

FIC de derecho francés

FOLLETO SEMESTRAL

CANDRIAM INDEX ARBITRAGE

a 30 de junio de 2026

Sociedad Gestora: CANDRIAM

Depositario: CACEIS Bank

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	5 922 157,49
b) Activos bancarios	7 090 569,95
c) Otros activos mantenidos por la IIC	153 727 987,16
d) Total de activos mantenidos por la IIC (líneas a+b+c)	166 740 714,60
e) Pasivo	-8 507 160,43
f) Valor liquidativo (líneas d+e = patrimonio neto de la IIC)	158 233 554,17

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

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.	3,74	3,55
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 4.º apartado del inciso I del artículo R. 214-11 del Código Monetario y Financiero.	0,00	0,00
E) Otros activos.	5,78	5,48

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

(*) 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	0,86	0,82
BÉLGICA	0,79	0,75
ITALIA	0,61	0,58
ALEMANIA	0,61	0,58
IRLANDA	0,51	0,48
AUSTRIA	0,21	0,20
LUXEMBURGO	0,15	0,14
TOTAL	3,74	3,55

(*) 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	1,85	1,75
Otras IIC y fondos de inversión	0,00	0,00
FIA y equivalentes de otros Estados miembros de la Unión Europea	3,93	3,73
Otros	0,00	0,00
TOTAL	5,78	5,48

(*) 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.	22 445 608,54	19 555 276,75
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.	2 627 835,61	2 723 635,93
D) Títulos financieros admisibles de emisión reciente mencionados en el 4.º apartado del inciso I del artículo R. 214-11 del Código Monetario y Financiero.	0,00	0,00
E) Otros activos.	14 443 208,93	14 979 377,02

INFORMACIÓN SOBRE LOS GASTOS DE GESTIÓN VARIABLES

	30/06/2026
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE CLASSIQUE EUR	
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	33,79
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,00
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE I	
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	5,15
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,00
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación ZB	
Gastos de gestión variables objeto de provisión	-27 566,19
Porcentaje de gastos de gestión variables objeto de provisión	-0,06
Gastos de gestión variables cobrados	533,28
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,00
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE R	
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	151,07
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,00
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE RS	
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
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE U	
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	20,53
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,00
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE V	
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	55,88
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,00
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Z	
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

«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».

INVENTARIO DE ACTIVOS Y PASIVOS

Inventario de elementos del balance

Designación de los valores por sector de actividad(*)	Divisa	Cantidad o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
ACCIONES Y VALORES SIMILARES			5 922 157,49	3,74
Acciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar			5 922 157,49	3,74
Bancos comerciales			208 860,30	0,13
COMMERZBANK AG	EUR	5 610	208 860,30	0,13
Bebidas			1 257 018,00	0,78
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	EUR	17 300	1 257 018,00	0,78
Compañías aéreas			801 355,00	0,51
RYANAIR HOLDINGS PLC	EUR	29 300	801 355,00	0,51
Entretenimiento			675 332,19	0,43
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	EUR	36 843	675 332,19	0,43
Equipamiento y servicios para energía			237 258,00	0,15
TENARIS SA	EUR	9 800	237 258,00	0,15
Equipos eléctricos			415 800,00	0,26
NORDEX SE	EUR	9 000	415 800,00	0,26
Equipos e instrumentos electrónicos			408 330,00	0,26
TECHNOPROBE SPA	EUR	11 700	408 330,00	0,26
Metales y minerales			671 000,00	0,42
AURUBIS AG	EUR	1 900	344 280,00	0,21
VOESTALPINE AG	EUR	8 000	326 720,00	0,21
Petróleo y gas			230 944,00	0,15
ENI SPA	EUR	11 200	230 944,00	0,15
Semiconductores y equipos para fabricación			688 560,00	0,44
ASML HOLDING NV	EUR	400	688 560,00	0,44
Servicios públicos			327 700,00	0,21
A2A SPA	EUR	145 000	327 700,00	0,21
TÍTULOS DE IIC			9 141 551,28	5,78
OICVM			2 921 280,00	1,85
Gestión colectiva			2 921 280,00	1,85
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z EUR ACC	EUR	2 000	2 921 280,00	1,85
FIA y equivalentes de otros Estados miembros de la Unión Europea			6 220 271,28	3,93
Gestión colectiva			6 220 271,28	3,93
CANDRIAM EQUITIES L RAO ZB EUR C	EUR	411	6 220 271,28	3,93
TÍTULOS FINANCIEROS RECIBIDOS EN EL MARCO DE UN PACTO DE RECOMPRA INVERSA			124 497 955,00	78,68
Obligaciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar			124 497 955,00	78,68
Bancos comerciales			29 133 975,00	18,41
EFSF 0.75% 03-05-27	EUR	15 170 000	15 000 000,00	9,48
INTL BK FOR RECONS AND DEVELOP 0.7% 22-10-46	EUR	24 875 000	14 133 975,00	8,93
Servicios públicos			95 363 980,00	60,27
BANQUE EUROPEAN D INVESTISSEMENT BEI ZCP 05-11-26	EUR	10 000 000	9 875 000,00	6,24

Inventario de elementos del balance

Designación de los valores por sector de actividad(*)	Divisa	Cantidad o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.0% 22-06-31	EUR	15 800 000	14 503 580,00	9,17
EUROPEAN FINL STABILITY FACIL 1.7% 13-02-43	EUR	15 939 000	12 000 000,00	7,58
EUROPEAN STABILITY MECHANISM 2.75% 15-09-34	EUR	20 000 000	19 716 000,00	12,47
EUROPEAN UNION 0.0% 04-07-29	EUR	13 410 000	12 269 400,00	7,75
EUROPEAN UNION 3.25% 04-07-34	EUR	11 680 000	12 000 000,00	7,58
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 2.5% 24-09-27	EUR	14 826 000	15 000 000,00	9,48
INDEMNIZACIONES SOBRE TÍTULOS RECIBIDOS EN EL MARCO DE UN PACTO DE RECOMPRA INVERSA			435 735,66	0,28
Total			139 997 399,43	88,48

(*) El sector de actividad representa la actividad principal del emisor del instrumento financiero; se obtiene de fuentes fiables reconocidas a nivel internacional (principalmente GICS y NACE).

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

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

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

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

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

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

(*) 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)	139 997 399,43
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	-835 157,12
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	24 160,14
Inventario de los instrumentos financieros a plazo utilizados como cobertura de participaciones emitidas	0,00
Otros activos(+)	24 281 359,60
Otros pasivos(-)	-5 234 207,88
Pasivos de financiación(-)	0,00
Total = patrimonio neto	158 233 554,17

Denominación de la participación	Divisa de la participación	Número de participaciones	Valor liquidativo
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE CLASSIQUE EUR	EUR	40 234,216	1 545,98
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE I	EUR	2 336,237	1 708,74
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación ZB	EUR	4 775,080	10 072,23
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE R	EUR	27 113,894	114,20
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE RS	EUR	0,100	1 168,50
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE U	EUR	89 021,565	172,82
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE V	EUR	21 596,029	1 170,94
Participación CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Z	EUR	100,000	1 750,96

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 pignorados para cada tipo de operación de financiación de valores y TRS expresados en valor absoluto

Importe				124 497 955,00	
% del patrimonio neto				78,68%	

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

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

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

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

5. Tipo y calidad de las garantías

Tipo					
- Acciones					
- Obligaciones				126 160 141,78	
- IIC					
- Títulos de deuda negociables					
- Efectivo				AAA à A	

Moneda de la garantía					
Euro				126 160 141,78	

6. Pago y compensación de contratos

Tripartitos				X	
Contraparte central					
Bilaterales	X			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					
De 1 a 3 meses					
De 3 meses a 1 año				24 886 365,26	
Más de 1 año				101 273 776,52	
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				80 772 980,00	
De 1 a 3 meses				43 724 975,00	
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				126 160 141,78	
Efectivo					

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

Títulos					
Efectivo				1 059 536,00	

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				1 286 474,04	
- 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.