



Unselbständiger Investmentfonds (FCP) nach
französischem Recht

HALBJAHRESBERICHT

CANDRIAM INDEX ARBITRAGE

zum 31. März 2023

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	14 001 285,00
b) Bankguthaben	54 707 345,77
c) Sonstige vom OGA gehaltene Vermögenswerte	673 387 134,53
d) Vermögenswerte im Bestand des OGA insgesamt (Zeilen a+b+c)	742 095 765,30
e) Passiva	-69 222 965,87
f) Nettoinventarwert (Zeilen d+e = Nettovermögen des OGA)	672 872 799,43

* Die Beträge weisen Vorzeichen auf

ANZAHL DER IM UMLAUF BEFINDLICHEN ANTEILE UND NETTOINVENTARWERT JE ANTEIL

Anteil	Art des Anteils	Nettovermögen je Anteil	Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Part CLASSIQUE EUR in EUR	C	216 330 526,08	153 481,622	1 409,48
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Part I in EUR	C	30 247 110,20	19 503,093	1 550,88
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Part R in EUR	C	31 091 323,25	299 879,808	103,67
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Part R2 in EUR	C	874 319,03	5 599,634	156,13
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Part RS in EUR	C	2 169 011,09	2 050,100	1 058,00
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Part U in EUR	C	25 105 599,89	160 060,881	156,85
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Part V in EUR	C	244 427 848,28	230 033,709	1 062,57
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Part Z in EUR	C	122 627 061,61	77 411,000	1 584,10

ELEMENTE 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.	2,08	1,89
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.	7,69	6,98

* *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	14 001 285,00	2,08	1,89
INSGESAMT		14 001 285,00	2,08	1,89

* *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 **
FINNLAND	0,75	0,68
DEUTSCHLAND	0,65	0,59
NIEDERLANDE	0,34	0,31
LUXEMBURG	0,33	0,30
INSGESAMT	2,08	1,89

* *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 **
Organismen für gemeinsame Anlagen		
OGAW und AIF mit allgemeiner Zielsetzung, die sich an nicht institutionelle Anleger richten, und vergleichbare Fonds aus sonstigen Ländern	7,69	6,98
Sonstige Fonds, die sich an nicht institutionelle Anleger richten, und vergleichbare Fonds aus sonstigen Mitgliedstaaten der EU	0,00	0,00
Institutionelle Fonds mit allgemeiner Zielsetzung und vergleichbare Fonds aus sonstigen Mitgliedstaaten der EU und börsennotierte Organismen für Verbriefungen	0,00	0,00
Sonstige institutionelle Investmentfonds und vergleichbare Fonds aus sonstigen Mitgliedstaaten der EU und nicht börsennotierte Organismen für Verbriefungen	0,00	0,00
Sonstige nicht-europäische Organismen	0,00	0,00
Sonstige Vermögenswerte		
Sonstiges	0,00	0,00
INSGESAMT	7,69	6,98

* *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.	34 941 286,53	36 104 415,45
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.	6 062 775,00	6 502 350,00
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.	50 337 660,00	100 508 785,00

INFORMATION ÜBER VARIABLE VERWALTUNGSGEBÜHREN

	31/03/2023
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
Vereinnahme variable Verwaltungsgebühren	0,00
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
Vereinnahme variable Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
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
Vereinnahme variable Verwaltungsgebühren	0,00
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
Vereinnahme variable Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
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
Vereinnahme 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
Vereinnahme variable Verwaltungsgebühren	0,00
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
Vereinnahme variable Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00

INFORMATION ÜBER VARIABLE VERWALTUNGSGEBÜHREN (Fortsetzung)

	31/03/2023
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	0,00
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00

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				549 156 020,58	
% des Nettovermögens				81,62%	

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

EUROPÄISCHE UNION				215 821 734,67	
DEUTSCHE REGIERUNG DEUTSCHLAND				80 308 531,69	
BELGISCHE REGIERUNG BELGIEN				79 341 431,12	
FRANZÖSISCHE REGIERUNG FRANKREICH				70 686 661,13	
ITALIENISCHE REGIERUNG ITALIEN				56 839 416,55	
EUROPÄISCHE INVESTITIONSBANK EUROPÄISCHE UNION				45 627 491,63	

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

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

Credit Agricole CIB SA - LC				270 839 635,68	
BNP Paribas Securities Services SC - LC				126 235 454,90	
Caceis Bank France SA - LC				112 080 930,00	
Natixis				40 000 000,00	

5. Art und Qualität der Sicherheiten (Sicherheitshinterlegung)

Art					
- Aktien					
- Anleihen				548 625 266,79	
- OGA					
- TCN (marktfähige Schuldtitel)					
- Barmittel					

Währung der Sicherheit					
Euro				548 625 266,79	

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			18 653 044,60	
1 Monat bis 3 Monate				
3 Monate bis 1 Jahr			40 066 983,56	
Mehr als 1 Jahr			489 905 238,63	
Offen				

8. Laufzeit der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und TRS, aufgeschlüsselt nach Tranchen

Innerhalb 1 Tages				
1 Tag bis 1 Woche				
1 Woche bis 1 Monat			374 479 786,30	
1 Monat bis 3 Monate			174 145 480,49	
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			548 625 266,79	
Barmittel				

11. Angaben zur 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				239 637,80	
- Fondsmanager					
- Dritte					
Kosten					
- OGA					
- Fondsmanager					
- Dritte					

13. Angaben zu Art und Qualität der Sicherheiten (Sicherheits hinterlegung)

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.

WERTPAPIERBESTAND ZUM 31.03.2023 IN EUR

Bezeichnung der Wertpapiere	Währung	Stückzahl/Nennwert	Zeitwert	% Nettovermögen
Aktien und ähnliche Wertpapiere				
An einem geregelten Markt gehandelte Aktien und ähnliche Wertpapiere				
DEUTSCHLAND				
COVESTRO AG	EUR	101 000	3 851 130,00	0,57
CTS EVENTIM AG	EUR	9 500	545 775,00	0,08
SUMME DEUTSCHLAND			4 396 905,00	0,65
FINNLAND				
FORTUM CORPORATION	EUR	150 000	2 117 250,00	0,31
NESTE OYJ	EUR	65 000	2 952 950,00	0,45
SUMME FINNLAND			5 070 200,00	0,76
LUXEMBURG				
AROUNDTOWN SA	EUR	1 700 000	2 232 100,00	0,33
SUMME LUXEMBURG			2 232 100,00	0,33
NIEDERLANDE				
PROSUS NV	EUR	32 000	2 302 080,00	0,34
SUMME NIEDERLANDE			2 302 080,00	0,34
SUMME An einem geregelten Markt gehandelte Aktien und ähnliche Wertpapiere			14 001 285,00	2,08
SUMME Aktien und ähnliche Wertpapiere			14 001 285,00	2,08
Organismen für gemeinsame Anlagen				
OGAW und AIF mit allgemeiner Zielsetzung, die sich an nicht institutionelle Anleger richten, und vergleichbare Fonds aus sonstigen Ländern				
FRANKREICH				
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z EUR ACC	EUR	2 000	2 793 740,00	0,42
CANDRIAM RISK ARBITRAGE Z EUR ACC	EUR	7 000	10 268 440,00	1,52
SUMME FRANKREICH			13 062 180,00	1,94
LUXEMBURG				
CANDRIAM MONEY MARKET EURO Z EUR ACC	EUR	38 000	38 709 840,00	5,75
SUMME LUXEMBURG			38 709 840,00	5,75
SUMME OGAW und AIF mit allgemeiner Zielsetzung, die sich an nicht institutionelle Anleger richten, und vergleichbare Fonds aus sonstigen Ländern			51 772 020,00	7,69
SUMME Organismen für gemeinsame Anlagen			51 772 020,00	7,69
In Pension genommene Wertpapiere				
DEUTSCHLAND				
ALLEMAGNE 0.5% 15-04-30 IND	EUR	31 730 000	40 011 530,00	5,96
KFW 0.0% 04-07-24 EMTN	EUR	41 472 000	40 000 000,00	5,94
SUMME DEUTSCHLAND			80 011 530,00	11,90
BELGIEN				
BELGIQUE 3% 06/34	EUR	12 000 000	12 112 800,00	1,80
BELGIQUE 4.25% 03/41	EUR	12 300 000	14 268 000,00	2,12
BELGIQUE 5%04-35 OLO	EUR	11 000 000	13 750 000,00	2,05
BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.0% 22-10-31	EUR	50 956 063	40 000 000,00	5,94
EUROPEAN UNION 0.0% 04-07-31		0,00	0,00	0,00
EUROPEAN UNION 0.1% 04-10-40	EUR	22 400 000	13 440 000,00	1,99
EUROPEAN UNION 0.4% 04-02-37	EUR	69 175 994	49 156 716,36	7,31
SUMME BELGIEN			142 727 516,36	21,21
FRANKREICH				
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 3.5% 25-04-26	EUR	28 347 621	30 000 287,30	4,46

WERTPAPIERBESTAND ZUM 31.03.2023 IN EUR (Fortsetzung)

Bezeichnung der Wertpapiere	Währung	Stückzahl/ Nennwert	Zeitwert	% Nettovermögen
OAT 2.75% 25/10/2027	EUR	40 000 000	40 000 000,00	5,94
SUMME FRANKREICH			70 000 287,30	10,40
ITALIEN				
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.85% 15-01-27	EUR	45 020 000	41 103 260,00	6,11
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.3% 15-05-28	EUR	13 074 000	15 001 107,60	2,23
SUMME ITALIEN			56 104 367,60	8,34
LUXEMBURG				
BANQUE EUROPEAN DINVESTISSEMENT 0.625% 22-01-29	EUR	30 600 000	26 682 919,15	3,97
ESM 2.125% 11/23	EUR	40 000 000	40 000 000,00	5,95
EUROPEAN FINL STABILITY FACIL 0.0% 15-10-25	EUR	43 048 000	40 000 000,00	5,94
EUROPEAN FINL STABILITY FACIL 0.875% 26-07-27	EUR	21 665 000	20 000 000,00	2,97
EUROPEAN INVESTMENT BANK 2% 14/04/2023	EUR	18 300 000	18 629 400,00	2,77
EURO STA 1.0% 23-09-25 EMTN	EUR	57 298 036	55 000 000,17	8,17
SUMME LUXEMBURG			200 312 319,32	29,77
SUMME In Pension genommene Wertpapiere			549 156 020,58	81,62
Forderungen aus in Pension genommenen Wertpapieren			1 000 402,56	0,15
Finanzterminkontrakte				
Feste Termingeschäfte				
Feste Termingeschäfte auf einem geregelten oder gleichwertigen Markt				
E-MIN RUS 200 0623	USD	223	745 331,74	0,11
EURO STOXX 50 0623	EUR	-457	-760 423,24	-0,11
FTSE 100 FUT 0623	GBP	-7	-18 586,26	-0,01
NQ USA NASDAQ 0623	USD	-44	-438 533,08	-0,06
SP 500 MINI 0623	USD	14	76 660,99	0,01
XAE ENERGY SE 0623	USD	-3	-8 251,02	0,00
XEUR FSMI SWI 0623	CHF	-46	-227 855,59	-0,03
SUMME Feste Termingeschäfte auf einem geregelten oder gleichwertigen Markt			-631 656,46	-0,09
SUMME Feste Termingeschäfte			-631 656,46	-0,09
Sonstige Finanztermingeschäfte				
CFD				
CFD BARC BG USD 1230	USD	-46 000	320 086,52	0,05
CFD BC ALPHABET 1230	USD	42 000	58 346,54	0,00
CFD BC BANCO SA 1230	EUR	600 000	-153 420,00	-0,03
CFD BC BROADCOM 1230	USD	-6 000	-59 419,03	0,00
CFD BC CERTARA 1230	USD	-108 000	59 902,25	0,00
CFD BC HELVETIA 1230	CHF	5 600	49 691,28	0,01
CFD BC INSULET 1230	USD	-14 670	-145 972,17	-0,02
CFD BC LEONARDO 1230	EUR	60 000	8 358,00	0,01
CFD BC REXEL SA 1230	EUR	28 000	-52 360,00	-0,01
CFD CENTRICA PL 1230	GBP	550 000	15 022,19	0,00
CFD CGMD AIR PR 1230	USD	8 000	43 738,78	0,01
CFD CGMD KBC GR 1230	EUR	-40 000	-760,00	-0,01
CFD JP ADIDAS 1230	EUR	-13 000	-101 744,50	-0,01
CFD JPMC BEIJER 1230	SEK	40 000	95 056,20	0,01
CFD JPX BANCO B 1230	EUR	165 000	-85 965,00	-0,01
CFD JPX CADENCE 1230	USD	14 600	39 749,04	0,01
CFD JPX JOHNSON 1230	USD	14 000	13 384,69	0,00

WERTPAPIERBESTAND ZUM 31.03.2023 IN EUR (Fortsetzung)

Bezeichnung der Wertpapiere	Währung	Stückzahl/Nennwert	Zeitwert	% Nettovermögen
CFD JPX MERCK & 1230	USD	21 000	31 925,72	0,01
CFD JPX NIKE IN 1230	USD	18 000	37 337,02	0,01
CFD JPX NOVARTI 1230	CHF	36 000	249 987,91	0,04
CFD JPX NOVARTI 1230	USD	-23 000	-173 169,50	-0,02
CFD JPX PFIZER 1230	USD	86 000	49 077,27	0,00
CFD JPX PHILLIP 1230	USD	31 000	165 530,21	0,03
CFD JPX PROCTER 1230	USD	-15 000	-107 108,93	-0,02
CFD JPX SANOFI 1230	EUR	-44 000	-468 540,60	-0,07
CFD JPX SHELL P 1230	USD	60 000	172 138,62	0,02
CFD JPX UNILEVE 1230	USD	44 000	122 942,43	0,02
CFD JPX VALERO 1230	USD	23 000	225 486,58	0,03
CFD MSE RANDSTA 1230	EUR	-34 000	152 398,20	0,02
CFD TRELLEBORG 1230	SEK	28 000	53 186,58	0,01
CFD UBS ADVANCE 1230	USD	-34 000	-149 707,03	-0,02
CFD UBS ANDRITZ 1230	EUR	11 000	36 850,00	0,01
CFD UBS ARAMARK 1230	USD	-83 000	-163 494,22	-0,02
CFD UBS AUTOLIV 1230	USD	-32 000	-176 904,97	-0,03
CFD UBS AXALTA 1230	USD	-100 000	-225 357,82	-0,04
CFD UBS BELIMO 1230	CHF	1 280	-41 914,36	-0,01
CFD UBS CHORD E 1230	USD	-23 000	-277 886,23	-0,04
CFD UBS CRANE H 1230	USD	29 000	38 106,86	0,00
CFD UBS DV USD 1230	USD	-24 000	-91 453,82	-0,01
CFD UBS EDISON 1230	USD	60 000	61 451,88	0,01
CFD UBS SSAB AB 1230	SEK	100 000	10 296,47	0,00
CFD UBS US FOOD 1230	USD	-81 000	-140 945,74	-0,02
CFD UBS VERRA M 1230	USD	-125 000	-6 903,22	0,00
CFD UBS VF CORP 1230	USD	85 000	-170 555,48	-0,03
CGMD LINDE PL 1230	USD	-7 000	-89 557,73	-0,01
CH TOTALENERGIES EUR	EUR	90 000	83 146,50	0,02
JP CVX USD 1230	USD	-20 000	-163 149,71	-0,03
SUMME CFD			-853 092,32	-0,13
SUMME Sonstige Finanztermingeschäfte			-853 092,32	-0,13
Finanzterminkontrakte INSGESAMT			-1 484 748,78	-0,22
Margenausgleich				
MARGENAUSGLEICH CACEIS	CHF	226 146,66	227 855,58	0,03
MARGENAUSGLEICH CACEIS	USD	-407 645,39	-375 208,61	-0,05
MARGENAUSGLEICH CACEIS	EUR	760 423,24	760 423,24	0,11
MARGENAUSGLEICH CACEIS	GBP	16 331,76	18 586,28	0,00
SUMME Margenausgleich			631 656,49	0,09
Forderungen			67 436 635,82	10,02
Verbindlichkeiten			-57 273 135,93	-8,51
Finanzkonten			47 632 663,69	7,08
Nettovermögen			672 872 799,43	100,00

Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil CLASSIQUE EUR	EUR	153 481,622	1 409,48
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil I	EUR	19 503,093	1 550,88
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil R	EUR	299 879,808	103,67
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil R2	EUR	5 599,634	156,13
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil RS	EUR	2 050,100	1 058,00
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil U	EUR	160 060,881	156,85
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil V	EUR	230 033,709	1 062,57
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil Z	EUR	77 411,000	1 584,10

Informationen für Anleger in der Bundesrepublik Deutschland

Einrichtungen gemäß Art. 92 Abs. 1 der Richtlinie 2009/65/EG in der Fassung der Richtlinie (EU) 2019/1160

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

- Bei dieser Einrichtung können Anträge auf die Zeichnung, die Rücknahme und den Umtausch von Anteilen eingereicht werden.
- Sämtliche für einen Anteilinhaber bestimmte Zahlungen, einschließlich der Rücknahmeerlöse und etwaiger Ausschüttungen, können auf seinen Wunsch hin über diese Einrichtung geleitet werden.
- 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.
- 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 Gesellschaftssitz 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 Gesellschaftssitz der 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