



Unselbständiger Investmentfonds (FCP) nach
französischem Recht

HALBJAHRESBERICHT
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE

zum 28. März 2024

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	12 283 193,00
b) Bankguthaben	33 874 864,18
c) Sonstige vom OGA gehaltene Vermögenswerte	338 021 500,83
d) Vermögenswerte im Bestand des OGA insgesamt (Zeilen a+b+c)	384 179 558,01
e) Passiva	-5 601 509,91
f) Nettoinventarwert (Zeilen d+e = Nettovermögen des OGA)	378 578 048,10

(*) 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	124 635 690,40	84 832,083	1 469,20
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil I in EUR	C	10 068 572,68	6 220,339	1 618,65
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil R in EUR	C	29 631 035,27	273 864,558	108,19
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil R2 in EUR	C	458 304,97	2 810,518	163,06
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil RS in EUR	C	2 098 336,22	1 900,100	1 104,32
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil U in EUR	C	17 270 457,14	105 501,813	163,69
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil V in EUR	C	84 571 586,14	76 266,042	1 108,90
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil Z in EUR	C	109 844 065,28	66 394,103	1 654,42

ELEMENT DES WERTPAPIERBESTANDS

Elemente des Wertpapierbestands	Prozentsatz Nettovermögen (*)	Prozentsatz Vermögenswerte insgesamt (**)
A) Zulässige Wertpapiere und 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.	3,24	3,20
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 und 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.	9,30	9,17

(*) 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	12 283 193,00	3,24	3,20
INSGESAMT		12 283 193,00	3,24	3,20

(*) 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	1,12	1,10
DEUTSCHLAND	1,01	0,99
ITALIEN	0,74	0,73
FINNLAND	0,16	0,16
BELGIEN	0,08	0,08
LUXEMBURG	0,08	0,08
ÖSTERREICH	0,07	0,07
INSGESAMT	3,24	3,20

(*) 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	9,30	9,17
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	9,30	9,17

(*) 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 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.	22 053 109,58	20 326 453,64
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 und 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.	15 727 950,00	24 119 750,00

INFORMATION ÜBER VARIABLE VERWALTUNGSGEBÜHREN

	28/03/2024
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil CLASSIQUE EUR	
Garantiegebühren	0,00
Feste Verwaltungsgebühren	277 135,06
Prozentsatz für feste Verwaltungsgebühren	0,40
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	835,41
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	835,41
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Rückvergütungen von Verwaltungsgebühren	0,00
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil I	
Garantiegebühren	0,00
Feste Verwaltungsgebühren	16 422,80
Prozentsatz für feste Verwaltungsgebühren	0,24
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	16,55
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	16,55
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Rückvergütungen von Verwaltungsgebühren	0,00
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil R	
Garantiegebühren	0,00
Feste Verwaltungsgebühren	40 062,28
Prozentsatz für feste Verwaltungsgebühren	0,24
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	90,59
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	90,59
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Rückvergütungen von Verwaltungsgebühren	0,00
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil R2	
Garantiegebühren	0,00
Feste Verwaltungsgebühren	381,45
Prozentsatz für feste Verwaltungsgebühren	0,16
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	43,01
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,01
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	43,01
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,01
Rückvergütungen von 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.«

	28/03/2024
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil RS	
Garantiegebühren	0,00
Feste Verwaltungsgebühren	2 831,87
Prozentsatz für feste Verwaltungsgebühren	0,22
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
Rückvergütungen von Verwaltungsgebühren	0,00
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil U	
Garantiegebühren	0,00
Feste Verwaltungsgebühren	22 019,05
Prozentsatz für feste Verwaltungsgebühren	0,24
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	129,42
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	129,42
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Rückvergütungen von Verwaltungsgebühren	0,00
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil V	
Garantiegebühren	0,00
Feste Verwaltungsgebühren	200 441,22
Prozentsatz für feste Verwaltungsgebühren	0,23
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	636,22
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	636,22
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Rückvergütungen von Verwaltungsgebühren	0,00
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil Z	
Garantiegebühren	0,00
Feste Verwaltungsgebühren	54 722,57
Prozentsatz für feste Verwaltungsgebühren	0,10
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	359,79
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	359,79
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Rückvergütungen von 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.«

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				286 217 700,25
% des Nettovermögens				75,60%

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

EUROPÄISCHE UNION				125 599 493,92
EUROPÄISCHE INVESTITIONSBANK EUROPÄISCHE UNION				75 415 051,86
FRANZÖSISCHE REGIERUNG FRANKREICH				51 521 869,60
ITALIENISCHE REGIERUNG ITALIEN				20 023 271,35
DEUTSCHE REGIERUNG DEUTSCHLAND				15 877 738,25

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				181 217 700,28	
Natixis				64 999 999,97	
BNP Paribas Securities Services SC - LC				40 000 000,00	

5. Art und Qualität der Sicherheiten (Sicherheitshinterlegung)

Art					
- Aktien					
- Anleihen				288 437 424,98	
- OGA					
- TCN					
- Barmittel					

Währung der Sicherheit					
Euro				288 437 424,98	

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			15 877 738,25	
1 Monat bis 3 Monate			40 368 678,16	
3 Monate bis 1 Jahr			19 203 740,87	
Mehr als 1 Jahr			212 987 267,70	
Offen				

8. Laufzeit der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und TRS, aufgeschlüsselt nach Tranchen

Innerhalb 1 Tages				
1 Tag bis 1 Woche			19 076 000,00	
1 Woche bis 1 Monat			174 568 900,28	
1 Monat bis 3 Monate			76 721 099,97	
3 Monate bis 1 Jahr				
Mehr als 1 Jahr			15 851 700,00	
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			288 437 424,98	
Barmittel				

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				0,03	
- 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.

AUFSTELLUNG DER AKTIVA UND PASSIVA

Aufstellung der Bilanzpositionen

Bezeichnung der Wertpapiere nach Wirtschaftssektor (*)	Währung	Stückzahl/N ennwert	Zeitwert	% Nettovermögen
AKTIEN UND ÄHNLICHE WERTPAPIERE			12 283 193,00	3,24
An einem geregelten Markt gehandelte Aktien und ähnliche Wertpapiere			12 283 193,00	3,24
Versicherungen			2 222 400,00	0,59
ALLIANZ SE-REG	EUR	8 000	2 222 400,00	0,59
Bau- und Ingenieurwesen			323 100,00	0,09
HOCHTIEF	EUR	3 000	323 100,00	0,09
Kapitalmärkte			258 440,00	0,07
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	EUR	14 000	258 440,00	0,07
Baustoffe			327 600,00	0,09
BUZZI UNICEM ORD.	EUR	9 000	327 600,00	0,09
Medien			412 250,00	0,11
CTS EVENTIM AG	EUR	5 000	412 250,00	0,11
Öl und Gas			2 050 720,00	0,54
ENI SPA	EUR	140 000	2 050 720,00	0,54
Chemikalien			1 144 130,00	0,30
AZELIS GROUP NV	EUR	15 000	293 850,00	0,08
EVONIK INDUSTRIES AG	EUR	46 400	850 280,00	0,22
Halbleiter und Halbleiterausüstung			1 784 400,00	0,47
ASML HOLDING NV	EUR	2 000	1 784 400,00	0,47
Dienstleistungsanbieter			299 985,00	0,08
INPOST SA	EUR	21 000	299 985,00	0,08
Diversifizierte Finanzdienstleistungen			3 036 168,00	0,79
ING GROEP NV	EUR	160 000	2 439 360,00	0,63
MANDATUM HOLDING OY	EUR	144 000	596 808,00	0,16
Textilien, Bekleidung und Luxusgüter			424 000,00	0,11
BRUNELLO CUCINELLI SPA	EUR	4 000	424 000,00	0,11
ANTEILE AN OGA			35 215 560,00	9,31
OGAW			35 215 560,00	9,31
Anteile oder Aktien			35 215 560,00	9,31
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil Z	EUR	2 000	3 103 640,00	0,82
CANDRIAM MONEY MARKET EURO Z EUR ACC	EUR	20 200	21 383 720,00	5,66
CANDRIAM RISK ARBITRAGE Anteil Z	EUR	7 000	10 728 200,00	2,83
IN PENSION GENOMMENE WERTPAPIERE			286 217 700,25	75,60
An einem geregelten Markt gehandelte Anleihen und ähnliche Wertpapiere			286 217 700,25	75,60
Geschäftsbanken			137 354 508,82	36,28
BANQUE EUROPEAN D'INVESTISSEMENT 0.25% 14-09-29	EUR	20 000 000	17 512 000,00	4,63
BANQUE EUROPEAN D'INVESTISSEMENT 1.5% 16-10-48	EUR	17 055 000	12 269 400,00	3,24
BEI 0% 05/11/26	EUR	48 507 000	44 999 999,97	11,89

Aufstellung der Bilanzpositionen

Bezeichnung der Wertpapiere nach Wirtschaftssektor (*)	Währung	Stückzahl/Nennwert	Zeitwert	% Nettovermögen
EUROF 0.15 10/10/34	EUR	62 235 000	46 721 408,85	12,33
KFW 0.75% 28-06-28	EUR	17 100 000	15 851 700,00	4,19
KFW 1.125% 09-05-33 EMTN		0,00	0,00	0,00
Versorger			129 787 191,43	34,28
COMM EUR 1.125% 04-04-36 EMTN	EUR	18 977 000	15 654 674,85	4,14
EUROPEAN UNION 0.0% 02-06-28	EUR	9 000 000	7 992 900,00	2,11
EUROPEAN UNION 0.0% 04-07-29	EUR	28 968 000	25 000 000,00	6,60
EUROPEAN UNION 2.75% 04-02-33	EUR	10 100 000	10 049 500,00	2,65
FRAN GOVE BON 0.25% 25-11-26	EUR	11 900 000	11 090 116,58	2,93
FRTR 2 1/4 05/25/24	EUR	39 700 000	40 000 000,00	10,57
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.85% 15-09-26	EUR	19 677 000	20 000 000,00	5,28
Diversifizierte Finanzdienstleistungen			19 076 000,00	5,04
EUROPEAN FIX 270624	EUR	19 038 000	19 076 000,00	5,04
FORDERUNGEN AUS IN PENSION GENOMMENEN WERTPAPIEREN			1 416 191,69	0,37
Summe			335 132 644,94	88,52

(*) Der Wirtschaftszweig spiegelt die Hauptgeschäftstätigkeit des Emittenten des Finanzinstruments wider und entspricht dem für diesen Emittenten herausgegebenen NACE-Code.

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 - Aktien

Art des Geschäfts	Stückzahl/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag
		Aktiva	Passiva	+/-
1. Futures				
DJES BANKS 0624	-620	0,00	-288 271,25	-4 197 400,00
E-MIN RUS 200 0624	43	124 502,44	0,00	4 271 930,56
EURO STOXX 50 0624	-413	0,00	-494 023,16	-20 835 850,00
FTSE 100 FUT 0624	-7	0,00	-16 334,29	-654 026,55
SP 500 MINI 0624	-37	0,00	-152 376,16	-9 093 263,89
XAE ENERGY SE 0624	-48	0,00	-278 222,22	-4 446 222,22
Zwischensumme 1.		124 502,44	-1 229 227,08	-34 954 832,10
2. Optionen				
Zwischensumme 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Zwischensumme 3.		0,00	0,00	0,00
4. Sonstige Instrumente				
BC ADVERUM BI 1230	3 000	0,00	-15 436,11	39 277,78
BC TALKSPACE INC 123	24 000	12 888,89	0,00	79 333,33
BC UR-ENERGY 1230	35 000	0,00	-2 268,52	51 851,85
CFD BC 3M CO 1230	30 000	0,00	-10 211,11	2 946 388,89
CFD BC ABSCI CO 1230	12 000	2 444,44	0,00	63 111,11
CFD BC AKEBIA T 1230	35 000	3 888,89	0,00	59 305,56
CFD BC AMERICAN 1230	-58 000	11 755,74	0,00	-1 975 222,22
CFD BC BANCO SA 1230	308 000	66 374,00	0,00	448 1 40,00
CFD BC BEL FUSE 1230	1 000	7 833,33	0,00	65 564,81
CFD BC BLEND LA 1230	20 000	9 259,26	0,00	60 185,19
CFD BC CIBUS IN 1230	3 000	12 416,67	0,00	62 388,89
CFD BC CLEARWAT 1230	11 000	6 416,67	0,00	180 175,93
CFD BC CONVATEC 1230	100 000	0,00	-1 918,24	334 990,35
CFD BC DIANTHUS 1230	2 400	9 444,44	0,00	66 666,67
CFD BC DIEBOLD 1230	4 000	5 407,41	0,00	127 555,56
CFD BC DUTCH BR 1230	8 000	24 666,67	0,00	244 444,44
CFD BC FEDERATE 1230	7 000	1 555,56	0,00	234 111,11
CFD BC FREYR BA 1230	30 000	0,00	-2 802,78	46 666,67
CFD BC HERITAGE 1230	7 000	22 750,00	0,00	69 027,78
CFD BC INDUSTRI 1230	12 000	4 666,67	0,00	47 666,67
CFD BC INTERMED 1230	14 000	0,00	-6 831,74	336 347,15
CFD BC KOPIN CO 1230	25 000	0,00	-18 981,48	41 666,67
CFD BC KORRO BI 1230	1 000	37 685,19	0,00	83 333,33
CFD BC MATRIX S 1230	6 000	5 777,78	0,00	72 388,89
CFD BC METALS A 1230	5 000	2 546,30	0,00	59 490,74
CFD BC MONEYLIO 1230	1 000	18 018,52	0,00	66 037,04
CFD BC NATIONAL 1230	14 000	12 962,96	0,00	66 759,26
CFD BC NET POWE 1230	10 000	31 203,70	0,00	105 462,96
CFD BC NEUROGEN 1230	2 000	35 000,00	0,00	94 259,26
CFD BC PRAXIS P 1230	1 200	12 755,56	0,00	67 800,00
CFD BC QURATE R 1230	40 000	0,00	-5 155,56	45 555,56
CFD BC REAL BRO 1230	16 501	2 646,38	0,00	47 669,56

Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Aktien

Art des Geschäfts	Stückzahl/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag
		Aktiva	Passiva	+/-
CFD BC ROADZEN 1230	8 000	2 074,07	0,00	48 148,15
CFD BC ROIVANT 1230	0,00	0,00	0,00	0,00
CFD BC SOLENO T 1230	2 000	0,00	-2 961,48	79 259,26
CFD BC SPYRE TH 1230	7 000	52 046,30	0,00	245 842,59
CFD BC STANDARD 1230	22 000	4 277,78	0,00	55 203,70
CFD BC TECNOGLA 1230	3 000	20 083,33	0,00	144 527,78
CFD BC VAR ENER 1230	110 000	0,00	-5 663,12	334 698,93
CFD BC VERASTEM 1230	5 000	0,00	-5 648,15	54 629,63
CFD BC VERTEX I 1230	7 000	12 740,00	0,00	205 851,85
CFD BC VIPER EN 1230	7 000	11 861,11	0,00	249 277,78
CFD BC WHEELS U 1230	32 000	0,00	-1 185,19	85 037,04
CFD CGMD AIR PR 1230	0,00	0,00	0,00	0,00
CFD CGMD EQT AB 1230	-35 000	8 175,96	0,00	-1 026 238,31
CFD CGMD SALESF 1230	6 000	6 823,89	0,00	1 673 222,22
CFD CGMD SAP SE 1230	-12 000	0,00	-72 855,40	-2 165 520,00
CFD CGMD SKANDI 1230	140 000	0,00	-120 584,52	1 757 273,99
CFD CGME HSBC H 1230	300 000	73 056,90	0,00	2 172 056,85
CFD DECK JP 1230	-2 000	0,00	-58 764,63	-1 743 074,07
CFD JP ADIDAS 1230	-7 000	0,00	-140 000,00	-1 449 000,00
CFD JPM IAG EUR 1230	234 000	83 304,00	0,00	484 380,00
CFD JPX CASTELL 1230	-51 200	0,00	-56 529,27	-624 703,84
CFD JPX COVIVIO 1230	8 800	67 760,00	0,00	419 760,00
CFD JPX GECINA 1230	7 600	33 820,00	0,00	719 340,00
CFD JPX HERSHEY 1230	-11 000	0,00	-10 369,54	-1 981 018,52
CFD JPX MERCK & 1230	36 000	346 450,00	0,00	4 398 333,33
CFD JPX NIKE IN 1230	14 000	0,00	-102 407,41	1 218 259,26
CFD JPX NOVARTI 1230	22 000	38 544,95	0,00	1 975 985,61
CFD JPX NOVARTI 1230	15 000	0,00	-33 113,89	1 343 472,22
CFD JPX NOVOZYM 1230	-16 000	0,00	-27 885,78	-869 178,17
CFD JPX PEPSICO 1230	4 333	41 326,39	0,00	702 146,60
CFD JPX PFIZER 1230	-210 000	50 750,93	0,00	-5 395 833,33
CFD JPX PROCTER 1230	-9 000	0,00	-4 105,83	-1 352 083,33
CFD JPX ROCHE H 1230	6 000	25 488,97	0,00	1 416 808,02
CFD JPX SANOFI 1230	-15 000	0,00	-20 053,50	-1 364 400,00
CFD JPX SHELL P 1230	-34 000	0,00	-88 998,15	-2 110 518,52
CFD JPX SODEXO 1230	40 000	179 200,00	0,00	3 179 200,00
CFD JPX UNIBAIL 1230	-3 200	0,00	-17 344,00	-238 400,00
CFD JPX VERALTO 1230	16 500	29 027,78	0,00	1 354 527,78
CFD JPX VESTIS 1230	42 000	21 777,78	0,00	749 388,89
CFD MSE B&M EUR 1230	49 000	7 450,73	0,00	312 815,95
CFD MSE FISCHER 1230	4 000	3 700,85	0,00	275 096,38
CFD MSE FLUGHAF 1230	1 700	30 233,87	0,00	357 563,61
CFD MSE MAGNOLI 1230	-94 000	0,00	-140 955,11	-2 258 611,11
CFD MSE SANDOZ 1230	36 000	0,00	-27 386,28	1 007 000,77
CFD MSE WEIR GR 1230	13 000	25 849,46	0,00	307 456,58

Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Aktien

Art des Geschäfts	Stückzahl/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag
		Aktiva	Passiva	+/-
CFD TRELLEBORG 1230	13 000	337,72	0,00	431 044,34
CFD UBS ALLSTAT 1230	13 000	129 534,17	0,00	2 082 527,78
CFD UBS ALPHABE 1230	30 000	279 091,67	0,00	4 229 444,44
CFD UBS ANDRITZ 1230	6 000	0,00	-7 200,00	346 800,00
CFD UBS APPLE I 1230	26 000	0,00	-28 691,48	4 128 222,22
CFD UBS BELIMO 1230	700	15 255,72	0,00	318 211,26
CFD UBS BGC GRO 1230	-260 000	141 435,19	0,00	-1 870 555,56
CFD UBS BLACKLI 1230	-32 000	30 527,41	0,00	-1 913 481,48
CFD UBS BLACKST 1230	13 000	39 481,48	0,00	1 581 305,56
CFD UBS BOX INC 1230	-74 000	73 397,04	0,00	-1 940 444,44
CFD UBS CUMMINS 1230	-4 000	0,00	-95 303,33	-1 091 296,30
CFD UBS DEERE & 1230	6 000	151 305,56	0,00	2 281 888,89
CFD UBS GENERAL 1230	55 000	236 693,52	0,00	2 309 490,74
CFD UBS MAR PET 1230	12 000	84 464,44	0,00	2 238 888,89
CFD UBS NATURGY 1230	46 000	0,00	-46 000,00	924 600,00
CFD UBS REXEL S 1230	-44 000	0,00	-58 960,00	-1 101 320,00
CFD UBS RTX COR 1230	50 000	211 671,30	0,00	4 515 277,78
CFD UBS SSAB AB 1230	53 000	0,00	-3 304,47	362 114,65
CGMD LINDE PL 1230	0,00	0,00	0,00	0,00
CH NESTLE CHF 1230	15 000	15 907,48	0,00	1 476 484,19
CH TOTALENERGIES EUR	68 000	249 560,00	0,00	4 315 960,00
JP CVX USD 1230	15 000	113 012,50	0,00	2 190 833,33
JPX LINDE PLC 1230	-9 000	31 329,17	0,00	-3 869 416,67
JPX PLUXEE FR 1230	40 000	25 200,00	0,00	1 096 000,00
L'OREAL CHA 1230	3 200	18 784,64	0,00	1 403 680,00
UBS BANKINTER 1230	48 000	37 632,00	0,00	325 536,00
Zwischensumme 4.		3 420 811,09	-1 239 876,07	33 858 181,98
Summe		3 545 313,53	-2 469 103,15	-1 096 650,12

(*) 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				
NQ USA NASDAQ 0624	-25	0,00	-187 876,55	-8 553 240,74
XEUR FSMI SWI 0624	-8	0,00	-5 839,12	-956 874,84
Zwischensumme 1.		0,00	-193 715,67	-9 510 115,58
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	-193 715,67	-9 510 115,58

(*) 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)	335 132 644,94
Aufstellung der Finanztermingeschäfte (ohne Geschäfte zur Absicherung ausgegebener Anteile):	
Summe Devisentermingeschäfte	0,00
Summe Finanztermingeschäfte - Aktien	1 076 210,38
Summe Finanztermingeschäfte - Zinsen	0,00
Summe Finanztermingeschäfte - Wechselkurse	0,00
Summe Finanztermingeschäfte - Kreditrisiko	0,00
Summe Finanztermingeschäfte - Sonstige Risiken	-193 715,67
Aufstellung der Finanztermingeschäfte zur Absicherung ausgegebener Anteile	0,00
Sonstige Vermögenswerte (+)	45 501 599,54
Sonstige Verbindlichkeiten (-)	-2 938 691,09
Verbindlichkeiten aus Finanzierungen (-)	0,00
Summe = Nettovermögen	378 578 048,10

Bezeichnung der Anteilsklasse	Währung der Anteile	Anzahl der Anteile	Nettoinventarwert
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil CLASSIQUE EUR	EUR	84 832,083	1 469,20
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil I	EUR	6 220,339	1 618,65
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil R	EUR	273 864,558	108,19
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil R2	EUR	2 810,518	163,06
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil RS	EUR	1 900,100	1 104,32
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil U	EUR	105 501,813	163,69
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil V	EUR	76 266,042	1 108,90
Anteile CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Anteil Z	EUR	66 394,103	1 654,42

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 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.
- 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 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 Aufwendungserstattungen 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