



FIC de derecho francés

FOLLETO SEMESTRAL

**CANDRIAM INDEX ARBITRAGE**

a 31 de marzo de 2023

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	14 001 285,00
b) Activos bancarios	54 707 345,77
c) Otros activos mantenidos por la IIC	673 387 134,53
d) Total de activos mantenidos por la IIC (líneas a+b+c)	742 095 765,30
e) Pasivo	-69 222 965,87
f) Valor liquidativo (líneas d+e = patrimonio neto de la IIC)	672 872 799,43

\* Los importes están certificados

## NÚMERO DE PARTICIPACIONES EN CIRCULACIÓN Y VALOR LIQUIDATIVO POR PARTICIPACIÓN

Participación	Tipo de participación	Patrimonio neto por participación	Número de participaciones en circulación	Valor liquidativo por participación
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación CLASSIQUE EUR en EUR	C	216 330 526,08	153 481,622	1 409,48
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación I en EUR	C	30 247 110,20	19 503,093	1 550,88
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación R en EUR	C	31 091 323,25	299 879,808	103,67
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación R2 en EUR	C	874 319,03	5 599,634	156,13
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación RS en EUR	C	2 169 011,09	2 050,100	1 058,00
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación U en EUR	C	25 105 599,89	160 060,881	156,85
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación V en EUR	C	244 427 848,28	230 033,709	1 062,57
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación Z en EUR	C	122 627 061,61	77 411,000	1 584,10

## ELEMENTOS 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.	2,08	1,89
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.		
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.	7,69	6,98

\* 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**

<b>Títulos</b>	<b>Divisa</b>	<b>En importe (EUR)</b>	<b>Porcentaje del patrimonio neto *</b>	<b>Porcentaje total de los activos **</b>
Euro	EUR	14 001 285,00	2,08	1,89
<b>TOTAL</b>		<b>14 001 285,00</b>	<b>2,08</b>	<b>1,89</b>

\* 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**

<b>País</b>	<b>Porcentaje del patrimonio neto *</b>	<b>Porcentaje total de los activos **</b>
FINLANDIA	0,75	0,68
ALEMANIA	0,65	0,59
PAÍSES BAJOS	0,34	0,31
LUXEMBURGO	0,33	0,30
TOTAL	2,08	1,89

\* 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 **
<b>Instituciones de inversión colectiva</b>		
OICVM y FIA con vocación general destinados a no profesionales y equivalentes de otros países	7,69	6,98
Otros fondos destinados a no profesionales y equivalentes de otros Estados miembros de la UE	0,00	0,00
Fondos profesionales con vocación general y equivalentes de otros Estados miembros de la UE y organismos de titulización cotizados	0,00	0,00
Otros fondos de inversión profesionales y equivalentes de otros Estados miembros de la UE y organismos de titulización no cotizados	0,00	0,00
Otros organismos no europeos	0,00	0,00
<b>Otros activos</b>		
Otros	0,00	0,00
<b>TOTAL</b>	<b>7,69</b>	<b>6,98</b>

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

## INFORMACIÓN SOBRE LOS GASTOS DE GESTIÓN VARIABLES

	<b>31/03/2023</b>
<b>Participaciones CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación CLASSIQUE EUR</b>	
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
<b>Participaciones CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación I</b>	
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
<b>Participaciones CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación R</b>	
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
<b>Participaciones CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación R2</b>	
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
<b>Participaciones CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación RS</b>	
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
<b>Participaciones CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación U</b>	
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
<b>Participaciones CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación V</b>	
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



**INFORMACIÓN SOBRE LOS GASTOS DE GESTIÓN VARIABLES (continuación)**

	<b>31/03/2023</b>
<b>Participaciones CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación Z</b>	
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

## **Reglamento SFTR en EUR**

<b>Préstamos de títulos</b>	<b>Empréstitos de títulos</b>	<b>Pacto de recompra</b>	<b>Pacto de recompra inversa</b>	<b>TRS</b>
-----------------------------	-------------------------------	--------------------------	----------------------------------	------------

### **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				549 156 020,58	
% del patrimonio neto				81,62%	

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

UNIÓN EUROPEA				215 821 734,67	
GOBIERNO ALEMÁN ALEMANIA				80 308 531,69	
GOBIERNO BELGA BÉLGICA				79 341 431,12	
GOBIERNO FRANCÉS FRANCIA				70 686 661,13	
GOBIERNO ITALIANO ITALIA				56 839 416,55	
BANCO EUROPEO DE INVERSIONES UNIÓN EUROPEA				45 627 491,63	

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 son compensación**

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. Tipo y calidad de las garantías**

Tipo					
- Acciones					
- Obligaciones				548 625 266,79	
- IIC					
- Títulos de deuda negociables					
- Efectivo					

Moneda de la garantía					
Euro				548 625 266,79	

**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			18 653 044,60	
De 1 a 3 meses				
De 3 meses a 1 año			40 066 983,56	
Más de 1 año			489 905 238,63	
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				
De 1 semana a 1 mes			374 479 786,30	
De 1 a 3 meses			174 145 480,49	
De 3 meses a 1 año				
Más de 1 año				
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			548 625 266,79	
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				239 637,80	
- 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.

**CARTERA DE VALORES DETALLADA A 31/03/2023 EN EUR**

Designación de los valores	Divisa	Número o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
<b>Acciones y valores similares</b>				
<b>Acciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar</b>				
<b>ALEMANIA</b>				
COVESTRO AG	EUR	101 000	3 851 130,00	0,57
CTS EVENTIM AG	EUR	9 500	545 775,00	0,08
<b>TOTAL DE ALEMANIA</b>			<b>4 396 905,00</b>	<b>0,65</b>
<b>FINLANDIA</b>				
FORTUM CORPORATION	EUR	150 000	2 117 250,00	0,31
NESTE OYJ	EUR	65 000	2 952 950,00	0,45
<b>TOTAL DE FINLANDIA</b>			<b>5 070 200,00</b>	<b>0,76</b>
<b>LUXEMBURGO</b>				
AROUNDTOWN SA	EUR	1 700 000	2 232 100,00	0,33
<b>TOTAL DE LUXEMBURGO</b>			<b>2 232 100,00</b>	<b>0,33</b>
<b>PAÍSES BAJOS</b>				
PROSUS NV	EUR	32 000	2 302 080,00	0,34
<b>TOTAL DE PAÍSES BAJOS</b>			<b>2 302 080,00</b>	<b>0,34</b>
<b>TOTAL Acciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar</b>			<b>14 001 285,00</b>	<b>2,08</b>
<b>TOTAL Acciones y valores similares</b>			<b>14 001 285,00</b>	<b>2,08</b>
<b>Instituciones de inversión colectiva</b>				
<b>OICVM y FIA con vocación general destinados a no profesionales y equivalentes de otros países</b>				
<b>FRANCIA</b>				
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
<b>TOTAL DE FRANCIA</b>			<b>13 062 180,00</b>	<b>1,94</b>
<b>LUXEMBURGO</b>				
CANDRIAM MONEY MARKET EURO Z EUR ACC	EUR	38 000	38 709 840,00	5,75
<b>TOTAL DE LUXEMBURGO</b>			<b>38 709 840,00</b>	<b>5,75</b>
<b>TOTAL OICVM y FIA con vocación general destinados a no profesionales y equivalentes de otros países</b>			<b>51 772 020,00</b>	<b>7,69</b>
<b>TOTAL Instituciones de inversión colectiva</b>			<b>51 772 020,00</b>	<b>7,69</b>
<b>Títulos recibidos en el marco de un pacto de recompra inversa</b>				
<b>ALEMANIA</b>				
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
<b>TOTAL DE ALEMANIA</b>			<b>80 011 530,00</b>	<b>11,90</b>
<b>BÉLGICA</b>				
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
<b>TOTAL DE BÉLGICA</b>			<b>142 727 516,36</b>	<b>21,21</b>
<b>FRANCIA</b>				
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 3.5% 25-04-26	EUR	28 347 621	30 000 287,30	4,46

**CARTERA DE VALORES DETALLADA A 31/03/2023 EN EUR (continuación)**

Designación de los valores	Divisa	Número o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
OAT 2.75% 25/10/2027	EUR	40 000 000	40 000 000,00	5,94
<b>TOTAL DE FRANCIA</b>			<b>70 000 287,30</b>	<b>10,40</b>
<b>ITALIA</b>				
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
<b>TOTAL DE ITALIA</b>			<b>56 104 367,60</b>	<b>8,34</b>
<b>LUXEMBURGO</b>				
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
<b>TOTAL DE LUXEMBURGO</b>			<b>200 312 319,32</b>	<b>29,77</b>
<b>TOTAL Títulos recibidos en el marco de un pacto de recompra inversa</b>			<b>549 156 020,58</b>	<b>81,62</b>
<b>Indemnizaciones sobre títulos recibidos en el marco de un pacto de recompra inversa</b>			<b>1 000 402,56</b>	<b>0,15</b>
<b>Instrumentos financieros a plazo</b>				
<b>Compromisos a plazo firme</b>				
<b>Compromisos a plazo firme en un mercado regulado o similar</b>				
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
<b>TOTAL Compromisos a plazo firme en un mercado regulado o similar</b>			<b>-631 656,46</b>	<b>-0,09</b>
<b>TOTAL Compromisos a plazo firme</b>			<b>-631 656,46</b>	<b>-0,09</b>
<b>Otros instrumentos financieros a plazo</b>				
<b>CFD</b>				
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

**CARTERA DE VALORES DETALLADA A 31/03/2023 EN EUR (continuación)**

Designación de los valores	Divisa	Número o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
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
<b>TOTAL CFD</b>			<b>-853 092,32</b>	<b>-0,13</b>
<b>TOTAL Otros instrumentos financieros a plazo</b>			<b>-853 092,32</b>	<b>-0,13</b>
<b>TOTAL Instrumentos financieros a plazo</b>			<b>-1 484 748,78</b>	<b>-0,22</b>
<b>Solicitudes de margen</b>				
SOLICITUD DE MARGEN CACEIS	CHF	226 146,66	227 855,58	0,03
SOLICITUD DE MARGEN CACEIS	USD	-407 645,39	-375 208,61	-0,05
SOLICITUD DE MARGEN CACEIS	EUR	760 423,24	760 423,24	0,11
SOLICITUD DE MARGEN CACEIS	GBP	16 331,76	18 586,28	0,00
<b>TOTAL Solicitudes de margen</b>			<b>631 656,49</b>	<b>0,09</b>
<b>Créditos</b>			<b>67 436 635,82</b>	<b>10,02</b>
<b>Deudas</b>			<b>-57 273 135,93</b>	<b>-8,51</b>
<b>Cuentas financieras</b>			<b>47 632 663,69</b>	<b>7,08</b>
<b>Patrimonio neto</b>			<b>672 872 799,43</b>	<b>100,00</b>



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