALBJAHRESBERICHT
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE

zum 30. Juni 2026

Verwaltungsgesellschaft: CANDRIAM

Depotbank: CACEIS Bank

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	5 922 157,49
b) Bankguthaben	7 090 569,95
c) Sonstige vom OGA gehaltene Vermögenswerte	153 727 987,16
d) Vermögenswerte im Bestand des OGA insgesamt (Zeilen a+b+c)	166 740 714,60
e) Passiva	-8 507 160,43
f) Nettoinventarwert (Zeilen d+e = Nettovermögen des OGA)	158 233 554,17

(*) 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 CLASSIQUE EUR in EUR	C	62 201 294,99	40 234,216	1 545,98
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE I in EUR	C	3 992 033,53	2 336,237	1 708,74
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE ZB in EUR	C	48 095 728,73	4 775,080	10 072,23
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE R in EUR	C	3 096 647,54	27 113,894	114,20
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE RS in EUR	C	116,85	0,100	1 168,50
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE U in EUR	C	15 384 966,17	89 021,565	172,82
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE V in EUR	C	25 287 670,06	21 596,029	1 170,94
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Z in EUR	C	175 096,30	100,000	1 750,96

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.	3,74	3,55
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 R. 214-11 Abschnitt I Punkt 4 des französischen Code Monétaire et Financier.	0,00	0,00
E) Sonstige Vermögenswerte.	5,78	5,48

(*) 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	5 922 157,49	3,74	3,55
INSGESAMT		5 922 157,49	3,74	3,55

(*) 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	0,86	0,82
BELGIEN	0,79	0,75
ITALIEN	0,61	0,58
DEUTSCHLAND	0,61	0,58
IRLAND	0,51	0,48
ÖSTERREICH	0,21	0,20
LUXEMBURG	0,15	0,14
INSGESAMT	3,74	3,55

(*) 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	1,85	1,75
Andere OGA und Investmentfonds	0,00	0,00
AIF und vergleichbare Fonds aus anderen Mitgliedstaaten der Europäischen Union	3,93	3,73
Sonstige	0,00	0,00
INSGESAMT	5,78	5,48

(*) 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.	22 445 608,54	19 555 276,75
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.	2 627 835,61	2 723 635,93
D) Zulässige Wertpapiere aus Neuemissionen im Sinne von Artikel R. 214-11 Abschnitt I Punkt 4 des französischen Code Monétaire et Financier.	0,00	0,00
E) Sonstige Vermögenswerte.	14 443 208,93	14 979 377,02

INFORMATION ÜBER VARIABLE VERWALTUNGSGEBÜHREN

	30/06/2026
Anteil CANDRIAM INDEX ARBITRAGE CLASSIQUE EUR	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	33,79
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Anteil CANDRIAM INDEX ARBITRAGE I	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	5,15
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Anteil CANDRIAM INDEX ARBITRAGE ZB	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	-27 566,19
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	-0,06
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	533,28
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Anteil CANDRIAM INDEX ARBITRAGE R	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	151,07
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Anteil CANDRIAM INDEX ARBITRAGE 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
Anteil CANDRIAM INDEX ARBITRAGE U	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	20,53
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Anteil CANDRIAM INDEX ARBITRAGE V	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	55,88
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Anteil CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Z	
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

»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/ Nennwert	Zeitwert	% Nettover- mögen
AKTIEN UND ÄHNLICHE WERTPAPIERE			5 922 157,49	3,74
An einem geregelten Markt gehandelte Aktien und ähnliche Wertpapiere			5 922 157,49	3,74
Geschäftsbanken			208 860,30	0,13
COMMERZBANK AG	EUR	5 610	208 860,30	0,13
Getränke			1 257 018,00	0,78
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	EUR	17 300	1 257 018,00	0,78
Fluggesellschaften			801 355,00	0,51
RYANAIR HOLDINGS PLC	EUR	29 300	801 355,00	0,51
Unterhaltung			675 332,19	0,43
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	EUR	36 843	675 332,19	0,43
Energieausrüstung und -dienstleistungen			237 258,00	0,15
TENARIS SA	EUR	9 800	237 258,00	0,15
Elektroausrüstung			415 800,00	0,26
NORDEX SE	EUR	9 000	415 800,00	0,26
Elektronikausrüstung und -instrumente			408 330,00	0,26
TECHNOPROBE SPA	EUR	11 700	408 330,00	0,26
Metalle und Minerale			671 000,00	0,42
AURUBIS AG	EUR	1 900	344 280,00	0,21
VOESTALPINE AG	EUR	8 000	326 720,00	0,21
Öl und Gas			230 944,00	0,15
ENI SPA	EUR	11 200	230 944,00	0,15
Halbleiter und Halbleiterrausrüstung			688 560,00	0,44
ASML HOLDING NV	EUR	400	688 560,00	0,44
Versorger			327 700,00	0,21
A2A SPA	EUR	145 000	327 700,00	0,21
ANTEILE AN OGA			9 141 551,28	5,78
OGAW			2 921 280,00	1,85
Kollektive Verwaltung			2 921 280,00	1,85
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z EUR ACC	EUR	2 000	2 921 280,00	1,85
AIF und vergleichbare Fonds aus anderen Mitgliedstaaten der Europäischen Union			6 220 271,28	3,93
Kollektive Verwaltung			6 220 271,28	3,93
CANDRIAM EQUITIES L RAO ZB EUR C	EUR	411	6 220 271,28	3,93
IN PENSION GENOMMENE WERTPAPIERE			124 497 955,00	78,68
An einem geregelten Markt gehandelte Anleihen und ähnliche Wertpapiere			124 497 955,00	78,68
Geschäftsbanken			29 133 975,00	18,41
EFSF 0.75% 03-05-27	EUR	15 170 000	15 000 000,00	9,48
INTL BK FOR RECONS AND DEVELOP 0.7% 22-10-46	EUR	24 875 000	14 133 975,00	8,93
Versorger			95 363 980,00	60,27
BANQUE EUROPEAN D INVESTISSEMENT BEI ZCP 05-11-26	EUR	10 000 000	9 875 000,00	6,24

Aufstellung der Bilanzpositionen

Bezeichnung der Wertpapiere nach Wirtschaftssektor (*)	Währung	Stückzahl/ Nennwert	Zeitwert	% Nettover- mögen
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.0% 22-06-31	EUR	15 800 000	14 503 580,00	9,17
EUROPEAN FINL STABILITY FACIL 1.7% 13-02-43	EUR	15 939 000	12 000 000,00	7,58
EUROPEAN STABILITY MECHANISM 2.75% 15-09-34	EUR	20 000 000	19 716 000,00	12,47
EUROPEAN UNION 0.0% 04-07-29	EUR	13 410 000	12 269 400,00	7,75
EUROPEAN UNION 3.25% 04-07-34	EUR	11 680 000	12 000 000,00	7,58
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 2.5% 24-09-27	EUR	14 826 000	15 000 000,00	9,48
FORDERUNGEN AUS IN PENSION GENOMMENEN WERTPAPIEREN			435 735,66	0,28
Summe			139 997 399,43	88,48

(*) 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 0926	-46	0,00	-16 215,00	-677 005,00
E-MIN RUS 200 0926	20	7 064,81	0,00	2 663 867,75
EURO STOXX 50 0926	-136	0,00	-89 878,00	-8 644 160,00
FTSE 100 FUT 0926	-14	0,00	-8 938,94	-1 713 269,10
NASDAQ 100 E- 0926	-4	13 711,19	0,00	-2 135 817,37
ONK TOKYO NIK 0926	-4	0,00	-124 274,28	-1 510 966,83
S&P TORONTO 6 0926	-2	0,00	-273,73	-506 938,75
SP 500 MINI 0926	-41	0,00	-144 671,77	-13 534 428,85
XEUR FSMI SWI 0926	-10	0,00	-52 914,07	-1 541 555,98
Zwischensumme 1.		20 776,00	-437 165,79	-27 600 274,13
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 ABBV U 1230	2 400	0,00	-3 749,15	603 936,00
CFD BARC AMP US 1230	1 300	6 611,09	0,00	596 388,00
CFD BARC BNY US 1230	4 000	3 522,78	0,00	578 440,00
CFD BARC CRDA G 1230	15 000	5 920,59	0,00	453 600,00
CFD BARC EBC US 1230	-70 600	0,00	-101 654,61	-1 570 144,00
CFD BARC FWONK 1230	3 500	12 428,93	0,00	332 990,00
CFD BARC GIVN C 1230	175	108 728,65	0,00	598 500,00

Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Aktien

Art des Geschäfts	Stückzahl/ Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
CFD BARC GPOR U 1230	-6 700	0,00	-298,29	-1 136 990,00
CFD BARC HLT US 1230	1 700	0,00	-3 717,16	561 782,00
CFD BARC HUBS U 1230	1 000	0,00	-69 701,74	182 510,00
CFD BARC IESC U 1230	-1 600	38 804,65	0,00	-1 175 456,00
CFD BARC IVT US 1230	-21 000	0,00	-19 842,82	-743 400,00
CFD BARC OGC CA 1230	10 400	0,00	-11 676,88	369 720,00
CFD BARC PAAS C 1230	5 700	0,00	-20 595,27	362 406,00
CFD BARC PTON U 1230	-110 000	54 841,25	0,00	-650 100,00
CFD BARC SY1 EU 1230	7 000	74 060,00	0,00	614 740,00
CFD BARC TW USD 1230	2 900	0,00	-4 332,88	289 014,00
CFD BARC UTI US 1230	-24 000	0,00	-28 968,77	-1 026 480,00
CFD BARC VRTX U 1230	1 200	5 502,60	0,00	596 076,00
CFD BAR MRL EUR 1230	26 000	13 260,00	0,00	398 840,00
CFD BC ALLISON 1230	3 000	2 807,66	0,00	338 220,00
CFD BC AON PLC- 1230	1 800	4 567,93	0,00	597 042,00
CFD BC ASTERA L 1230	700	99 755,97	0,00	338 114,00
CFD BC BLOOM EN 1230	1 200	30 637,63	0,00	363 240,00
CFD BC BLUE OWL 1230	26 000	0,00	-39 114,84	227 500,00
CFD BC CREDO TE 1230	1 050	42 108,37	0,00	285 547,50
CFD BC DRAFTKIN 1230	11 500	0,00	-10 762,70	290 490,00
CFD BC LPL FINA 1230	1 000	0,00	-6 159,54	281 680,00
CFD BC MODINE M 1230	1 000	0,00	-26 064,20	267 020,00
CFD BC POPULAR 1230	2 000	28 688,88	0,00	328 360,00
CFD BC REDDIT I 1230	1 400	0,00	-5 228,72	243 012,00
CFD BC SAMSARA 1230	9 000	8 398,58	0,00	291 870,00
CFD BC SIMON PR 1230	-2 600	7 213,28	0,00	-581 490,00
CFD BC SUBSEA 7 1230	14 250	33 252,31	0,00	4 816 500,00
CFD BC TOAST IN 1230	-57 800	0,00	-56 317,75	-1 607 996,00
CFD BC ZILLOW G 1230	6 200	0,00	-25 650,31	195 424,00
CFD CGMD AMAZON 1230	10 200	49 783,99	0,00	2 431 068,00
CFD CGMD FEDEX 1230	1 000	0,00	-5 352,93	313 130,00
CFD CGMD S&P GL 1230	1 700	8 169,75	0,00	692 342,00
CFD CHASDEFX HL 1230	1 500	0,00	-1 103,65	133 875,00
CFD CHASDEFX PR 1230	12 700	0,00	-555,41	310 388,00
CFD CHAS RSI US 1230	-25 000	0,00	-14 403,48	-743 500,00
CFD CITI KMAR N 1230	32 940	0,00	-5 473,74	1 687 845,60
CFD CITI NIC US 1230	-7 900	0,00	-128 412,83	-1 306 581,00
CFD CITI QCOM U 1230	2 700	0,00	-97 740,80	498 933,00
CFD CITI TXN US 1230	2 400	0,00	-52 242,25	715 368,00
CFD HERMES 1230	1 100	0,00	-125 400,00	1 757 800,00
CFD JP ADIDAS 1230	-6 000	0,00	-86 400,00	-1 076 400,00
CFD JP CAIXABAN 1230	18 084	14 919,30	0,00	223 970,34
CFD JPMC DNB 1230	7 656	5 955,08	0,00	2 256 223,20
CFD JPM ROCKET 1230	18 800	25 816,50	0,00	296 100,00
CFD JPX ALLIANZ 1230	-528	0,00	-20 697,60	-218 644,80
CFD JPX ALNYLAM 1230	950	7 097,22	0,00	285 978,50
CFD JPX CIE FI 1230	-4 400	0,00	-96 611,55	-820 820,00
CFD JPX COSTCO 1230	600	0,00	-9 108,27	561 282,00
CFD JPX DIPLOMA 1230	4 750	12 682,84	0,00	338 675,00

Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Aktien

Art des Geschäfts	Stückzahl/ Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
CFD JPX HEICO C 1230	900	18 058,25	0,00	320 571,00
CFD JPX HSBC HO 1230	-12 738	0,00	-7 127,61	-182 255,30
CFD JPX JOHNSON 1230	-3 600	0,00	-2 797,69	-914 292,00
CFD JPX MERCK & 1230	-8 000	0,00	-74 005,42	-1 028 000,00
CFD JPX MICROSO 1230	6 500	0,00	-351,92	2 424 630,00
CFD JPX NIKE IN 1230	21 000	0,00	-89 635,27	862 050,00
CFD JPX NOVARTI 1230	6 000	1 705,18	0,00	759 480,00
CFD JPX PEPSICO 1230	6 000	0,00	-32 117,55	812 400,00
CFD JPX PSP SWI 1230	2 500	0,00	-4 879,37	360 250,00
CFD JPX SG 1230	2 904	19 021,20	0,00	224 682,48
CFD JPX SPIE SA 1230	8 750	9 450,00	0,00	441 000,00
CFD JPX SS&C TE 1230	3 500	0,00	-21 521,04	217 175,00
CFD JPX UNITED 1230	130	1 238,66	0,00	147 275,70
CFD MS ARM USD 1230	-1 100	81 548,17	0,00	-390 027,00
CFD MSE APPLE I 1230	8 400	40 371,87	0,00	2 430 624,00
CFD MSE BANK OF 1230	17 900	11 947,42	0,00	1 019 942,00
CFD MSE FIRST C 1230	170	20 977,52	0,00	353 734,30
CFD MSE FLUGHAF 1230	1 625	34 535,10	0,00	406 250,00
CFD MSE HEXAGON 1230	80 000	0,00	-47 862,63	6 409 600,00
CFD MSE HOWARD 1230	2 300	17 300,80	0,00	164 427,00
CFD MSE NELNET 1230	1 100	4 012,07	0,00	146 663,00
CFD MSE NEWMARK 1230	9 800	9 686,00	0,00	148 078,00
CFD MSE SOFI TE 1230	18 000	0,00	-10 233,53	322 740,00
CFD MSE WEIR GR 1230	13 750	2 873,23	0,00	330 550,00
CFD MS GOOG USD 1230	-6 900	0,00	-113 101,34	-2 437 977,00
CFD MS GTX USD 1230	7 700	33 809,15	0,00	278 971,00
CFD MS MARVELL 1230	-1 600	9 513,23	0,00	-476 624,00
CFD MS NEM USD 1230	2 700	0,00	-24 610,31	252 180,00
CFD SG AIR LIQU 1230	-4 600	0,00	-2 814,28	-797 088,00
CFD SG AXA SA 1230	5 082	10 011,54	0,00	222 845,70
CFD SSABB SS SE 1230	41 700	0,00	-24 722,28	3 735 486,00
CFD UBS ACCELLE 1230	3 700	22 867,99	0,00	307 100,00
CFD UBS ACKERMA 1230	1 475	29 795,00	0,00	421 555,00
CFD UBS AEIS US 1230	2 000	136 831,98	0,00	745 740,00
CFD UBS AHR USD 1230	28 000	120 493,31	0,00	1 460 200,00
CFD UBS BBIO US 1230	11 000	87 746,00	0,00	819 280,00
CFD UBS CACC US 1230	-1 300	0,00	-65 021,49	-827 762,00
CFD UBS CDE USD 1230	-49 100	50 877,96	0,00	-801 312,00
CFD UBS COCA-CO 1230	7 200	0,00	-8 720,86	585 144,00
CFD UBS C USD 1230	7 100	0,00	-19 517,70	993 716,00
CFD UBS DSFIR E 1230	-22 000	0,00	-255 200,00	-1 826 000,00
CFD UBS DY USD 1230	1 800	18 420,36	0,00	910 062,00
CFD UBS ENSG US 1230	6 500	0,00	-26 720,90	1 041 950,00
CFD UBS EQUINOR 1230	8 000	0,00	-27 931,23	2 508 000,00
CFD UBS ESTA US 1230	-11 000	0,00	-170 585,15	-943 910,00
CFD UBS GH USD 1230	7 500	137 037,52	0,00	1 125 225,00
CFD UBS HNGE US 1230	-11 000	0,00	-212 437,68	-913 000,00
CFD UBS ING GRO 1230	-7 689	0,00	-8 996,13	-212 754,63
CFD UBS KOG NOK 1230	11 300	0,00	-24 570,65	3 370 790,00

Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Aktien

Art des Geschäfts	Stückzahl/ Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
CFD UBS LAZ USD 1230	-16 100	33 046,33	0,00	-675 234,00
CFD UBS M & T B 1230	4 400	49 347,50	0,00	1 047 244,00
CFD UBS NXT USD 1230	4 500	0,00	-101 863,03	536 130,00
CFD UBS OCTAVE 1230	9 944	0,00	-5 032,66	1 555 241,60
CFD UBS OPEN US 1230	-100 000	60 351,61	0,00	-462 000,00
CFD UBS RESONAC 1230	-3 800	14 928,84	0,00	-67 260 000,00
CFD UBS SCHW US 1230	10 800	5 124,64	0,00	996 516,00
CFD UBS SPXC US 1230	4 500	95 447,39	0,00	1 103 265,00
CFD UBS STANDAR 1230	8 976	3 334,48	0,00	183 200,16
CFD UBS TKO USD 1230	3 600	7 778,75	0,00	724 716,00
CFD UBS TTAN US 1230	-9 500	57 915,68	0,00	-671 745,00
CFD UBS VAR ENE 1230	-177 600	91 205,73	0,00	-7 315 344,00
CFD UBSWDEFF 61 1230	78 900	56 898,59	0,00	171 134 100,00
CFD UBSWDEFF 95 1230	25 100	0,00	-7 294,36	153 637 100,00
CFD UBS ZURICH 1230	-330	0,00	-16 746,00	-197 538,00
CGMD HONEYWELL 1230	1 225	0,00	-250 591,52	274 277,50
CGMD HONEYWELL 1230	1 225	236 878,33	0,00	270 823,00
CH NESTLE CHF 1230	-9 000	0,00	-50 843,05	-747 720,00
JPX FERGUSON ENTERPR	1 250	14 158,58	0,00	296 662,50
JPX LINDE PLC 1230	1 800	12 543,64	0,00	934 092,00
JPX ROCHE HOL 1230	-2 200	0,00	-2 145,97	-732 160,00
MC SG LVMH 1230	1 700	0,00	-48 450,00	822 970,00
SG SANOFI 1230	22 000	34 054,90	0,00	1 651 760,00
UAC SG C.A. 1230	12 540	8 339,10	0,00	220 641,30
Zwischensumme 4.		2 417 019,43	-2 835 786,76	297 904 301,65
Summe		2 437 795,43	-3 272 952,55	270 304 027,52

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

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	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	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 BARCIE2D NH 1230	-18 700	21 536,16	0,00	-1 426 062,00
CFD UBS PAY USD 1230	-30 000	2 623,98	0,00	-724 800,00
Zwischensumme 4.		24 160,14	0,00	-2 150 862,00
Summe		24 160,14	0,00	-2 150 862,00

(*) 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)	139 997 399,43
Aufstellung der Finanztermingeschäfte (ohne Geschäfte zur Absicherung ausgegebener Anteile):	
Summe Devisentermingeschäfte	0,00
Summe Finanztermingeschäfte - Aktien	-835 157,12
Summe Finanztermingeschäfte - Zinsen	0,00
Summe Finanztermingeschäfte - Wechselkurse	0,00
Summe Finanztermingeschäfte - Kreditrisiko	0,00
Summe Finanztermingeschäfte - Sonstige Risiken	24 160,14
Aufstellung der Finanztermingeschäfte zur Absicherung ausgegebener Anteile	0,00
Sonstige Vermögenswerte (+)	24 281 359,60
Sonstige Verbindlichkeiten (-)	-5 234 207,88
Verbindlichkeiten aus Finanzierungen (-)	0,00
Summe = Nettovermögen	158 233 554,17

Bezeichnung der Anteilsklasse	Währung der Anteile	Anzahl der Anteile	Nettoinventarwert
Anteil CANDRIAM INDEX ARBITRAGE CLASSIQUE EUR	EUR	40 234,216	1 545,98
Anteil CANDRIAM INDEX ARBITRAGE I	EUR	2 336,237	1 708,74
Anteil CANDRIAM INDEX ARBITRAGE ZB	EUR	4 775,080	10 072,23
Anteil CANDRIAM INDEX ARBITRAGE R	EUR	27 113,894	114,20
Anteil CANDRIAM INDEX ARBITRAGE RS	EUR	0,100	1 168,50
Anteil CANDRIAM INDEX ARBITRAGE U	EUR	89 021,565	172,82
Anteil CANDRIAM INDEX ARBITRAGE V	EUR	21 596,029	1 170,94
Anteil CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Z	EUR	100,000	1 750,96

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				124 497 955,00	
% des Nettovermögens				78,68%	

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

EUROPEAN FINAL STABILITY				72 030 592,33	
FRANCE GOVT BOND				15 086 916,76	
INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION				14 673 667,99	
BELGIUM GOVERNMENT BOND				14 450 335,62	
EUROPEAN INVESTMENT BANK				9 918 629,08	

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

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

NATIXIS				58 228 555,00	
Crédit Agricole Corporate & Investment Bank				39 269 400,00	
Caceis Bank Luxembourg				27 000 000,00	

5. Art und Qualität der Sicherheiten (Sicherheitshinterlegung)

Art					
- Aktien					
- Anleihen				126 160 141,78	
- OGA					
- TCN (marktfähige Schuldtitel)					
- Barmittel				AAA à A	

Währung der Sicherheit					
Euro				126 160 141,78	

6. Abwicklung und Clearing von Kontrakten

Dreiseitig				X	
Zentrale Gegenpartei					
Bilateral	X			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				24 886 365,26	
Mehr als 1 Jahr				101 273 776,52	
Offen					

8. Laufzeit der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und TRS, aufgeschlüsselt nach Tranchen

Innerhalb 1 Tages					
1 Tag bis 1 Woche					
1 Woche bis 1 Monat				80 772 980,00	
1 Monat bis 3 Monate				43 724 975,00	
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				126 160 141,78	
Barmittel					

11. Angaben zur Umtausch von vom OGA bereitgestellten Sicherheiten

Wertpapiere					
Barmittel				1 059 536,00	

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

12. Aufgeschlüsselte Angaben zu Erträgen und Kosten

Erträge					
- OGA				1 286 474,04	
- Fondsmanager					
- Dritte					
Kosten					
- OGA					
- Fondsmanager					
- 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 in Frage kommenden 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 österreichischen Sparkassen AG

Am Belvedere 1,

A-1100 Wien

E-Mail: foreignfunds0540@erstebank.at