

FIC de derecho francés

FOLLETO SEMESTRAL
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE

a 28 de marzo de 2024

Sociedad Gestora: CANDRIAM

Auditor de cuentas: PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDIT

CANDRIAM - 19-21 route d'Arlon - L-8009 Strassen - Gran Ducado de Luxemburgo

ESTADO DEL PATRIMONIO EN EUR

Elementos del estado del patrimonio	Importe al cierre del periodo(*)
a) Títulos financieros admisibles mencionados en el apartado 1.º del inciso I del artículo L. 214-20 del Código Monetario y Financiero	12 283 193,00
b) Activos bancarios	33 874 864,18
c) Otros activos mantenidos por la IIC	338 021 500,83
d) Total de activos mantenidos por la IIC (líneas a+b+c)	384 179 558,01
e) Pasivo	-5 601 509,91
f) Valor liquidativo (líneas d+e = patrimonio neto de la IIC)	378 578 048,10

(*) Los importes están certificados

NÚMERO DE PARTICIPACIONES EN CIRCULACIÓN Y VALOR LIQUIDATIVO POR PARTICIPACIÓN

Participación	Tipo de participación	Patrimonio neto de la participación	Número de participaciones en circulación	Valor liquidativo por participación
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación CLASSIQUE EUR en EUR	C	124 635 690,40	84 832,083	1 469,20
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación I en EUR	C	10 068 572,68	6 220,339	1 618,65
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación R en EUR	C	29 631 035,27	273 864,558	108,19
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación R2 en EUR	C	458 304,97	2 810,518	163,06
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación RS en EUR	C	2 098 336,22	1 900,100	1 104,32
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación U en EUR	C	17 270 457,14	105 501,813	163,69
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación V en EUR	C	84 571 586,14	76 266,042	1 108,90
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación Z en EUR	C	109 844 065,28	66 394,103	1 654,42

ELEMENTO DE LA CARTERA DE VALORES

Elementos de la cartera de valores	Porcentaje del patrimonio neto(*)	Porcentaje total de los activos(**)
A) Títulos financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en un mercado regulado en el sentido del artículo L. 422-1 del Código Monetario y Financiero. Y B) Títulos financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en otro mercado regulado, con funcionamiento regular, reconocido, abierto al público y cuyo domicilio se encuentre en un Estado miembro de la Unión Europea o en otro Estado que haya suscrito el acuerdo sobre el Espacio Económico Europeo.	3,24	3,20
C) Títulos financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores de un país tercero o negociados en otro mercado de un país tercero, regulado, con funcionamiento regular, reconocido y abierto al público, siempre y cuando dicha bolsa o mercado no figuren en una lista elaborada por la Autoridad de los Mercados Financieros o su elección haya sido prevista por la ley, por el reglamento o por los estatutos del organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios.	0,00	0,00
D) Títulos financieros admisibles de emisión reciente mencionados en el apartado 4.º del inciso I del artículo R. 214-11 del Código Monetario y Financiero.	0,00	0,00
E) Otros activos.	9,30	9,17

(*) Véase el apartado f) del estado del patrimonio

(**) Véase el apartado d) del estado del patrimonio

DESGLOSE DE LOS ACTIVOS DE A), B), C) Y D) DE LA CARTERA DE VALORES, POR DIVISA

Títulos	Divisa	En importe (EUR)	Porcentaje del patrimonio neto(*)	Porcentaje total de los activos(**)
Euro	EUR	12 283 193,00	3,24	3,20
TOTAL		12 283 193,00	3,24	3,20

(*) Véase el apartado f) del estado del patrimonio
(**) Véase el apartado d) del estado del patrimonio

DESGLOSE DE LOS ACTIVOS DE A), B), C) Y D) DE LA CARTERA DE VALORES, POR PAÍS DE RESIDENCIA DEL EMISOR

País	Porcentaje del patrimonio neto(*)	Porcentaje total de los activos(**)
PAÍSES BAJOS	1,12	1,10
ALEMANIA	1,01	0,99
ITALIA	0,74	0,73
FINLANDIA	0,16	0,16
BÉLGICA	0,08	0,08
LUXEMBURGO	0,08	0,08
AUSTRIA	0,07	0,07
TOTAL	3,24	3,20

(*) Véase el apartado f) del estado del patrimonio
(**) Véase el apartado d) del estado del patrimonio

DESGLOSE DE LOS OTROS ACTIVOS DE E) DE LA CARTERA DE VALORES, POR TIPO

Tipo de activos	Porcentaje del patrimonio neto(*)	Porcentaje total de los activos(**)
OICVM y equivalentes de otros Estados miembros de la Unión Europea	9,30	9,17
Otras IIC y fondos de inversión	0,00	0,00
FIA y equivalentes de otros Estados miembros de la Unión Europea	0,00	0,00
Otros	0,00	0,00
TOTAL	9,30	9,17

(*) Véase el apartado f) del estado del patrimonio
(**) Véase el apartado d) del estado del patrimonio

MOVIMIENTOS EN LA CARTERA DE VALORES DURANTE EL PERIODO EN EUR

Elementos de la cartera de valores	Movimientos (en importe)	
	Adquisiciones	Cesiones
A) Títulos financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en un mercado regulado en el sentido del artículo L. 422-1 del Código Monetario y Financiero. Y B) Títulos financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en otro mercado regulado, con funcionamiento regular, reconocido, abierto al público y cuyo domicilio se encuentre en un Estado miembro de la Unión Europea o en otro Estado que haya suscrito el acuerdo sobre el Espacio Económico Europeo.	22 053 109,58	20 326 453,64
C) Títulos financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores de un país tercero o negociados en otro mercado de un país tercero, regulado, con funcionamiento regular, reconocido y abierto al público, siempre y cuando dicha bolsa o mercado no figuren en una lista elaborada por la Autoridad de los Mercados Financieros o su elección haya sido prevista por la ley, por el reglamento o por los estatutos del organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios.	0,00	0,00
D) Títulos financieros admisibles de emisión reciente mencionados en el apartado 4.º del inciso I del artículo R. 214-11 del Código Monetario y Financiero.	0,00	0,00
E) Otros activos.	15 727 950,00	24 119 750,00

INFORMACIÓN SOBRE LOS GASTOS DE GESTIÓN VARIABLES

	28/03/2024
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación CLASSIQUE EUR	
Comisiones de garantía	0,00
Gastos de gestión fijos	277 135,06
Porcentaje de gastos de gestión fijos	0,40
Gastos de gestión variables objeto de provisión	835,41
Porcentaje de gastos de gestión variables objeto de provisión	0,00
Gastos de gestión variables cobrados	835,41
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,00
Retrocesión de los gastos de gestión	0,00
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación I	
Comisiones de garantía	0,00
Gastos de gestión fijos	16 422,80
Porcentaje de gastos de gestión fijos	0,24
Gastos de gestión variables objeto de provisión	16,55
Porcentaje de gastos de gestión variables objeto de provisión	0,00
Gastos de gestión variables cobrados	16,55
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,00
Retrocesión de los gastos de gestión	0,00
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación R	
Comisiones de garantía	0,00
Gastos de gestión fijos	40 062,28
Porcentaje de gastos de gestión fijos	0,24
Gastos de gestión variables objeto de provisión	90,59
Porcentaje de gastos de gestión variables objeto de provisión	0,00
Gastos de gestión variables cobrados	90,59
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,00
Retrocesión de los gastos de gestión	0,00
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación R2	
Comisiones de garantía	0,00
Gastos de gestión fijos	381,45
Porcentaje de gastos de gestión fijos	0,16
Gastos de gestión variables objeto de provisión	43,01
Porcentaje de gastos de gestión variables objeto de provisión	0,01
Gastos de gestión variables cobrados	43,01
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,01
Retrocesión de los gastos de gestión	0,00

«El importe de los gastos de gestión variables mostrado anteriormente corresponde a la suma de las provisiones y las recuperaciones de provisiones que han incidido en el patrimonio neto durante el período analizado».

	28/03/2024
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación RS	
Comisiones de garantía	0,00
Gastos de gestión fijos	2 831,87
Porcentaje de gastos de gestión fijos	0,22
Gastos de gestión variables objeto de provisión	0,00
Porcentaje de gastos de gestión variables objeto de provisión	0,00
Gastos de gestión variables cobrados	0,00
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,00
Retrocesión de los gastos de gestión	0,00
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación U	
Comisiones de garantía	0,00
Gastos de gestión fijos	22 019,05
Porcentaje de gastos de gestión fijos	0,24
Gastos de gestión variables objeto de provisión	129,42
Porcentaje de gastos de gestión variables objeto de provisión	0,00
Gastos de gestión variables cobrados	129,42
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,00
Retrocesión de los gastos de gestión	0,00
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación V	
Comisiones de garantía	0,00
Gastos de gestión fijos	200 441,22
Porcentaje de gastos de gestión fijos	0,23
Gastos de gestión variables objeto de provisión	636,22
Porcentaje de gastos de gestión variables objeto de provisión	0,00
Gastos de gestión variables cobrados	636,22
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,00
Retrocesión de los gastos de gestión	0,00
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación Z	
Comisiones de garantía	0,00
Gastos de gestión fijos	54 722,57
Porcentaje de gastos de gestión fijos	0,10
Gastos de gestión variables objeto de provisión	359,79
Porcentaje de gastos de gestión variables objeto de provisión	0,00
Gastos de gestión variables cobrados	359,79
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,00
Retrocesión de los gastos de gestión	0,00

«El importe de los gastos de gestión variables mostrado anteriormente corresponde a la suma de las provisiones y las recuperaciones de provisiones que han incidido en el patrimonio neto durante el periodo analizado».

Reglamento SFTR en EUR

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
--	-------------------------	---------------------------	----------------------	---------------------------------	-----

1. Títulos y materias primas prestados

Importe					
% del patrimonio neto*					

* % excluidos el efectivo y los equivalentes de efectivo

2. Activos pignoralos para cada tipo de operación de financiación de valores y TRS expresados en valor absoluto

Importe				286 217 700,25	
% del patrimonio neto				75,60%	

3. Diez emisores principales de garantías recibidas (excluido el efectivo) para todos los tipos de operaciones de financiación

UNIÓN EUROPEA				125 599 493,92	
BANCO EUROPEO DE INVERSIONES UNIÓN EUROPEA				75 415 051,86	
GOBIERNO FRANCÉS FRANCIA				51 521 869,60	
GOBIERNO ITALIANO ITALIA				20 023 271,35	
GOBIERNO ALEMÁN ALEMANIA				15 877 738,25	

Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
----------------------	------------------------	-------------------	---------------------------	-----

4. 10 contrapartes principales en valor absoluto de los activos y los pasivos sin compensación

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. Tipo y calidad de las garantías

Tipo					
- Acciones					
- Obligaciones				288 437 424,98	
- IIC					
- Títulos de deuda negociables					
- Efectivo					

Moneda de la garantía					
Euro				288 437 424,98	

6. Pago y compensación de contratos

Tripartitos				X	
Contraparte central					
Bilaterales				X	

Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
----------------------	------------------------	-------------------	---------------------------	-----

7. Vencimiento de la garantía desglosado por tramos

Menos de 1 día					
De 1 día a 1 semana					
De 1 semana a 1 mes				15 877 738,25	
De 1 a 3 meses				40 368 678,16	
De 3 meses a 1 año				19 203 740,87	
Más de 1 año				212 987 267,70	
Abiertas					

8. Vencimiento de las operaciones de financiación de valores y las TRS desglosado por tramos

Menos de 1 día					
De 1 día a 1 semana				19 076 000,00	
De 1 semana a 1 mes				174 568 900,28	
De 1 a 3 meses				76 721 099,97	
De 3 meses a 1 año					
Más de 1 año				15 851 700,00	
Abiertas					

9. Datos sobre reutilización de las garantías

Importe máximo (%)					
Importe utilizado (%)					
Ingresos para la IIC tras la reinversión de las garantías en efectivo en euros					

10. Datos sobre la conservación de las garantías recibidas por la IIC

CACEIS Bank					
Títulos				288 437 424,98	
Efectivo					

11. Datos sobre la conservación de las garantías suministradas por la IIC

Títulos					
Efectivo					

Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
----------------------	------------------------	-------------------	---------------------------	-----

12. Datos sobre los ingresos y los costes desglosados

Ingresos					
- IIC				0,03	
- Gestor					
- Terceros					
Costes					
- IIC					
- Gestor					
- Terceros					

13. Datos sobre el tipo y la calidad de las garantías (colateral)

Garantía únicamente en efectivo.

14. Datos sobre reutilización de las garantías

La IIC podrá reinvertir las garantías recibidas en efectivo en operaciones con pacto de recompra inversa o en títulos elegibles reglamentariamente para el activo, en especial títulos de capital, productos de tipos, títulos de crédito o participaciones de IIC. Las garantías recibidas en forma de títulos podrán conservarse, venderse o volver a entregarse como garantía.

El importe máximo de reutilización es del 100 % del efectivo y los títulos recibidos.

15. Datos sobre la conservación de las garantías suministradas por la IIC

Garantía únicamente en efectivo.

16. Datos sobre los ingresos y los costes desglosados

No se han realizado operaciones de adquisiciones y cesiones temporales de títulos.

INVENTARIO DE ACTIVOS Y PASIVOS

Inventario de elementos del balance

Designación de los valores por sector económico(*)	Divisa	Cantidad o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
ACCIONES Y VALORES SIMILARES			12 283 193,00	3,24
Acciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar			12 283 193,00	3,24
Seguros			2 222 400,00	0,59
ALLIANZ SE-REG	EUR	8 000	2 222 400,00	0,59
Construcción e ingeniería			323 100,00	0,09
HOCHTIEF	EUR	3 000	323 100,00	0,09
Mercados de capitales			258 440,00	0,07
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	EUR	14 000	258 440,00	0,07
Materiales de construcción			327 600,00	0,09
BUZZI UNICEM ORD.	EUR	9 000	327 600,00	0,09
Medios de comunicación			412 250,00	0,11
CTS EVENTIM AG	EUR	5 000	412 250,00	0,11
Petróleo y gas			2 050 720,00	0,54
ENI SPA	EUR	140 000	2 050 720,00	0,54
Productos químicos			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
Semiconductores y equipos para fabricación			1 784 400,00	0,47
ASML HOLDING NV	EUR	2 000	1 784 400,00	0,47
Servicios a profesionales			299 985,00	0,08
INPOST SA	EUR	21 000	299 985,00	0,08
Productos financieros diversificados			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
Textiles, ropa y productos de lujo			424 000,00	0,11
BRUNELLO CUCINELLI SPA	EUR	4 000	424 000,00	0,11
TÍTULOS DE IIC			35 215 560,00	9,31
OICVM			35 215 560,00	9,31
Participaciones o acciones			35 215 560,00	9,31
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación 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 Participación Z	EUR	7 000	10 728 200,00	2,83
TÍTULOS FINANCIEROS RECIBIDOS EN EL MARCO DE UN PACTO DE RECOMPRA INVERSA			286 217 700,25	75,60
Obligaciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar			286 217 700,25	75,60
Bancos comerciales			137 354 508,82	36,28
BANQUE EUROPEAN DINVESTISSEMENT 0.25% 14-09-29	EUR	20 000 000	17 512 000,00	4,63
BANQUE EUROPEAN DINVESTISSEMENT 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

Inventario de elementos del balance

Designación de los valores por sector económico(*)	Divisa	Cantidad o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
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
Servicios públicos			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
Productos financieros diversificados			19 076 000,00	5,04
EUROPEAN FIX 270624	EUR	19 038 000	19 076 000,00	5,04
INDEMNIZACIONES SOBRE TÍTULOS RECIBIDOS EN EL MARCO DE UN PACTO DE RECOMPRA INVERSA			1 416 191,69	0,37
Total			335 132 644,94	88,52

(*) El sector de actividad representa la actividad principal ejercida por el emisor del instrumento financiero y se ha obtenido a partir del código NACE publicado para dicho emisor.

Inventario de operaciones de divisas a plazo

Tipo de operación	Valor actual presentado en el balance		Importe de la exposición(*)			
	Activo	Pasivo	Divisas por recibir(+)		Divisas por entregar(-)	
			Divisa	Importe(*)	Divisa	Importe(*)
Total	0,00	0,00		0,00		0,00

(*) Importe determinado conforme a las disposiciones del reglamento relativo a la presentación de las exposiciones expresado en la divisa de contabilización.

Inventario de instrumentos financieros a plazo: acciones

Naturaleza de los compromisos	Cantidad o nominal	Valor actual presentado en el balance		Importe de la exposición(*)
		Activo	Pasivo	+/-
1. Futuros				
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
Subtotal 1.		124 502,44	-1 229 227,08	-34 954 832,10
2. Opciones				
Subtotal 2.		0,00	0,00	0,00
3. Permutas				
Subtotal 3.		0,00	0,00	0,00
4. Otros instrumentos				
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

Inventario de instrumentos financieros a plazo: acciones

Naturaleza de los compromisos	Cantidad o nominal	Valor actual presentado en el balance		Importe de la exposición(*)
		Activo	Pasivo	+/-
CFD BC ROADZEN 1230	8 000	2 074,07	0,00	48 1 48,15
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

Inventario de instrumentos financieros a plazo: acciones

Naturaleza de los compromisos	Cantidad o nominal	Valor actual presentado en el balance		Importe de la exposición(*)
		Activo	Pasivo	+/-
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
Subtotal 4.		3 420 811,09	-1 239 876,07	33 858 181,98
Total		3 545 313,53	-2 469 103,15	-1 096 650,12

(*) Importe determinado conforme a las disposiciones del reglamento relativo a la presentación de las exposiciones.

Inventario de instrumentos financieros a plazo: tipos de interés

Naturaleza de los compromisos	Cantidad o nominal	Valor actual presentado en el balance		Importe de la exposición(*)
		Activo	Pasivo	+/-
1. Futuros				
Subtotal 1.		0,00	0,00	0,00
2. Opciones				
Subtotal 2.		0,00	0,00	0,00
3. Permutas				
Subtotal 3.		0,00	0,00	0,00
4. Otros instrumentos				
Subtotal 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Importe determinado conforme a las disposiciones del reglamento relativo a la presentación de las exposiciones.

Inventario de instrumentos financieros a plazo: de cambio

Naturaleza de los compromisos	Cantidad o nominal	Valor actual presentado en el balance		Importe de la exposición(*)
		Activo	Pasivo	+/-
1. Futuros				
Subtotal 1.		0,00	0,00	0,00
2. Opciones				
Subtotal 2.		0,00	0,00	0,00
3. Permutas				
Subtotal 3.		0,00	0,00	0,00
4. Otros instrumentos				
Subtotal 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Importe determinado conforme a las disposiciones del reglamento relativo a la presentación de las exposiciones.

Inventario de instrumentos financieros a plazo: sobre riesgo de crédito

Naturaleza de los compromisos	Cantidad o nominal	Valor actual presentado en el balance		Importe de la exposición(*)
		Activo	Pasivo	+/-
1. Futuros				
Subtotal 1.		0,00	0,00	0,00
2. Opciones				
Subtotal 2.		0,00	0,00	0,00
3. Permutas				
Subtotal 3.		0,00	0,00	0,00
4. Otros instrumentos				
Subtotal 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Importe determinado conforme a las disposiciones del reglamento relativo a la presentación de las exposiciones.

Inventario de instrumentos financieros a plazo: otras exposiciones

Naturaleza de los compromisos	Cantidad o nominal	Valor actual presentado en el balance		Importe de la exposición(*)
		Activo	Pasivo	+/-
1. Futuros				
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
Subtotal 1.		0,00	-193 715,67	-9 510 115,58
2. Opciones				
Subtotal 2.		0,00	0,00	0,00
3. Permutas				
Subtotal 3.		0,00	0,00	0,00
4. Otros instrumentos				
Subtotal 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	-193 715,67	-9 510 115,58

(*) Importe determinado conforme a las disposiciones del reglamento relativo a la presentación de las exposiciones.

Inventario de instrumentos financieros a plazo o de operaciones a plazo de divisas utilizados como cobertura de una categoría de participaciones

La IIC analizada no se ve afectada por esta partida.

Síntesis del inventario

	Valor actual presentado en el balance
Total del inventario de activos y pasivos admisibles (excluidos los instrumentos financieros a plazo)	335 132 644,94
Inventario de los instrumentos financieros a plazo (excluidos los instrumentos financieros a plazo utilizados como cobertura de participaciones emitidas):	
Total de operaciones de divisas a plazo	0,00
Total de instrumentos financieros a plazo: acciones	1 076 210,38
Total de instrumentos financieros a plazo: tipos de interés	0,00
Total de instrumentos financieros a plazo: de cambio	0,00
Total de instrumentos financieros a plazo: de crédito	0,00
Total de instrumentos financieros a plazo: otras exposiciones	-193 715,67
Inventario de los instrumentos financieros a plazo utilizados como cobertura de participaciones emitidas	0,00
Otros activos(+)	45 501 599,54
Otros pasivos(-)	-2 938 691,09
Pasivos de financiación(-)	0,00
Total = patrimonio neto	378 578 048,10

Denominación de la participación	Divisa de la participación	Número de participaciones	Valor liquidativo
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación CLASSIQUE EUR	EUR	84 832,083	1 469,20
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación I	EUR	6 220,339	1 618,65
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación R	EUR	273 864,558	108,19
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación R2	EUR	2 810,518	163,06
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación RS	EUR	1 900,100	1 104,32
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación U	EUR	105 501,813	163,69
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación V	EUR	76 266,042	1 108,90
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación Z	EUR	66 394,103	1 654,42