



Ungeprüfter Halbjahresbericht
Candriam L

30. Juni 2024

01.01.2024 - 30.06.2024
SICAV luxemburgischen Rechts
R.C.S. Luxemburg Nr. B-182856



Candriam L

SICAV luxemburgischen Rechts

Ungeprüfter Halbjahresbericht für die Periode
vom 1. Januar 2024 bis zum 30. Juni 2024



Inhalt

Verwaltung der SICAV	4
Angaben zur SICAV	5
Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2024	6
Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für die Periode zum 30. Juni 2024	9
Statistiken	12
Anlageportfolio zum 30. Juni 2024	14
Candriam L Balanced Asset Allocation	14
Candriam L Conservative Asset Allocation	17
Candriam L Dynamic Asset Allocation	20
Candriam L Multi-Asset Income	23
Candriam L Multi-Asset Income & Growth	29
Candriam L Multi-Asset Premia	35
Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente	38
Sonstige Erläuterungen zum Abschluss	51
Zusätzliche ungeprüfte Angaben	60



Verwaltung der SICAV

Verwaltungsrat

Vorsitz

Tanguy DE VILLENFAGNE
Advisor to the Group Strategic Committee
Candriam

Mitglieder

Thierry BLONDEAU
Independent Director

Catherine DELANGHE
Independent Director

Nadège DUFOSSE
Head of Asset Allocation
Candriam

Renato GUERRIERO
Global Head of European Client Relations and Member of the Group
Strategic Committee
Candriam

Aurore PELLE
Senior Internal Auditor
Candriam

Gesellschaftssitz

5, Allée Scheffer
L-2520 Luxemburg

Depotbank und Hauptzahlstelle

CACEIS Bank, Luxembourg Branch
5, Allée Scheffer
L-2520 Luxemburg

Verwaltungsgesellschaft

Candriam
SERENITY - Bloc B
19-21, Route d'Arlon
L-8009 Strassen

Die Funktionen der **Verwaltungsstelle**, **der Domizilstelle** und **der Transferstelle** (einschließlich der **Registerführungstätigkeit**) wurden übertragen auf:

CACEIS Bank, Luxembourg Branch
5, Allée Scheffer
L-2520 Luxemburg

Die Durchführung der **Portfoliomanagementaktivitäten** erfolgt direkt durch Candriam direkt und/oder eine oder mehrere Candriam-Niederlassungen:

Candriam – Succursale française
40, Rue Washington
F-75408 Paris Cedex 08

Candriam – Belgian Branch
58, Avenue des Arts
B-1000 Brüssel

Candriam – UK Establishment
Aldersgate Street 200,
London EC1A 4 HD

Die Umsetzung der **Wertpapierleihgeschäfte** erfolgt direkt durch Candriam und/oder eine oder mehrere der Candriam-Niederlassungen und ist zum Teil delegiert an:

CACEIS Bank, Luxembourg Branch
5, Allée Scheffer
L-2520 Luxemburg

„Réviseur d'entreprises agréé“

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
2, Rue Gerhard Mercator
L-2182 Luxemburg

Finanzdienste

in Belgien:
Belfius Banque S.A.
11, Place Rogier
B-1210 Brüssel



Angaben zur SICAV

Candriam L (nachstehend die „SICAV“) ist eine offene Investmentgesellschaft nach luxemburgischem Recht. Sie wurde am 17. Dezember 2013 in Luxemburg gemäß der Gesetzgebung des Großherzogtums Luxemburg auf unbegrenzte Zeit gegründet. Die SICAV unterliegt den Bestimmungen des Gesetzes vom 10. August 1915 über Handelsgesellschaften (nachstehend das „Gesetz vom 10. August 1915“), sofern es nicht durch das Gesetz in seiner geänderten Fassung davon befreit ist. Ihr Mindestkapital beträgt 1.250.000 EUR.

Die Satzung wurde beim luxemburgischen Handels- und Gesellschaftsregister hinterlegt und im „Mémorial C, Recueil des Sociétés et Associations“ veröffentlicht. Sie wurde zuletzt am 5. Oktober 2020 geändert und die entsprechenden Änderungen wurden im „Recueil Électronique des Sociétés et Associations“ (RESA) veröffentlicht.

Die SICAV ist im Handels- und Gesellschaftsregister Luxemburg unter der Nummer B-182856 eingetragen.

Die SICAV veröffentlicht einen ausführlichen Jahresbericht über ihre Aktivitäten und das verwaltete Vermögen. Der Bericht enthält eine konsolidierte Aufstellung des Nettovermögens sowie eine konsolidierte Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens in EUR, das Anlageportfolio jedes Teilfonds und den Prüfungsbericht. Dieser Bericht ist am eingetragenen Sitz der SICAV und am Sitz der Banken erhältlich, die in den Ländern, in denen die SICAV-Anteile vertrieben werden, Finanzdienstleistungen erbringen.

Darüber hinaus veröffentlicht diese nach Ablauf eines jeden Halbjahres einen Bericht, der insbesondere die Aufstellung des Nettovermögens, die Entwicklung des Nettovermögens für den Berichtszeitraum, die Entwicklung der Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile für den Berichtszeitraum, die Zusammensetzung des Portfolios, die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile und den Nettoinventarwert je Anteil umfasst.

Die Jahreshauptversammlung der Anteilhaber der SICAV findet jedes Jahr am Sitz der SICAV oder an einem anderen in der Einberufung angegebenen Ort in Luxemburg statt. Sie findet innerhalb von 6 Monaten nach Ende des Geschäftsjahres statt.

Die Einladungen zu allen Hauptversammlungen werden allen eingetragenen Anteilhabern mindestens acht Tage vor der Hauptversammlung an die im Register der Anteilhaber angegebene Adresse zugesandt. Diese Einberufungsschreiben enthalten den Ort und die Uhrzeit der Hauptversammlung der Anteilhaber sowie die Teilnahmebedingungen, die Tagesordnung und die Erfordernisse des luxemburgischen Rechts in Bezug auf Beschlussfähigkeit und notwendige Mehrheiten.

Die Bekanntmachungen werden auch in der Presse der Länder veröffentlicht, in denen die SICAV-Anteile vertrieben werden, sofern die Gesetzgebung dieser Länder dies erfordert. Die Anforderungen an die Teilnahme, die Beschlussfähigkeit und die Mehrheit in jeder Generalversammlung sind in der Satzung der SICAV festgelegt.

Wenn es die lokale Gesetzgebung vorschreibt, werden die Bekanntmachungen auch in Luxemburg und in den Ländern, in denen die Anteile der SICAV zum öffentlichen Vertrieb zugelassen sind, in einer vom Verwaltungsrat ausgewählten Zeitung veröffentlicht.

Das Geschäftsjahr beginnt am 1. Januar und endet am 31. Dezember eines jeden Jahres.

Eine detaillierte Aufstellung der Portfolibewegungen ist auf Anfrage kostenlos am Sitz der SICAV erhältlich.

Der Verkaufsprospekt, die Basisinformationsblätter für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte (PRIIP BiB), die Satzung der SICAV und die Finanzberichte werden am Sitz der SICAV zur kostenlosen öffentlichen Einsichtnahme bereitgehalten.



Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2024

		Candriam L Balanced Asset Allocation	Candriam L Conservative Asset Allocation	Candriam L Dynamic Asset Allocation
		EUR	EUR	EUR
Aktiva				
Anlageportfolio zum Marktwert	2a	159,631,310	185,318,199	12,743,109
Optionen zum Marktwert (Long-Position)	2e	355,939	444,924	33,370
Guthaben bei Banken und Brokern	9	2,309,478	2,734,812	474,121
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		179,511	339,702	62,511
Forderungen aus Zeichnungen		35	0	116
Forderungen aus CFD		0	0	0
Dividendenforderungen aus CFD	2g	0	0	0
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		0	336	0
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	2f,g	0	0	2,142
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	2e	107,736	184,373	2,027
Nicht realisierter Gewinn aus Swaps	2h,i,j	0	0	0
Sonstige Vermögenswerte		0	0	0
Aktiva insgesamt		162,584,009	189,022,346	13,317,396
Passiva				
Optionen zum Marktwert (Short-Position)	2e	320,109	400,137	30,010
Kontokorrentkredite		0	0	0
Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen		159,477	375,807	57,623
Verbindlichkeiten aus CFD		0	0	0
Dividendenverbindlichkeiten aus CFD		0	0	0
Nicht realisierte Nettoabschreibungen auf Devisentermingeschäfte	2f,g	65,178	71,767	0
Nicht realisierter Verlust aus CFD	2g	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	3	54,056	58,435	6,715
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		10	0	14
Verbindlichkeiten aus Betriebs- und Verwaltungskosten	4	3,199	3,543	491
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	5	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Zeichnungssteuer	6	680	648	151
Sonstige Verbindlichkeiten		0	0	0
Passiva insgesamt		602,709	910,337	95,004
Nettovermögen insgesamt		161,981,300	188,112,009	13,222,392



Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2024

		Candriam L Multi-Asset Income	Candriam L Multi-Asset Income & Growth	Candriam L Multi-Asset Premia
		EUR	EUR	EUR
Aktiva				
Anlageportfolio zum Marktwert	2a	363,382,171	121,710,847	33,706,800
Optionen zum Marktwert (Long-Position)	2e	636,768	272,443	0
Guthaben bei Banken und Brokern	9	12,475,774	2,859,834	9,950,116
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		0	0	0
Forderungen aus Zeichnungen		523,529	0	0
Forderungen aus CFD		0	0	3,062,754
Dividendenforderungen aus CFD	2g	0	0	316,400
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		3,391,583	821,087	151,685
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	2f,g	0	0	0
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	2e	745,671	365,398	1,957,600
Nicht realisierter Gewinn aus Swaps	2h,i,j	0	0	236,673
Sonstige Vermögenswerte		51,178	6,326	0
Aktiva insgesamt		381,206,674	126,035,935	49,382,028
Passiva				
Optionen zum Marktwert (Short-Position)	2e	153,446	58,697	0
Kontokorrentkredite		0	0	4,184,181
Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen		1,399,873	679,246	0
Verbindlichkeiten aus CFD		0	0	2,313,022
Dividendenverbindlichkeiten aus CFD		0	0	372,385
Nicht realisierte Nettoabschreibungen auf Devisentermingeschäfte	2f,g	228,593	121,643	0
Nicht realisierter Verlust aus CFD	2g	0	0	215,157
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	3	30,230	36,448	2,763
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		0	0	0
Verbindlichkeiten aus Betriebs- und Verwaltungskosten	4	37,171	12,470	8,124
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	5	0	0	187,810
Verbindlichkeiten aus Zeichnungssteuer	6	18,324	5,961	951
Sonstige Verbindlichkeiten		19	4	0
Passiva insgesamt		1,867,656	914,469	7,284,393
Nettovermögen insgesamt		379,339,018	125,121,466	42,097,635



Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2024

		Kombiniert
		EUR
Aktiva		
Anlageportfolio zum Marktwert	2a	876,492,436
Optionen zum Marktwert (Long-Position)	2e	1,743,444
Guthaben bei Banken und Brokern	9	30,804,135
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		581,724
Forderungen aus Zeichnungen		523,680
Forderungen aus CFD		3,062,754
Dividendenforderungen aus CFD	2g	316,400
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		4,364,691
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	2f,g	2,142
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	2e	3,362,805
Nicht realisierter Gewinn aus Swaps	2h,i,j	236,673
Sonstige Vermögenswerte		57,504
Aktiva insgesamt		921,548,388
Passiva		
Optionen zum Marktwert (Short-Position)	2e	962,399
Kontokorrentkredite		4,184,181
Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen		2,672,026
Verbindlichkeiten aus CFD		2,313,022
Dividendenverbindlichkeiten aus CFD		372,385
Nicht realisierte Nettoabschreibungen auf Devisentermingeschäfte	2f,g	487,181
Nicht realisierter Verlust aus CFD	2g	215,157
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	3	188,647
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		24
Verbindlichkeiten aus Betriebs- und Verwaltungskosten	4	64,998
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	5	187,810
Verbindlichkeiten aus Zeichnungssteuer	6	26,715
Sonstige Verbindlichkeiten		23
Passiva insgesamt		11,674,568
Nettovermögen insgesamt		909,873,820



Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für die Periode zum 30. Juni 2024

		Candriam L Balanced Asset Allocation	Candriam L Conservative Asset Allocation	Candriam L Dynamic Asset Allocation
		EUR	EUR	EUR
Nettovermögen zu Beginn der Periode		149,029,241	197,488,251	13,010,459
Erträge				
Dividenden, netto	2l	59,658	104,651	3,205
Zinsen auf Anleihen und Geldmarktinstrumente, netto		0	0	0
Erhaltene Zinsen aus CFD		0	0	0
Zinserträge aus Swaps		0	0	0
Bankzinsen		48,839	60,496	5,737
Sonstige Erträge		221	57	0
Erträge insgesamt		108,718	165,204	8,942
Aufwendungen				
Verwaltungsgebühren	3	332,643	374,748	43,125
Performancegebühren	5	0	0	0
Betriebs- und Verwaltungskosten	4	16,313	18,591	2,924
Depotbankgebühren	4	3,404	4,129	286
Zeichnungssteuer	6	2,861	2,056	612
Transaktionskosten	2k	21,966	27,229	1,836
Gezahlte Zinsen auf CFD		0	0	0
Bankzinsen		241	1,483	121
Gezahlte Dividenden aus CFD		0	0	0
Aufwendungen insgesamt		377,428	428,236	48,904
Nettoertrag/(-verlust) aus Wertpapieren		(268,710)	(263,032)	(39,962)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Wertpapieren	2b	2,133,517	3,019,216	359,405
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Optionen	2e	(78,125)	(77,375)	(6,567)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften	2f	(262,227)	(312,311)	(12,633)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures	2e	1,247,745	913,283	174,694
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus CFD	2g	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen		310,815	431,575	14,366
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)		3,083,015	3,711,356	489,303
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren	2a	6,291,597	3,457,688	626,399
Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Optionen	2e	(133,365)	(165,772)	(12,557)
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften	2f	(258,037)	(321,932)	(3,945)
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Futures	2e	(596,315)	(1,042,734)	(65,276)
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus CFD	2g	0	0	0
Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Swaps	2h,i,j	0	0	0
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		8,386,895	5,638,606	1,033,924
Entwicklung des Kapitals				
Zeichnung von Anteilen		5,121,546	552,089	125,234
Rücknahme von Anteilen		(547,007)	(15,268,516)	(947,225)
Ausgeschüttete Dividenden	8	(9,375)	(298,421)	0
Nettovermögen zum Ende der Periode		161,981,300	188,112,009	13,222,392



Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für die Periode zum 30. Juni 2024

		Candriam L Multi-Asset Income	Candriam L Multi-Asset Income & Growth	Candriam L Multi-Asset Premia
		EUR	EUR	EUR
Nettovermögen zu Beginn der Periode		346,135,149	130,201,755	46,495,465
Erträge				
Dividenden, netto	2l	289,900	252,636	4,269
Zinsen auf Anleihen und Geldmarktinstrumente, netto		4,078,724	1,066,707	350,512
Erhaltene Zinsen aus CFD		0	0	379,679
Zinserträge aus Swaps		0	0	74,822
Bankzinsen		322,258	98,361	279,969
Sonstige Erträge		19	132	25
Erträge insgesamt		4,690,901	1,417,836	1,089,276
Aufwendungen				
Verwaltungsgebühren	3	195,708	235,032	20,587
Performancegebühren	5	0	0	204,746
Betriebs- und Verwaltungskosten	4	222,946	78,815	53,600
Depotbankgebühren	4	8,033	2,822	1,000
Zeichnungssteuer	6	35,403	12,292	1,962
Transaktionskosten	2k	47,641	35,856	38,780
Gezahlte Zinsen auf CFD		0	0	612,849
Bankzinsen		3,612	177	144,834
Gezahlte Dividenden aus CFD		0	0	177,746
Aufwendungen insgesamt		513,343	364,994	1,256,104
Nettoertrag/(-verlust) aus Wertpapieren		4,177,558	1,052,842	(166,828)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Wertpapieren	2b	2,716,638	2,034,271	657,122
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Optionen	2e	(1,545,818)	(602,454)	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften	2f	(968,378)	(661,305)	1,329
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures	2e	1,508,479	1,513,392	(44,279)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus CFD	2g	0	0	1,255,255
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen		(294,819)	19,933	135,737
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)		5,593,660	3,356,679	1,838,336
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren	2a	2,649,906	2,618,886	(239,816)
Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Optionen	2e	1,090	19,978	0
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften	2f	(708,102)	(238,061)	0
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Futures	2e	(1,045,679)	(744,768)	341,988
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus CFD	2g	0	0	(195,723)
Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Swaps	2h,i,j	0	0	(58,505)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		6,490,875	5,012,714	1,686,280
Entwicklung des Kapitals				
Zeichnung von Anteilen		45,390,321	4,294,062	7,290,087
Rücknahme von Anteilen		(16,919,395)	(13,896,178)	(13,374,197)
Ausgeschüttete Dividenden	8	(1,757,932)	(490,887)	0
Nettovermögen zum Ende der Periode		379,339,018	125,121,466	42,097,635



Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für die Periode zum 30. Juni 2024

		Kombiniert
		EUR
Nettovermögen zu Beginn der Periode		882,360,320
Erträge		
Dividenden, netto	2l	714,319
Zinsen auf Anleihen und Geldmarktinstrumente, netto		5,495,943
Erhaltene Zinsen aus CFD		379,679
Zinserträge aus Swaps		74,822
Bankzinsen		815,660
Sonstige Erträge		454
Erträge insgesamt		7,480,877
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	3	1,201,843
Performancegebühren	5	204,746
Betriebs- und Verwaltungskosten	4	393,189
Depotbankgebühren	4	19,674
Zeichnungssteuer	6	55,186
Transaktionskosten	2k	173,308
Gezahlte Zinsen auf CFD		612,849
Bankzinsen		150,468
Gezahlte Dividenden aus CFD		177,746
Aufwendungen insgesamt		2,989,009
Nettoertrag/(-verlust) aus Wertpapieren		4,491,868
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Wertpapieren	2b	10,920,169
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Optionen	2e	(2,310,339)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften	2f	(2,215,525)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures	2e	5,313,314
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus CFD	2g	1,255,255
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen		617,607
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)		18,072,349
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren	2a	15,404,660
Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Optionen	2e	(290,626)
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften	2f	(1,530,077)
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Futures	2e	(3,152,784)
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus CFD	2g	(195,723)
Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Swaps	2h,i,j	(58,505)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		28,249,294
Entwicklung des Kapitals		
Zeichnung von Anteilen		62,773,339
Rücknahme von Anteilen		(60,952,518)
Ausgeschüttete Dividenden	8	(2,556,615)
Nettovermögen zum Ende der Periode		909,873,820



Statistiken

Candriam L Balanced Asset Allocation

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2024	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2023	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022
Nettovermögen insgesamt			EUR		161,981,300	149,029,241	154,798,931
C	LU0982874694	Thesaurierung	EUR	15,433.08	179.38	170.74	158.41
C	LU0982874777	Ausschüttung	EUR	455.00	184.74	180.94	169.90
I	LU0982874850	Thesaurierung	EUR	62,303.19	2,394.97	2,269.28	2,086.29
I	LU1207304871	Ausschüttung	EUR	59.78	1,768.10	1,722.85	1,602.56
R2	LU1427870321	Thesaurierung	EUR	7.00	196.73	186.28	171.05
R2	LU1427870594	Ausschüttung	EUR	831.02	177.44	172.87	160.73
V	LU0982874934	Thesaurierung	EUR	1.00	1,978.27	1,873.34	1,718.44
Z	LU0982875071	Thesaurierung	EUR	4,954.00	1,949.58	1,843.17	1,686.93

Candriam L Conservative Asset Allocation

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2024	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2023	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022
Nettovermögen insgesamt			EUR		188,112,009	197,488,251	196,285,898
C	LU0982875154	Thesaurierung	EUR	7,951.41	171.59	167.13	156.27
I	LU0982875311	Thesaurierung	EUR	85,623.61	2,067.22	2,004.97	1,857.72
I	LU1207304798	Ausschüttung	EUR	5,864.10	1,654.47	1,654.56	1,544.00
R2	LU1427870164	Thesaurierung	EUR	7.00	175.95	170.59	157.99
R2	LU1427870248	Ausschüttung	EUR	239.27	159.89	159.88	149.16
V	LU0982875402	Thesaurierung	EUR	1.00	1,775.66	1,720.57	1,591.13
Z	LU0982875584	Thesaurierung	EUR	1.00	1,804.60	1,746.63	1,611.54

Candriam L Dynamic Asset Allocation

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2024	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2023	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022
Nettovermögen insgesamt			EUR		13,222,392	13,010,459	11,843,730
C	LU0982876806	Thesaurierung	EUR	10,552.98	258.01	239.07	219.33
C	LU0982876988	Ausschüttung	EUR	-	-	202.91	189.68
I	LU0982877101	Thesaurierung	EUR	3,672.99	2,857.07	2,635.11	2,395.02
R	LU1427870677	Thesaurierung	EUR	10.00	171.16	158.03	-
V	LU0982877283	Thesaurierung	EUR	1.00	1,721.46	1,586.73	-
Z	LU0982877366	Thesaurierung	EUR	1.00	2,218.06	2,040.52	1,844.99

Candriam L Multi-Asset Income

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2024	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2023	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022
Nettovermögen insgesamt			EUR		379,339,018	346,135,149	353,788,946
C	LU0982876392	Thesaurierung	EUR	23,895.67	153.69	151.76	142.42
C	LU0982876475	Ausschüttung	EUR	15,114.86	143.80	143.40	136.14
C (q)	LU1236612575	Ausschüttung	EUR	72.66	145.79	144.68	137.11
I	LU0982876558	Thesaurierung	EUR	9,060.50	1,797.56	1,768.03	1,652.82
R	LU1427871139	Thesaurierung	EUR	10.00	160.86	158.38	-
R2	LU1427871303	Thesaurierung	EUR	1,089.60	164.93	162.20	150.95
R2	LU1427871485	Ausschüttung	EUR	538,076.31	152.09	150.98	142.03
V	LU0982876632	Thesaurierung	EUR	1.00	1,615.83	1,585.09	-
V (q)	LU1207305092	Ausschüttung	EUR	10,001.00	1,504.14	1,485.95	1,401.74
Z	LU0982876715	Thesaurierung	EUR	37,525.52	1,697.28	1,666.14	1,544.95
Z (q)	LU1207305175	Ausschüttung	EUR	124,851.14	1,573.40	1,552.24	1,453.71

Candriam L Multi-Asset Income & Growth

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2024	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2023	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022
Nettovermögen insgesamt			EUR		125,121,466	130,201,755	126,237,933
C	LU1207305258	Thesaurierung	EUR	180,698.46	178.37	172.42	161.54



Statistiken

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2024	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2023	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022
C	LU1236612658	Ausschüttung	EUR	1,130.48	137.07	135.73	130.97
C (q)	LU1207305332	Ausschüttung	EUR	595.57	145.88	142.78	137.15
I	LU1207305415	Thesaurierung	EUR	1,198.60	1,908.12	1,836.73	1,706.62
I (q)	LU1207305506	Ausschüttung	EUR	1.00	1,482.87	1,444.72	1,375.05
R	LU1427871725	Thesaurierung	EUR	10.00	162.46	156.61	–

Candriam L Multi-Asset Income & Growth (Fortsetzung)

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2024	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2023	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022
R2	LU1427872293	Ausschüttung	EUR	1,073.84	154.36	152.07	145.18
V	LU1207305688	Thesaurierung	EUR	10,667.50	1,824.41	1,754.43	1,627.75
Z	LU1207305845	Thesaurierung	EUR	18,443.33	1,942.94	1,865.69	1,724.89
Z (q)	LU1207305928	Ausschüttung	EUR	22,349.41	1,561.42	1,518.08	1,438.78

Candriam L Multi-Asset Premia

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2024	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2023	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022
Nettovermögen insgesamt			EUR		42,097,635	46,495,465	44,661,101
C	LU1797471627	Thesaurierung	EUR	7.00	168.40	163.84	154.58
I	LU1797471890	Thesaurierung	EUR	6.00	1,751.32	1,698.03	1,590.19
PI	LU1797472195	Thesaurierung	EUR	5,000.00	1,690.49	1,636.61	1,528.04
R	LU1797472278	Thesaurierung	EUR	7.00	174.72	169.46	158.75
S	LU1797472351	Thesaurierung	EUR	0.33	1,888.88	1,818.09	1,674.42
Z	LU1797472435	Thesaurierung	EUR	18,707.91	1,797.72	1,737.87	1,617.59



Candriam L Balanced Asset Allocation

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Strukturierte Produkte				
Irland				
ISHARES PHYSICAL METALS PLC - GOLD	95,128	USD	4,019,474	2.48
			4,019,474	2.48
Strukturierte Produkte, insgesamt			4,019,474	2.48
Anteile				
Vereinigte Staaten von Amerika				
ALPHABET INC -A-	2,700	USD	458,880	0.28
AMAZON.COM INC	4,765	USD	859,189	0.53
APPLE INC	3,680	USD	723,193	0.45
BROADCOM INC - REGISTERED SHS	93	USD	139,318	0.09
META PLATFORMS INC A	973	USD	457,762	0.28
MICROSOFT CORP	991	USD	413,275	0.26
NVIDIA CORP	5,137	USD	592,139	0.37
			3,643,756	2.25
Aktien gesamt			3,643,756	2.25
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt			7,663,230	4.73
Organismen für gemeinsame Anlagen				
Anteile/Einheiten an Anlagefonds				
Frankreich				
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z C	1,463	EUR	2,229,725	1.38
			2,229,725	1.38
Luxemburg				
CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQUITY MARKET NEUTRAL Z C	737	EUR	1,484,237	0.92
CANDRIAM BONDS CREDIT ALPHA Z C	452	EUR	791,312	0.49
CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z C	1,473	USD	1,558,837	0.96
CANDRIAM BONDS EURO DIVERSIFIED Z C	14,384	EUR	12,610,608	7.79
CANDRIAM BONDS EURO GOVERNMENT Z C	5,081	EUR	12,307,171	7.60
CANDRIAM BONDS EURO SHORT TERM Z C	2,563	EUR	5,802,835	3.58
CANDRIAM BONDS GLOBAL HIGH YIELD Z C	2,521	EUR	770,544	0.48
CANDRIAM EQUITIES L EMERGING MARKETS Z C	6,565	EUR	9,197,969	5.68
CANDRIAM EQUITIES L EUROPE INNOVATION Z C	465	EUR	1,273,540	0.79
CANDRIAM EQUITIES L LIFE CARE Z C	835	USD	1,453,248	0.90
CANDRIAM EQUITIES L RISK ARBITRAGE OPPORTUNITIES Z C	513	EUR	767,987	0.47
CANDRIAM EQUITIES L ROBOTICS & INNOVATIVE TECHNOLOGY Z C	749	USD	3,531,959	2.18
CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME & GROWTH Z C	1,390	EUR	2,700,622	1.67
CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME Z C	2,346	EUR	3,982,630	2.46
CANDRIAM L MULTI-ASSET PREMIA Z C	372	EUR	668,752	0.41
CANDRIAM MONEY MARKET USD SUSTAINABLE Z C	439	USD	502,182	0.31
CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EMERGING MARKETS Z C	1,467	USD	1,581,870	0.98
CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO CORPORATE Z C	18,421	EUR	19,158,682	11.83
CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO Z C	8,654	EUR	8,247,411	5.09
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY CIRCULAR ECONOMY Z C	562	USD	787,581	0.49
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY CLIMATE ACTION Z C	2,013	USD	3,196,767	1.97
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY EMERGING MARKETS Z C	1,347	EUR	3,223,548	1.99
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY QUANT EUROPE Z C	470	EUR	2,475,982	1.53
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY US Z C	4,662	USD	5,536,600	3.42
CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO Z C	3,389	EUR	3,766,514	2.33
CLEOME INDEX EUROPE EQUITIES Z C	6,850	EUR	18,157,670	11.21
CLEOME INDEX USA EQUITIES Z C	3,037	USD	12,384,758	7.65
INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE CORPORATE EURO BOND UCITS ETF D	65,556	EUR	1,513,032	0.93
INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE EUROPE EQUITY UCITS ETF C	183,957	EUR	7,030,837	4.34

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.



Candriam L Balanced Asset Allocation

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE JAPAN EQUITY UCITS ETF C	88,046	EUR	3,272,670	2.02
			149,738,355	92.44
Aktien/Anteile in Anlagefonds gesamt			151,968,080	93.82
Organismen für gemeinsame Anlagen gesamt			151,968,080	93.82
Anlageportfolio gesamt			159,631,310	98.55
Erwerbskosten			146,714,887	



Candriam L Balanced Asset Allocation

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2024

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Luxemburg	92.44
Irland	2.48
Vereinigte Staaten von Amerika	2.25
Frankreich	1.38
	98.55

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Anlagefonds	93.82
Nicht klassifizierbare Institutionen	2.48
Internet und Internet-Dienste	0.82
Büroausstattung und Computer	0.53
Einzelhandel und Warenhäuser	0.53
Elektronik und Halbleiter	0.37
	98.55



Candriam L Conservative Asset Allocation

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Strukturierte Produkte				
Irland				
ISHARES PHYSICAL METALS PLC - GOLD	110,895	USD	4,685,682	2.49
			4,685,682	2.49
Strukturierte Produkte, insgesamt				
			4,685,682	2.49
Anteile				
Vereinigte Staaten von Amerika				
ALPHABET INC -A-	1,854	USD	315,098	0.17
AMAZON.COM INC	3,313	USD	597,376	0.32
APPLE INC	2,558	USD	502,697	0.27
BROADCOM INC - REGISTERED SHS	60	USD	89,883	0.05
META PLATFORMS INC A	684	USD	321,798	0.17
MICROSOFT CORP	690	USD	287,749	0.15
NVIDIA CORP	3,602	USD	415,200	0.22
			2,529,801	1.34
Aktien gesamt				
			2,529,801	1.34
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt				
			7,215,483	3.84
Organismen für gemeinsame Anlagen				
Anteile/Einheiten an Anlagefonds				
Frankreich				
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z C	2,490	EUR	3,794,242	2.02
			3,794,242	2.02
Luxemburg				
CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQUITY MARKET NEUTRAL Z C	1,402	EUR	2,823,981	1.50
CANDRIAM BONDS CREDIT ALPHA Z C	824	EUR	1,441,903	0.77
CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z C	2,903	USD	3,073,191	1.63
CANDRIAM BONDS EURO DIVERSIFIED Z C	25,186	EUR	22,081,550	11.74
CANDRIAM BONDS EURO GOVERNMENT Z C	5,607	EUR	13,582,117	7.22
CANDRIAM BONDS EURO SHORT TERM Z C	4,519	EUR	10,230,302	5.44
CANDRIAM BONDS GLOBAL HIGH YIELD Z C	4,310	EUR	1,317,394	0.70
CANDRIAM EQUITIES L EMERGING MARKETS Z C	4,751	EUR	6,656,559	3.54
CANDRIAM EQUITIES L EUROPE INNOVATION Z C	269	EUR	735,811	0.39
CANDRIAM EQUITIES L LIFE CARE Z C	622	USD	1,082,403	0.58
CANDRIAM EQUITIES L RISK ARBITRAGE OPPORTUNITIES Z C	860	EUR	1,288,077	0.68
CANDRIAM EQUITIES L ROBOTICS & INNOVATIVE TECHNOLOGY Z C	503	USD	2,372,608	1.26
CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME & GROWTH Z C	2,485	EUR	4,828,340	2.57
CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME Z C	4,178	EUR	7,090,993	3.77
CANDRIAM L MULTI-ASSET PREMIA Z C	665	EUR	1,194,693	0.64
CANDRIAM MONEY MARKET USD SUSTAINABLE Z C	439	USD	502,182	0.27
CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EMERGING MARKETS Z C	1,720	USD	1,854,199	0.99
CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO CORPORATE Z C	30,687	EUR	31,915,051	16.97
CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO Z C	15,353	EUR	14,632,042	7.78
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY CIRCULAR ECONOMY Z C	489	USD	685,870	0.36
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY CLIMATE ACTION Z C	2,059	USD	3,270,417	1.74
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY EMERGING MARKETS Z C	860	EUR	2,058,657	1.09
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY QUANT EUROPE Z C	383	EUR	2,019,207	1.07
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY US Z C	3,436	USD	4,080,230	2.17
CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO Z C	3,206	EUR	3,563,035	1.89
CLEOME INDEX EUROPE EQUITIES Z C	4,457	EUR	11,815,623	6.28
CLEOME INDEX USA EQUITIES Z C	2,137	USD	8,713,540	4.63
INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE CORPORATE EURO BOND UCITS ETF D	115,537	EUR	2,666,594	1.42
INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE EUROPE EQUITY UCITS ETF C	116,723	EUR	4,461,153	2.37

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwlige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.



Candriam L Conservative Asset Allocation

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE JAPAN EQUITY UCITS ETF C	61,091	EUR	2,270,752	1.21
			174,308,474	92.66
Aktien/Anteile in Anlagefonds gesamt			178,102,716	94.68
Organismen für gemeinsame Anlagen gesamt			178,102,716	94.68
Anlageportfolio gesamt			185,318,199	98.51
Erwerbskosten			174,791,397	



Candriam L Conservative Asset Allocation

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2024

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Luxemburg	92.66
Irland	2.49
Frankreich	2.02
Vereinigte Staaten von Amerika	1.34
	98.51

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Anlagefonds	94.68
Nicht klassifizierbare Institutionen	2.49
Internet und Internet-Dienste	0.49
Büroausstattung und Computer	0.32
Einzelhandel und Warenhäuser	0.32
Elektronik und Halbleiter	0.22
	98.51



Candriam L Dynamic Asset Allocation

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Strukturierte Produkte				
Irland				
ISHARES PHYSICAL METALS PLC - GOLD	7,789	USD	329,111	2.49
			329,111	2.49
Strukturierte Produkte, insgesamt			329,111	2.49
Anteile				
Vereinigte Staaten von Amerika				
ALPHABET INC -A-	336	USD	57,105	0.43
AMAZON.COM INC	625	USD	112,695	0.85
APPLE INC	435	USD	85,486	0.65
BROADCOM INC - REGISTERED SHS	11	USD	16,479	0.12
META PLATFORMS INC A	114	USD	53,633	0.41
MICROSOFT CORP	117	USD	48,792	0.37
NVIDIA CORP	642	USD	74,003	0.56
			448,193	3.39
Aktien gesamt			448,193	3.39
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt				
			777,304	5.88
Organismen für gemeinsame Anlagen				
Anteile/Einheiten an Anlagefonds				
Frankreich				
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z C	61	EUR	93,429	0.71
			93,429	0.71
Luxemburg				
CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQUITY MARKET NEUTRAL Z C	33	EUR	66,458	0.50
CANDRIAM BONDS CREDIT ALPHA Z C	21	EUR	36,764	0.28
CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z C	62	USD	65,477	0.50
CANDRIAM BONDS EURO DIVERSIFIED Z C	587	EUR	514,510	3.89
CANDRIAM BONDS EURO GOVERNMENT Z C	264	EUR	640,249	4.84
CANDRIAM BONDS EURO SHORT TERM Z C	86	EUR	194,464	1.47
CANDRIAM BONDS GLOBAL HIGH YIELD Z C	111	EUR	33,927	0.26
CANDRIAM EQUITIES L EMERGING MARKETS Z C	701	EUR	981,720	7.42
CANDRIAM EQUITIES L EUROPE INNOVATION Z C	33	EUR	89,227	0.67
CANDRIAM EQUITIES L LIFE CARE Z C	99	USD	172,244	1.30
CANDRIAM EQUITIES L RISK ARBITRAGE OPPORTUNITIES Z C	21	EUR	31,438	0.24
CANDRIAM EQUITIES L ROBOTICS & INNOVATIVE TECHNOLOGY Z C	90	USD	423,424	3.20
CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME & GROWTH Z C	57	EUR	111,704	0.84
CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME Z C	96	EUR	163,404	1.24
CANDRIAM L MULTI-ASSET PREMIA Z C	17	EUR	31,101	0.24
CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EMERGING MARKETS Z C	62	USD	66,464	0.50
CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO CORPORATE Z C	719	EUR	747,662	5.65
CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO Z C	404	EUR	385,032	2.91
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY CIRCULAR ECONOMY Z C	65	USD	90,471	0.68
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY CLIMATE ACTION Z C	178	USD	282,858	2.14
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY EMERGING MARKETS Z C	220	EUR	526,643	3.98
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY QUANT EUROPE Z C	87	EUR	460,247	3.48
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY US Z C	337	USD	399,644	3.02
CLEOME INDEX EUROPE EQUITIES Z C	883	EUR	2,341,190	17.71
CLEOME INDEX USA EQUITIES Z C	269	USD	1,097,475	8.30
INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE CORPORATE EURO BOND UCITS ETF D	3,488	EUR	80,503	0.61
INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE EUROPE EQUITY UCITS ETF C	36,976	EUR	1,413,223	10.69
INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE JAPAN EQUITY UCITS ETF C	11,430	EUR	424,853	3.21
			11,872,376	89.79

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.



Candriam L Dynamic Asset Allocation

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Aktien/Anteile in Anlagefonds gesamt			11,965,805	90.50
Organismen für gemeinsame Anlagen gesamt			11,965,805	90.50
Anlageportfolio gesamt			12,743,109	96.38
Erwerbskosten			11,386,447	



Candriam L Dynamic Asset Allocation

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2024

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Luxemburg	89.79
Vereinigte Staaten von Amerika	3.39
Irland	2.49
Frankreich	0.71
	96.38

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Anlagefonds	90.50
Nicht klassifizierbare Institutionen	2.49
Internet und Internet-Dienste	1.21
Einzelhandel und Warenhäuser	0.85
Büroausstattung und Computer	0.77
Elektronik und Halbleiter	0.56
	96.38



Candriam L Multi-Asset Income

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Strukturierte Produkte				
Irland				
ISHARES PHYSICAL METALS PLC - GOLD	178,778	USD	7,553,965	1.99
ISHS PHY MET (COMDTY SILVER)	69,000	USD	1,799,521	0.47
			9,353,486	2.47
Strukturierte Produkte, insgesamt			9,353,486	2.47
Anteile				
Belgien				
KBC GROUPE SA	3,207	EUR	211,341	0.06
			211,341	0.06
Dänemark				
NOVO NORDISK - BEARER AND/OR - REG SHS	4,616	DKK	622,445	0.16
			622,445	0.16
Finnland				
KONE OYJ -B-	5,845	EUR	269,396	0.07
			269,396	0.07
Frankreich				
AIR LIQUIDE SA	2,670	EUR	430,618	0.11
BUREAU VERITAS SA	13,251	EUR	342,671	0.09
CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	12,454	EUR	449,714	0.12
LEGRAND SA	4,903	EUR	454,214	0.12
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	847	EUR	604,419	0.16
SCHNEIDER ELECTRIC SE	2,222	EUR	498,395	0.13
			2,780,031	0.73
Deutschland				
ALLIANZ SE PREFERENTIAL SHARE	3,852	EUR	999,594	0.26
SAP AG	3,515	EUR	666,163	0.18
SIEMENS HEALTHINEERS	10,971	EUR	590,240	0.16
			2,255,997	0.59
Irland				
LINDE PLC	1,272	USD	520,799	0.14
			520,799	0.14
Japan				
KEYENCE CORP	1,400	JPY	572,906	0.15
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC	33,100	JPY	331,957	0.09
NIDEC CORP	13,400	JPY	558,457	0.15
SMC CORP	400	JPY	177,121	0.05
			1,640,441	0.43
Niederländische Antillen				
SLB	6,220	USD	273,813	0.07
			273,813	0.07
Niederlande				
ASML HOLDING NV	889	EUR	857,174	0.23
STMICROELECTRONICS NV	15,825	EUR	583,389	0.15
			1,440,563	0.38
Schweiz				
DSM FIRMENICH	6,760	EUR	713,856	0.19
NESTLE SA PREFERENTIAL SHARE	5,579	CHF	531,339	0.14
SIKA - REGISTERED SHS	2,254	CHF	601,972	0.16
			1,847,167	0.49
Großbritannien				
ANTOFAGASTA PLC	10,878	GBP	270,715	0.07
ASTRAZENECA PLC	3,921	GBP	571,420	0.15
RELX PLC	8,366	GBP	359,071	0.09
UNILEVER	7,219	GBP	369,954	0.10
			1,571,160	0.41

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



Candriam L Multi-Asset Income

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Vereinigte Staaten von Amerika				
ABBOTT LABORATORIES	8,216	USD	796,571	0.21
AGILENT TECHNOLOGIES	1,258	USD	152,157	0.04
ALPHABET INC -A-	14,039	USD	2,386,008	0.63
AMAZON.COM INC	6,922	USD	1,248,124	0.33
AMGEN INC	1,736	USD	506,100	0.13
APPLE INC	16,758	USD	3,293,277	0.87
APPLIED MATERIALS INC	1,215	USD	267,532	0.07
BANK OF AMERICA CORP	18,837	USD	698,995	0.18
BECTON DICKINSON	2,492	USD	543,415	0.14
BROADCOM INC - REGISTERED SHS	570	USD	853,886	0.23
COCA-COLA CO	7,995	USD	474,814	0.13
CONSOLIDATED EDISON INC	6,145	USD	512,700	0.14
COSTCO WHOLESALE CORP	317	USD	251,408	0.07
ELECTRONIC ARTS - REGSHS	6,459	USD	839,685	0.22
ELI LILLY & CO	657	USD	555,013	0.15
EMERSON ELECTRIC CO	4,654	USD	478,362	0.13
FORTIVE CORP	6,502	USD	449,543	0.12
GRAPHIC PACKAGING	14,743	USD	360,545	0.10
HALLIBURTON	6,415	USD	202,191	0.05
HOME DEPOT INC	1,925	USD	618,299	0.16
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	6,296	USD	804,161	0.21
JPMORGAN CHASE CO	3,572	USD	674,106	0.18
KEYSIGHT TECHNOLOGIES	2,439	USD	311,204	0.08
MASTERCARD INC -A-	2,202	USD	906,400	0.24
MERCK & CO INC	6,050	USD	698,848	0.18
META PLATFORMS INC A	2,953	USD	1,389,281	0.37
MICRON TECHNOLOGY INC	2,393	USD	293,680	0.08
MICROSOFT CORP	8,738	USD	3,643,993	0.96
NEXTERA ENERGY	1,603	USD	105,909	0.03
NVIDIA CORP	29,573	USD	3,408,863	0.90
OTIS WORLDWIDE CORPORATION	3,665	USD	329,175	0.09
OWENS CORNING SHS	2,538	USD	411,385	0.11
PALO ALTO NETWORKS	2,618	USD	828,111	0.22
PROCTER & GAMBLE CO	5,931	USD	912,657	0.24
PTC INC	4,026	USD	682,438	0.18
S&P GLOBAL INC	1,295	USD	538,904	0.14
SALESFORCE INC	1,639	USD	393,176	0.10
SERVICENOW INC	205	USD	150,471	0.04
STRYKER CORP	1,545	USD	490,493	0.13
THERMO FISHER SCIENT SHS	1,992	USD	1,027,829	0.27
VISA INC -A-	4,129	USD	1,011,186	0.27
WALMART INC	3,069	USD	193,890	0.05
WASTE MANAGEMENT	1,904	USD	379,006	0.10
			35,073,791	9.25
Aktien gesamt			48,506,944	12.79
Anleihen				
sterreich				
AUSTRIA 0.5 19-29 20/02A	2,107,000	EUR	1,891,359	0.50
AUSTRIA 2.40 13-34 23/05A	931,000	EUR	880,284	0.23
			2,771,643	0.73
Belgien				
BELGIUM 1.00 15-31 22/06A	885,000	EUR	778,897	0.21
BELGIUM 3.75 13-45 22/06A	870,000	EUR	903,330	0.24
			1,682,227	0.44
Kanada				
RBC TORONTO 0.125 19-24 23/07A	1,750,000	EUR	1,746,308	0.46
TORONTO DOMINION BANK 3.631 22-29 13/12A	1,300,000	EUR	1,294,930	0.34

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.



Candriam L Multi-Asset Income

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
			3,041,238	0.80
Frankreich				
BFCM 1.25 20-30 03/06A1.25 20-30 03/06A	4,600,000	EUR	3,956,299	1.04
CAPGEMINI SE 0.625 20-25 23/06A	1,600,000	EUR	1,554,240	0.41
ELIS EX HOLDELIS 3.75 24-30 21/03A	2,500,000	EUR	2,460,488	0.65
FRANCE TREASURY BILL ZCP 260225	15,202,171	EUR	14,728,127	3.88
FRENCH REPUBLIC ZCP 02-01-25	13,995,187	EUR	13,586,751	3.58
NEXANS 5.5 23-28 05/04A	2,400,000	EUR	2,499,600	0.66
ORANGE SA 1.1250 19-24 15/07A	2,000,000	EUR	1,997,940	0.53
SCHNEIDER ELECTRIC SE 0.25 16-24 09/09A	600,000	EUR	595,971	0.16
SOCIETE GENERALE SA 0.75 20-27 23/01A	3,900,000	EUR	3,606,818	0.95
VERALLIA SASU 1.625 21-28 14/05A	3,100,000	EUR	2,846,017	0.75
			47,832,251	12.61
Deutschland				
ADIDAS AG 0.00 20-24 09/09U	500,000	EUR	496,350	0.13
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2.00 21-24 14/07A	1,800,000	EUR	1,798,875	0.47
GERM TREA BILL ZCP 19-02-25	12,213,505	EUR	11,821,364	3.12
GERM TREA BILL ZCP 19-03-25	18,947,678	EUR	18,334,627	4.83
GERMANY 0.00 21-36 15/05U	9,228,905	EUR	6,813,377	1.80
GERMANY 0.00 22-27 16/04U	6,137,217	EUR	5,712,398	1.51
GERMANY 1.00 15-25 15/08A	4,000,000	EUR	3,907,900	1.03
GERMANY 2.50 12-44 04/07A	6,099,915	EUR	5,898,435	1.55
SCHAEFFLER AG 3.375 20-28 12/10A	2,700,000	EUR	2,620,283	0.69
VONOVIA SE 0.0 21-25 01/12A	1,200,000	EUR	1,135,026	0.30
ZF FINANCE GMBH 2.25 21-28 03/05S	2,700,000	EUR	2,486,444	0.66
			61,025,079	16.09
Italien				
BUONI POLIENNAL 3.8500 18-49 01/09S	1,635,000	EUR	1,480,035	0.39
INTESA SANPAOLO 2.125 20-25 26/05A	1,300,000	EUR	1,281,995	0.34
INTESA SANPAOLO 4.75 22-27 06/09A	2,000,000	EUR	2,056,890	0.54
ITAL BUON ORDI DEL ZCP 14-02-25	14,133,000	EUR	13,676,118	3.61
ITAL BUON ORDI DEL ZCP 14-03-25	14,094,000	EUR	13,633,463	3.59
ITALY 4.75 13-28 01/09S	2,426,000	EUR	2,546,572	0.67
ITALY 5.00 09-40 01/09S	1,057,000	EUR	1,130,964	0.30
ITALY BUONI POLIENNALI 3.60 23-25 29/09S	5,468,000	EUR	5,473,386	1.44
			41,279,423	10.88
Japan				
EAST JAPAN RAILWAY 3.976 23-32 05/09A	4,000,000	EUR	4,139,860	1.09
			4,139,860	1.09
Niederlande				
BMW FINANCE NV 1.00 18-24 14/11A	1,300,000	EUR	1,287,000	0.34
ENEL FINANCE INTL 1.5 19-25 21/07A	1,500,000	EUR	1,467,465	0.39
NETHERLANDS 0.25 19-29 15/07A	2,534,000	EUR	2,247,025	0.59
			5,001,490	1.32
Portugal				
PORTUGAL 4.125 17-27 14/04A	1,465,000	EUR	1,514,825	0.40
			1,514,825	0.40
Spanien				
CELLNEX FINANCE CO 2.25 22-26 12/04A	1,500,000	EUR	1,463,895	0.39
SPAI LETR DEL TESO ZCP 10-01-25	13,926,000	EUR	13,533,130	3.57
SPAIN 1.25 20-30 31/10A	2,242,000	EUR	2,006,590	0.53
SPAIN 1.85 19-35 30/07A	2,120,000	EUR	1,811,890	0.48
SPAIN 2.75 14-24 31/10A	3,137,000	EUR	3,128,954	0.82
SPAIN LETRAS DEL TES ZCP 070325	14,088,000	EUR	13,639,899	3.60
TELEFONICA EMISIONES 1.495 18-25 11/09A	1,500,000	EUR	1,463,663	0.39
			37,048,021	9.77
Vereinigte Staaten von Amerika				
ABBOTT LABORATORIES 1.4000 20-30 30/06S	2,100,000	USD	1,626,969	0.43
AMERICAN TOWER CORP 1 20-32 10/09A	4,500,000	EUR	3,627,315	0.96
AT&T INC 2.60 14-29 17/12A	3,400,000	EUR	3,231,717	0.85

Die Erlauerungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwlige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.



Candriam L Multi-Asset Income

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
ATT INC 3.55 23-25 18/11A	1,500,000	EUR	1,497,285	0.39
AVANTOR FUNDING INC 3.8750 21-29 01/11S	2,700,000	USD	2,292,934	0.60
BALL CORP 6.875 22-28 15/03S	2,600,000	USD	2,492,339	0.66
BANK OF AMERICA CORP 3.875 15-25 01/08S	1,500,000	USD	1,377,943	0.36
BERRY GLOBAL INC 5.5 24-28 15/04S	1,700,000	USD	1,582,479	0.42
BOOKING HOLDINGS INC 2.375 14-24 23/09A	1,800,000	EUR	1,793,754	0.47
CENTENE CORP 4.2500 19-27 15/12S	2,800,000	USD	2,492,790	0.66
CROWN AMERICAS LLC4.7519-26 01/02S	2,700,000	USD	2,478,214	0.65
DARLING INGREDI 6.0000 22-30 15/06S	2,150,000	USD	1,973,751	0.52
ELI LILLY & CO 3.3750 19-29 15/03S	1,800,000	USD	1,585,654	0.42
HILTON DOMESTIC 3.620 21-32 15/02S	3,150,000	USD	2,545,929	0.67
IQVIA INC 2.875 20-28 24/06S	2,450,000	EUR	2,315,733	0.61
MERCK & CO INC 2.75 15-25 10/02A	1,600,000	USD	1,468,887	0.39
MICROSOFT CORP 4.25 17-47 06/02S	300,000	USD	255,100	0.07
MORGAN STANLEY 4.00 15-25 23/07S	1,500,000	USD	1,378,614	0.36
NETFLIX INC 3.6250 19-30 15/06S	2,950,000	EUR	2,945,560	0.78
NOVELIS CORP 3.875 21-31 15/08S	2,900,000	USD	2,345,200	0.62
PEPSICO INC 2.75 20-30 19/03S	1,200,000	USD	1,002,066	0.26
PROLOGIS EURO FINANC 3.875 23-30 31/01A	4,300,000	EUR	4,308,858	1.14
THERMO FISHER SCIENT 0.1250 19-25 01/03A	1,450,000	EUR	1,415,563	0.37
TOYOTA MOTOR CR 5.5500 23-30 20/11S	1,200,000	USD	1,148,882	0.30
VERIZON COMMUNICATIO 3.15 20-30 20/03S	1,400,000	USD	1,177,084	0.31
			50,360,620	13.28
Anleihen gesamt			255,696,677	67.41
Variabel verzinsliche Anleihen				
Belgien				
KBC GROUPE FL.R 22-27 23/11A	4,200,000	EUR	4,253,928	1.12
			4,253,928	1.12
Frankreich				
AXA SA FL.R 14-XX 07/11A	1,480,000	EUR	1,473,185	0.39
BNP PARIBAS FL.R 23-31 13/04A	4,300,000	EUR	4,383,743	1.16
BNP PARIBAS SA FL.R 22-32 31/03A	1,800,000	EUR	1,710,999	0.45
BPCE ISSUER FL.R 24-33 08/03A	4,400,000	EUR	4,403,586	1.16
CREDIT AGRICOLE FL.R 16-48 27/09A	2,400,000	EUR	2,414,832	0.64
			14,386,345	3.79
Deutschland				
ALLIANZ SE FL.R 17-47 06/07A	2,300,000	EUR	2,248,549	0.59
			2,248,549	0.59
Italien				
UNICREDIT SPA FL.R 19-25 03/07A	1,400,000	EUR	1,399,909	0.37
UNICREDIT SPA FL.R 20-26 16/06A	2,400,000	EUR	2,341,896	0.62
			3,741,805	0.99
Niederlande				
ING GROUP NV FL.R 17-29 26/09A	2,200,000	EUR	2,184,886	0.58
ING GROUP NV FL.R 22-27 16/02A	2,000,000	EUR	1,922,430	0.51
			4,107,316	1.08
Spanien				
BANCO SANTANDER FL.R 22-26 27/09A	3,600,000	EUR	3,595,392	0.95
IBERDROLA FINANZAS FL.R 21-99 16/11A12A	1,500,000	EUR	1,371,878	0.36
			4,967,270	1.31
Grobritannien				
NATWEST GROUP PLC FL.R 22-28 06/09A	1,600,000	EUR	1,616,096	0.43
			1,616,096	0.43
Vereinigte Staaten von Amerika				
CITIGROUP INC FL.R 22-28 22/09A	3,300,000	EUR	3,310,593	0.87
			3,310,593	0.87
Variabel verzinsliche Anleihen gesamt			38,631,902	10.18

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.



Candriam L Multi-Asset Income

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt			352,189,009	92.84
Organismen für gemeinsame Anlagen				
Anteile/Einheiten an Anlagefonds				
Luxemburg				
CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z C	7,083	USD	7,508,178	1.98
CANDRIAM BONDS EMERGING MARKETS TOTAL RETURN Z C	1,214	USD	1,867,481	0.49
CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EMERGING MARKETS Z C	1,681	USD	1,817,503	0.48
			11,193,162	2.95
Aktien/Anteile in Anlagefonds gesamt			11,193,162	2.95
Organismen für gemeinsame Anlagen gesamt			11,193,162	2.95
Anlageportfolio gesamt			363,382,171	95.79
Erwerbskosten			363,245,605	



Candriam L Multi-Asset Income

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2024

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Vereinigte Staaten von Amerika	23.39
Deutschland	17.27
Frankreich	17.13
Italien	11.87
Spanien	11.08
Luxemburg	2.95
Niederlande	2.78
Irland	2.60
Belgien	1.62
Japan	1.52
Großbritannien	0.84
Kanada	0.80
Österreich	0.73
Schweiz	0.49
Portugal	0.40
Dänemark	0.16
Finnland	0.07
Niederländische Antillen	0.07
	95.79

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Anleihen von Staaten, Provinzen und Gemeinden	42.46
Banken und andere Finanzinstitute	18.76
Internet und Internet-Dienste	4.62
Anlagefonds	3.43
Pharmazeutika	2.65
Elektronik und Halbleiter	2.49
Kommunikation	2.47
Immobilien	2.39
Nicht klassifizierbare Institutionen	1.99
Versicherungen	1.88
Transport	1.57
Verpackungsindustrie	1.41
Elektrotechnik	1.28
Gesundheitswesen	1.27
Büroausstattung und Computer	1.09
Sonstige Dienstleistungen	1.01
Kraftfahrzeuge	0.69
Versorger	0.68
Lebensmittel und alkoholfreie Getränke	0.63
Kohlebergbau und Stahlindustrie & Chemie	0.62
Einzelhandel und Warenhäuser	0.61
Textilien und Bekleidung	0.29
Chemikalien	0.27
Grafik und Verlage	0.24
Sonstige Konsumgüter	0.24
Maschinen- und Apparatebau	0.20
Erdöl	0.13
Reifen und Kautschuk	0.12
Baumaterialien	0.11
Umweltdienste und Recycling	0.10
NE-Metalle	0.07
Biotechnologie	0.04
	95.79

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



Candriam L Multi-Asset Income & Growth

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Strukturierte Produkte				
Irland				
ISHARES PHYSICAL METALS PLC - GOLD	59,305	USD	2,505,833	2.00
ISHS PHY MET (COMDTY SILVER)	23,000	USD	599,840	0.48
			3,105,673	2.48
Strukturierte Produkte, insgesamt			3,105,673	2.48
Anteile				
Belgien				
KBC GROUPE SA	3,326	EUR	219,183	0.18
			219,183	0.18
Dänemark				
NOVO NORDISK - BEARER AND/OR - REG SHS	4,764	DKK	642,402	0.51
			642,402	0.51
Finnland				
KONE OYJ -B-	5,259	EUR	242,387	0.19
			242,387	0.19
Frankreich				
AIR LIQUIDE SA	2,435	EUR	392,717	0.31
BUREAU VERITAS SA	11,782	EUR	304,683	0.24
CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	11,248	EUR	406,165	0.32
LEGRAND SA	4,480	EUR	415,027	0.33
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	733	EUR	523,069	0.42
SCHNEIDER ELECTRIC SE	2,027	EUR	454,656	0.36
			2,496,317	2.00
Deutschland				
ALLIANZ SE PREFERENTIAL SHARE	3,344	EUR	867,768	0.69
SAP AG	2,924	EUR	554,156	0.44
SIEMENS HEALTHINEERS	9,809	EUR	527,724	0.42
			1,949,648	1.56
Irland				
LINDE PLC	1,194	USD	488,863	0.39
			488,863	0.39
Japan				
KEYENCE CORP	1,300	JPY	531,984	0.43
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC	25,800	JPY	258,746	0.21
NIDEC CORP	11,300	JPY	470,938	0.38
SMC CORP	300	JPY	132,841	0.11
			1,394,509	1.11
Niederländische Antillen				
SLB	6,382	USD	280,945	0.22
			280,945	0.22
Niederlande				
ASML HOLDING NV	690	EUR	665,298	0.53
STMICROELECTRONICS NV	13,686	EUR	504,534	0.40
			1,169,832	0.93
Schweiz				
DSM FIRMENICH	6,218	EUR	656,621	0.52
NESTLE SA PREFERENTIAL SHARE	4,974	CHF	473,719	0.38
SIKA - REGISTERED SHS	2,064	CHF	551,229	0.44
			1,681,569	1.34
Großbritannien				
ANTOFAGASTA PLC	7,727	GBP	192,298	0.15
ASTRAZENECA PLC	3,294	GBP	480,046	0.38
RELX PLC	4,677	GBP	200,738	0.16
UNILEVER	4,089	GBP	209,550	0.17
			1,082,632	0.87

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



Candriam L Multi-Asset Income & Growth

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Vereinigte Staaten von Amerika				
ABBOTT LABORATORIES	6,894	USD	668,398	0.53
AGILENT TECHNOLOGIES	1,131	USD	136,796	0.11
ALPHABET INC -A-	11,137	USD	1,892,796	1.51
AMAZON.COM INC	5,980	USD	1,078,269	0.86
AMGEN INC	1,429	USD	416,600	0.33
APPLE INC	14,651	USD	2,879,210	2.30
APPLIED MATERIALS INC	965	USD	212,485	0.17
BANK OF AMERICA CORP	16,554	USD	614,278	0.49
BECTON DICKINSON	2,277	USD	496,532	0.40
BROADCOM INC - REGISTERED SHS	507	USD	759,509	0.61
COCA-COLA CO	7,382	USD	438,408	0.35
CONSOLIDATED EDISON INC	4,498	USD	375,285	0.30
COSTCO WHOLESALE CORP	380	USD	301,373	0.24
ELECTRONIC ARTS - REGSHS	5,293	USD	688,102	0.55
ELI LILLY & CO	618	USD	522,067	0.42
EMERSON ELECTRIC CO	3,894	USD	400,245	0.32
FORTIVE CORP	7,122	USD	492,410	0.39
GRAPHIC PACKAGING	13,108	USD	320,560	0.26
HALLIBURTON	6,466	USD	203,799	0.16
HOME DEPOT INC	1,556	USD	499,778	0.40
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	5,161	USD	659,192	0.53
JPMORGAN CHASE CO	3,274	USD	617,867	0.49
KEYSIGHT TECHNOLOGIES	2,158	USD	275,350	0.22
MASTERCARD INC -A-	1,905	USD	784,147	0.63
MERCK & CO INC	5,326	USD	615,217	0.49
META PLATFORMS INC A	2,239	USD	1,053,369	0.84
MICRON TECHNOLOGY INC	1,817	USD	222,990	0.18
MICROSOFT CORP	7,094	USD	2,958,398	2.36
NEXTERA ENERGY	1,243	USD	82,124	0.07
NVIDIA CORP	25,230	USD	2,908,247	2.32
OTIS WORLDWIDE CORPORATION	3,470	USD	311,661	0.25
OWENS CORNING SHS	1,860	USD	301,487	0.24
PALO ALTO NETWORKS	2,501	USD	791,102	0.63
PROCTER & GAMBLE CO	4,660	USD	717,077	0.57
PTC INC	3,856	USD	653,622	0.52
S&P GLOBAL INC	1,165	USD	484,805	0.39
SALESFORCE INC	1,369	USD	328,407	0.26
SERVICENOW INC	150	USD	110,101	0.09
STRYKER CORP	1,390	USD	441,285	0.35
THERMO FISHER SCIENT SHS	1,519	USD	783,771	0.63
VISA INC -A-	3,469	USD	849,553	0.68
WALMART INC	2,651	USD	167,482	0.13
WASTE MANAGEMENT	1,862	USD	370,645	0.30
			29,884,799	23.88
Aktien gesamt			41,533,086	33.19
Anleihen				
sterreich				
AUSTRIA 0.5 19-29 20/02A	642,000	EUR	576,295	0.46
AUSTRIA 2.40 13-34 23/05A	196,000	EUR	185,323	0.15
			761,618	0.61
Belgien				
BELGIUM 1.00 15-31 22/06A	238,000	EUR	209,466	0.17
BELGIUM 3.75 13-45 22/06A	233,000	EUR	241,926	0.19
			451,392	0.36
Kanada				
RBC TORONTO 0.125 19-24 23/07A	400,000	EUR	399,156	0.32
TORONTO DOMINION BANK 3.631 22-29 13/12A	300,000	EUR	298,830	0.24

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.



Candriam L Multi-Asset Income & Growth

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
			697,986	0.56
Frankreich				
BFCM 1.25 20-30 03/06A1.25 20-30 03/06A	1,300,000	EUR	1,118,085	0.89
CAPGEMINI SE 0.625 20-25 23/06A	400,000	EUR	388,560	0.31
ELIS EX HOLDELIS 3.75 24-30 21/03A	500,000	EUR	492,098	0.39
FRANCE TREASURY BILL ZCP 260225	3,219,618	EUR	3,116,190	2.49
FRENCH REPUBLIC ZCP 02-01-25	2,591,727	EUR	2,510,500	2.01
NEXANS 5.5 23-28 05/04A	500,000	EUR	520,750	0.42
ORANGE SA 1.1250 19-24 15/07A	600,000	EUR	599,382	0.48
SCHNEIDER ELECTRIC SE 0.25 16-24 09/09A	200,000	EUR	198,657	0.16
SOCIETE GENERALE SA 0.75 20-27 23/01A	600,000	EUR	554,895	0.44
VERALLIA SASU 1.625 21-28 14/05A	700,000	EUR	642,649	0.51
			10,141,766	8.11
Deutschland				
ADIDAS AG 0.00 20-24 09/09U	100,000	EUR	99,270	0.08
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2.00 21-24 14/07A	300,000	EUR	299,813	0.24
GERM TREA BILL ZCP 19-02-25	2,588,621	EUR	2,505,927	2.00
GERM TREA BILL ZCP 19-03-25	3,225,775	EUR	3,121,407	2.49
GERMANY 0.00 21-36 15/05U	1,192,377	EUR	880,290	0.70
GERMANY 0.00 22-27 16/04U	1,358,440	EUR	1,264,408	1.01
GERMANY 1.00 15-25 15/08A	1,520,000	EUR	1,485,002	1.19
GERMANY 2.50 12-44 04/07A	632,898	EUR	611,994	0.49
SCHAEFFLER AG 3.375 20-28 12/10A	400,000	EUR	388,190	0.31
VONOVIA SE 0.0 21-25 01/12A	200,000	EUR	189,171	0.15
ZF FINANCE GMBH 2.25 21-28 03/05S	800,000	EUR	736,724	0.59
			11,582,196	9.26
Italien				
BUONI POLIENNAL 3.8500 18-49 01/09S	482,000	EUR	436,316	0.35
INTESA SANPAOLO 2.125 20-25 26/05A	250,000	EUR	246,538	0.20
INTESA SANPAOLO 4.75 22-27 06/09A	500,000	EUR	514,223	0.41
ITAL BUON ORDI DEL ZCP 14-02-25	2,597,000	EUR	2,508,433	2.00
ITAL BUON ORDI DEL ZCP 14-03-25	3,627,000	EUR	3,502,477	2.80
ITALY 4.75 13-28 01/09S	786,000	EUR	825,064	0.66
ITALY 5.00 09-40 01/09S	359,000	EUR	384,121	0.31
ITALY BUONI POLIENNALI 3.60 23-25 29/09S	1,625,000	EUR	1,626,601	1.30
			10,043,773	8.03
Japan				
EAST JAPAN RAILWAY 3.976 23-32 05/09A	900,000	EUR	931,469	0.74
			931,469	0.74
Niederlande				
BMW FINANCE NV 1.00 18-24 14/11A	300,000	EUR	297,000	0.24
ENEL FINANCE INTL 1.5 19-25 21/07A	300,000	EUR	293,493	0.23
NETHERLANDS 0.25 19-29 15/07A	820,000	EUR	727,135	0.58
			1,317,628	1.05
Portugal				
PORTUGAL 4.125 17-27 14/04A	494,000	EUR	510,801	0.41
			510,801	0.41
Spanien				
CELLNEX FINANCE CO 2.25 22-26 12/04A	500,000	EUR	487,965	0.39
SPAI LETR DEL TESO ZCP 10-01-25	2,590,000	EUR	2,512,118	2.01
SPAIN 1.25 20-30 31/10A	696,000	EUR	622,920	0.50
SPAIN 1.85 19-35 30/07A	641,000	EUR	547,840	0.44
SPAIN 2.75 14-24 31/10A	956,000	EUR	953,548	0.76
SPAIN LETRAS DEL TES ZCP 070325	3,613,000	EUR	3,491,306	2.79
TELEFONICA EMISIONES 1.495 18-25 11/09A	300,000	EUR	292,733	0.23
			8,908,430	7.12
Vereinigte Staaten von Amerika				
ABBOTT LABORATORIES 1.4000 20-30 30/06S	832,000	USD	644,589	0.52
AMERICAN TOWER CORP 1 20-32 10/09A	1,100,000	EUR	886,677	0.71
AT&T INC 2.60 14-29 17/12A	800,000	EUR	760,404	0.61

Die Erlauerungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.



Candriam L Multi-Asset Income & Growth

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
ATT INC 3.55 23-25 18/11A	250,000	EUR	249,548	0.20
BALL CORP 6.875 22-28 15/03S	700,000	USD	671,014	0.54
BANK OF AMERICA CORP 3.875 15-25 01/08S	806,000	USD	740,415	0.59
BERRY GLOBAL INC 5.5 24-28 15/04S	500,000	USD	465,435	0.37
BOOKING HOLDINGS INC 2.375 14-24 23/09A	300,000	EUR	298,959	0.24
CROWN AMERICAS LLC4.7519-26 01/02S	300,000	USD	275,357	0.22
ELI LILLY & CO 3.3750 19-29 15/03S	845,000	USD	744,377	0.59
IQVIA INC 2.875 20-28 24/06S	640,000	EUR	604,926	0.48
MERCK & CO INC 2.75 15-25 10/02A	727,000	USD	667,426	0.53
MICROSOFT CORP 4.25 17-47 06/02S	178,000	USD	151,359	0.12
MORGAN STANLEY 4.00 15-25 23/07S	766,000	USD	704,012	0.56
NETFLIX INC 3.6250 19-30 15/06S	660,000	EUR	659,007	0.53
PEPSICO INC 2.75 20-30 19/03S	547,000	USD	456,775	0.37
PROLOGIS EURO FINANC 3.875 23-30 31/01A	1,000,000	EUR	1,002,060	0.80
THERMO FISHER SCIENT 0.1250 19-25 01/03A	400,000	EUR	390,500	0.31
TOYOTA MOTOR CR 5.5500 23-30 20/11S	400,000	USD	382,961	0.31
VERIZON COMMUNICATIO 3.15 20-30 20/03S	744,000	USD	625,536	0.50
			11,381,337	9.10
Anleihen gesamt			56,728,396	45.34
Variabel verzinsliche Anleihen				
Belgien				
KBC GROUPE FL.R 22-27 23/11A	900,000	EUR	911,556	0.73
			911,556	0.73
Frankreich				
AXA SA FL.R 14-XX 07/11A	425,000	EUR	423,043	0.34
BNP PARIBAS FL.R 23-31 13/04A	800,000	EUR	815,580	0.65
BNP PARIBAS SA FL.R 22-32 31/03A	500,000	EUR	475,278	0.38
BPCE ISSUER FL.R 24-33 08/03A	1,300,000	EUR	1,301,060	1.04
CREDIT AGRICOLE FL.R 16-48 27/09A	600,000	EUR	603,708	0.48
			3,618,669	2.89
Deutschland				
ALLIANZ SE FL.R 17-47 06/07A	700,000	EUR	684,341	0.55
			684,341	0.55
Italien				
UNICREDIT SPA FL.R 19-25 03/07A	250,000	EUR	249,984	0.20
UNICREDIT SPA FL.R 20-26 16/06A	530,000	EUR	517,169	0.41
			767,153	0.61
Niederlande				
ING GROUP NV FL.R 17-29 26/09A	500,000	EUR	496,565	0.40
ING GROUP NV FL.R 22-27 16/02A	600,000	EUR	576,729	0.46
			1,073,294	0.86
Spanien				
BANCO SANTANDER FL.R 22-26 27/09A	1,000,000	EUR	998,720	0.80
IBERDROLA FINANZAS FL.R 21-99 16/11A12A	400,000	EUR	365,834	0.29
			1,364,554	1.09
Grobritannien				
NATWEST GROUP PLC FL.R 22-28 06/09A	850,000	EUR	858,551	0.69
			858,551	0.69
Vereinigte Staaten von Amerika				
CITIGROUP INC FL.R 22-28 22/09A	755,000	EUR	757,424	0.61
			757,424	0.61
Variabel verzinsliche Anleihen gesamt			10,035,542	8.02
bertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Brse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt			111,402,697	89.04

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwlige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermgens sind auf Rundungen zurckzufhren.



Candriam L Multi-Asset Income & Growth

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Organismen fur gemeinsame Anlagen				
Anteile/Einheiten an Anlagefonds				
Frankreich				
LYXOR HONG KONG HSI-DIST	129,603	EUR	2,406,209	1.92
			2,406,209	1.92
Luxemburg				
CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQUITY MARKET NEUTRAL Z C	1,239	EUR	2,481,420	1.98
CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z C	2,986	USD	3,165,615	2.53
LUMYNA MW TOPS MARKET NEUTRAL UCITS CL B	12,091	EUR	2,254,906	1.80
			7,901,941	6.32
Aktien/Anteile in Anlagefonds gesamt			10,308,150	8.24
Organismen fur gemeinsame Anlagen gesamt			10,308,150	8.24
Anlageportfolio gesamt			121,710,847	97.27
Erwerbskosten			116,917,034	



Candriam L Multi-Asset Income & Growth

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2024

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Vereinigte Staaten von Amerika	33.59
Frankreich	14.92
Deutschland	11.36
Italien	8.64
Spanien	8.21
Luxemburg	6.32
Irland	2.87
Niederlande	2.85
Japan	1.86
Großbritannien	1.55
Schweiz	1.34
Belgien	1.26
Österreich	0.61
Kanada	0.56
Dänemark	0.51
Portugal	0.41
Niederländische Antillen	0.22
Finnland	0.19
	97.27

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Anleihen von Staaten, Provinzen und Gemeinden	28.26
Banken und andere Finanzinstitute	16.35
Anlagefonds	8.72
Internet und Internet-Dienste	8.41
Elektronik und Halbleiter	5.74
Pharmazeutika	5.49
Büroausstattung und Computer	2.91
Versicherungen	2.06
Kommunikation	2.02
Nicht klassifizierbare Institutionen	2.00
Elektrotechnik	1.81
Immobilien	1.66
Einzelhandel und Warenhäuser	1.64
Sonstige Dienstleistungen	1.32
Lebensmittel und alkoholfreie Getränke	1.26
Verpackungsindustrie	1.05
Transport	0.98
Chemikalien	0.75
Sonstige Konsumgüter	0.57
Grafik und Verlage	0.55
Maschinen- und Apparatebau	0.55
Textilien und Bekleidung	0.50
Gesundheitswesen	0.48
Erdöl	0.39
Versorger	0.37
Reifen und Kautschuk	0.32
Kraftfahrzeuge	0.31
Umweltdienste und Recycling	0.30
Baumaterialien	0.24
NE-Metalle	0.15
Biotechnologie	0.11
	97.27

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



Candriam L Multi-Asset Premia

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Anteile				
Israel				
WIX.COM LTD	727	USD	107,902	0.26
			107,902	0.26
Vereinigte Staaten von Amerika				
ANDEM DIABETES - REGISTERED SHS	2,287	USD	85,975	0.20
CARVANA REGISTERED SHS -A-	1,172	USD	140,760	0.33
COINBASE GLOBAL - REG SHS -A-	519	USD	107,616	0.26
CONSTELLATION ENERGY	539	USD	100,719	0.24
CORE ET MAIN PREFERENTIAL SHARE -A-	2,028	USD	92,606	0.22
DECKERS OUTDOOR	107	USD	96,637	0.23
DELL TECHNOLOGIES PREFERENTIAL SHARE	839	USD	107,960	0.26
ELANCO ANIMAL HEALTH	6,627	USD	89,226	0.21
FIRST SOLAR INC	431	USD	90,668	0.22
FRESHPET INC	893	USD	107,810	0.26
GAP INC	4,046	USD	90,188	0.21
GS ACQN HLDG - REGISTERED SHS -A-	1,195	USD	96,525	0.23
HOWMET AEROSPC - REGISTERED SHS	1,384	USD	100,247	0.24
KYNDRYL HLDG --- REGISTERED SHS	4,403	USD	108,088	0.26
LENDINGTREE INC	2,725	USD	105,746	0.25
MICRON TECHNOLOGY INC	937	USD	114,993	0.27
NEKTAR THERAPEUTICS	79,594	USD	92,089	0.22
NOVAVAX - REGISTERED SHS	7,795	USD	92,078	0.22
NVIDIA CORP	1,070	USD	123,338	0.29
PURE STORAGE -A-	1,943	USD	116,408	0.28
SPROUTS FARMERS MARKET INC	1,483	USD	115,762	0.27
TELEPHONE AND DATA SYSTEMS INC	5,890	USD	113,926	0.27
TENET HEALTHCARE	866	USD	107,491	0.26
UNITED STATES CELLULAR CORP	2,112	USD	109,999	0.26
WILLIAMS-SONOMA	400	USD	105,387	0.25
			2,612,242	6.21
Aktien gesamt			2,720,144	6.46
Anleihen				
Österreich				
AUSTRIAN T-BILL ZCP 250724	2,500,000	EUR	2,474,134	5.88
			2,474,134	5.88
Belgien				
BELGIUM 0.80 15-25 22/06A	2,300,000	EUR	2,244,156	5.33
BELGIUM TREAS BILL ZCP 071124	1,500,000	EUR	1,473,743	3.50
			3,717,899	8.83
Finnland				
FINLAND TBILL ZCP 13-11-24	5,000,000	EUR	4,895,114	11.63
			4,895,114	11.63
Frankreich				
FRANCE 0.00 19-25 25/03U	927,200	EUR	904,182	2.15
FRENCH REPUBLIC ZCP 17-07-24	2,500,000	EUR	2,479,065	5.89
			3,383,247	8.04
Deutschland				
GERMANY 0.00 20-25 10/10U	2,300,000	EUR	2,214,578	5.26
			2,214,578	5.26
Italien				
ITAL BUON ORDI DEL ZCP 31-07-24	1,150,000	EUR	1,129,084	2.68
ITALY 1.85 20-25 01/07S	2,300,000	EUR	2,263,074	5.38
			3,392,158	8.06

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.



Candriam L Multi-Asset Premia

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Luxemburg				
EUROPEAN STAB MEC TR ZCP 211124	3,000,000	EUR	2,949,583	7.01
			2,949,583	7.01
Portugal				
Portugal ZCP 19-07-24	1,600,000	EUR	1,589,031	3.77
			1,589,031	3.77
Spanien				
SPAIN 0.00 20-25 31/01U	2,300,000	EUR	2,255,035	5.36
			2,255,035	5.36
Vereinigte Staaten von Amerika				
UNITED STATES 2.75 18-25 28/02S	1,000,000	USD	918,001	2.18
			918,001	2.18
Anleihen gesamt			27,788,780	66.01
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt			30,508,924	72.47
Organismen für gemeinsame Anlagen				
Anteile/Einheiten an Anlagefonds				
Luxemburg				
CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQUITY MARKET NEUTRAL Z C	1,596	EUR	3,196,404	7.59
CANDRIAM BONDS EMERGING MARKETS CORPORATE Z C	1	USD	1,472	0.00
			3,197,876	7.60
Aktien/Anteile in Anlagefonds gesamt			3,197,876	7.60
Organismen für gemeinsame Anlagen gesamt			3,197,876	7.60
Anlageportfolio gesamt			33,706,800	80.07
Erwerbskosten			34,051,923	



Candriam L Multi-Asset Premia

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2024

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Luxemburg	14.60
Finnland	11.63
Belgien	8.83
Vereinigte Staaten von Amerika	8.39
Italien	8.06
Frankreich	8.04
Österreich	5.88
Spanien	5.36
Deutschland	5.26
Portugal	3.77
Israel	0.26
	80.07

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Anleihen von Staaten, Provinzen und Gemeinden	59.00
Anlagefonds	7.60
Supranationale Organisationen	7.01
Internet und Internet-Dienste	1.05
Elektronik und Halbleiter	0.78
Einzelhandel und Warenhäuser	0.74
Kommunikation	0.53
Banken und andere Finanzinstitute	0.50
Pharmazeutika	0.43
Biotechnologie	0.42
Kraftfahrzeuge	0.33
Gesundheitswesen	0.26
Lebensmittel und alkoholfreie Getränke	0.26
Immobilien	0.25
NE-Metalle	0.24
Büroausstattung und Computer	0.23
Textilien und Bekleidung	0.23
Versorger	0.22
	80.07



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Optionen

Zum 30. Juni 2024 waren die offenen Optionen und Swaptions wie folgt:

Candriam L Balanced Asset Allocation

Anzahl	Bezeichnung	Währung	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Marktwert (in EUR)	Nicht realisiert (in EUR)
Gekaufte Optionen					
32	SP 500 INDEX 20240920 P5050	USD	0	78,974	(320,109)
Verkaufte Optionen					
32	SP 500 INDEX 20240920 P4800	USD	994,528	(43,144)	179,899
				35,830	(140,210)

Candriam L Conservative Asset Allocation

Anzahl	Bezeichnung	Währung	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Marktwert (in EUR)	Nicht realisiert (in EUR)
Gekaufte Optionen					
40	SP 500 INDEX 20240920 P5050	USD	0	98,717	(400,137)
Verkaufte Optionen					
40	SP 500 INDEX 20240920 P4800	USD	1,243,160	(53,930)	224,874
				44,787	(175,263)

Candriam L Dynamic Asset Allocation

Anzahl	Bezeichnung	Währung	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Marktwert (in EUR)	Nicht realisiert (in EUR)
Gekaufte Optionen					
3	SP 500 INDEX 20240920 P5050	USD	0	7,405	(30,010)
Verkaufte Optionen					
3	SP 500 INDEX 20240920 P4800	USD	93,237	(4,045)	16,866
				3,360	(13,144)

Candriam L Multi-Asset Income

Anzahl	Bezeichnung	Währung	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Marktwert (in EUR)	Nicht realisiert (in EUR)
Gekaufte Optionen					
112	SP 500 INDEX 20240920 P5300	USD	0	571,104	(132,895)
734	STOXX EUROPE 600 20240920 P505	EUR	0	311,950	44,040
Verkaufte Optionen					
112	SP 500 INDEX 20240920 P5000	USD	5,991,625	(241,922)	66,388
734	STOXX EUROPE 600 20240920 P485	EUR	3,772,592	(157,810)	(20,551)
				483,322	(43,018)

Candriam L Multi-Asset Income & Growth

Anzahl	Bezeichnung	Währung	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Marktwert (in EUR)	Nicht realisiert (in EUR)
Gekaufte Optionen					
38	SP 500 INDEX 20240920 P5300	USD	0	193,767	(45,089)
486	STOXX EUROPE 600 20240920 P505	EUR	0	206,550	29,160
Verkaufte Optionen					
38	SP 500 INDEX 20240920 P5000	USD	2,032,873	(82,081)	22,524
486	STOXX EUROPE 600 20240920 P485	EUR	2,497,929	(104,490)	(13,608)
				213,746	(7,013)

Alle Optionsverträge wurden mit der Gegenpartei J.P. Morgan SE abgeschlossen. Siehe Anhangangabe 10 über Barmittel beim Broker im Zusammenhang mit börsennotierten Optionen und Anhangangabe 11 über erhaltene/gebuchte Sicherheiten im Zusammenhang mit OTC-Optionen. Die Verpflichtung für die gekauften Optionen wird nicht bekannt gegeben.



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Devisenterminkontrakte

Zum 30. Juni 2024 waren die folgenden Devisentermingeschäfte ausstehend:

Candriam L Balanced Asset Allocation

Gekaufte Devisen	Gekaufte Anzahl	Verkaufte Devisen	Verkaufte Anzahl	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Nicht realisiert (in EUR)
CHF	810,477	EUR	847,663	17/12/2024	Société Générale SA	4,003
EUR	4,090,935	USD	4,461,971	17/12/2024	Goldman Sachs International London Branch	(38,100)
EUR	3,836,644	USD	4,144,064	17/12/2024	Société Générale SA	2,105
EUR	1,696,102	JPY	283,297,076	17/12/2024	Société Générale SA	23,679
GBP	1,130,811	EUR	1,327,316	17/12/2024	Société Générale SA	(3,048)
JPY	558,721,219	EUR	3,347,047	17/12/2024	J.P. Morgan SE	(48,644)
USD	2,922,090	EUR	2,708,978	17/12/2024	Société Générale SA	(5,173)
						(65,178)

Candriam L Conservative Asset Allocation

Gekaufte Devisen	Gekaufte Anzahl	Verkaufte Devisen	Verkaufte Anzahl	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Nicht realisiert (in EUR)
CHF	596,907	EUR	624,293	17/12/2024	Société Générale SA	2,948
EUR	4,580,033	USD	4,995,428	17/12/2024	Goldman Sachs International London Branch	(42,655)
EUR	2,653,747	USD	2,866,385	17/12/2024	Société Générale SA	1,456
EUR	1,927,603	JPY	321,964,274	17/12/2024	Société Générale SA	26,911
GBP	790,564	EUR	927,943	17/12/2024	Société Générale SA	(2,131)
JPY	635,758,782	EUR	3,808,544	17/12/2024	J.P. Morgan SE	(55,352)
USD	1,663,212	EUR	1,541,912	17/12/2024	Société Générale SA	(2,944)
						(71,767)

Candriam L Dynamic Asset Allocation

Gekaufte Devisen	Gekaufte Anzahl	Verkaufte Devisen	Verkaufte Anzahl	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Nicht realisiert (in EUR)
EUR	565,243	USD	610,534	17/12/2024	Société Générale SA	310
EUR	139,072	JPY	23,229,025	17/12/2024	Société Générale SA	1,942
JPY	46,614,960	EUR	279,249	17/12/2024	J.P. Morgan SE	(4,059)
USD	313,523	EUR	287,469	17/12/2024	J.P. Morgan SE	2,660
USD	639,036	EUR	590,029	17/12/2024	Société Générale SA	1,289
						2,142

Candriam L Multi-Asset Income

Gekaufte Devisen	Gekaufte Anzahl	Verkaufte Devisen	Verkaufte Anzahl	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Nicht realisiert (in EUR)
EUR	15,067,813	USD	16,436,926	17/12/2024	Société Générale SA	(142,671)
GBP	1,600,126	EUR	1,877,875	17/12/2024	Nomura Financial Products & Services	(4,000)
JPY	960,294,949	EUR	5,750,980	17/12/2024	Société Générale SA	(81,922)
						(228,593)

Candriam L Multi-Asset Income & Growth

Gekaufte Devisen	Gekaufte Anzahl	Verkaufte Devisen	Verkaufte Anzahl	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Nicht realisiert (in EUR)
EUR	5,629,251	USD	6,140,665	17/12/2024	J.P. Morgan SE	(53,227)
EUR	3,150,960	USD	3,420,610	17/12/2024	Nomura Financial Products & Services	(14,293)
GBP	2,125,476	EUR	2,494,415	17/12/2024	Nomura Financial Products & Services	(5,314)
JPY	574,009,828	EUR	3,437,447	17/12/2024	Nomura Financial Products & Services	(48,809)
						(121,643)

Beachten Sie Anhangangabe 10 hinsichtlich erhaltener/verbuchter Sicherheiten in Verbindung mit den Devisenterminkontrakten. Diese Geschäfte mit Devisenterminkontrakten werden hauptsächlich den gegen Währungsrisiko abgesicherten Anteilsklassen zugewiesen.



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Futures

Zum 30. Juni 2024 waren die folgenden Futures-Kontrakte ausstehend:

Candriam L Balanced Asset Allocation

Anzahl (Kauf/(Verkauf))	Bezeichnung	Währung	Gegenpartei	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Nicht realisiert (in EUR)
Futures auf Index					
(17)	FTSE 100 IND /202409	GBP	J.P. Morgan SE	1,636,965	2,005
7	NIKKEI 225 (/202409	JPY	J.P. Morgan SE	1,607,186	39,385
16	NASDAQ 100 E/202409	USD	J.P. Morgan SE	5,876,854	(80,287)
30	S&P 500 EMIN /202409	USD	J.P. Morgan SE	7,642,379	(35,268)
32	FTSE 250 Y2 /202409	GBP	J.P. Morgan SE	1,531,292	(264)
245	DJ STX 600 R /202409	EUR	J.P. Morgan SE	1,549,380	(16,538)
185	EUX STX SMAL /202409	EUR	J.P. Morgan SE	3,082,378	(32,745)
85	DJ.STOXX600. /202409	EUR	J.P. Morgan SE	1,564,298	(15,172)
54	DJ ST600 HLT /202409	EUR	J.P. Morgan SE	3,256,065	(722)
(444)	STOXX EUR 60 /202409	EUR	J.P. Morgan SE	11,353,524	88,668
Futures auf Anleihen					
53	EURO BUND FU /202409	EUR	J.P. Morgan SE	5,354,670	98,382
66	US 10YR NOTE 0924	USD	J.P. Morgan SE	6,246,676	60,292
					107,736

Candriam L Conservative Asset Allocation

Anzahl (Kauf/(Verkauf))	Bezeichnung	Währung	Gegenpartei	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Nicht realisiert (in EUR)
Futures auf Index					
(20)	FTSE 100 IND /202409	GBP	J.P. Morgan SE	1,925,841	2,359
7	NIKKEI 225 (/202409	JPY	J.P. Morgan SE	1,607,186	39,385
20	NASDAQ 100 E/202409	USD	J.P. Morgan SE	7,346,068	(100,359)
98	DJ.STOXX600. /202409	EUR	J.P. Morgan SE	1,803,543	(17,492)
28	S&P 500 EMIN /202409	USD	J.P. Morgan SE	7,132,887	(32,917)
38	FTSE 250 Y2 /202409	GBP	J.P. Morgan SE	1,818,409	(314)
62	DJ ST600 HLT /202409	EUR	J.P. Morgan SE	3,738,445	(829)
286	DJ STX 600 R /202409	EUR	J.P. Morgan SE	1,808,664	(19,306)
(615)	STOXX EUR 60 /202409	EUR	J.P. Morgan SE	15,726,165	119,831
224	EUX STX SMAL /202409	EUR	J.P. Morgan SE	3,732,176	(39,648)
Futures auf Anleihen					
87	EURO BUND FU /202409	EUR	J.P. Morgan SE	8,789,741	161,495
79	US 10YR NOTE 0924	USD	J.P. Morgan SE	7,477,082	72,168
					184,373

Candriam L Dynamic Asset Allocation

Anzahl (Kauf/(Verkauf))	Bezeichnung	Währung	Gegenpartei	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Nicht realisiert (in EUR)
Futures auf Index					
(2)	FTSE 100 IND /202409	GBP	J.P. Morgan SE	192,584	236
1	NASDAQ 100 E/202409	USD	J.P. Morgan SE	367,303	(5,018)
3	FTSE 250 Y2 /202409	GBP	J.P. Morgan SE	143,559	(25)
4	DJ ST600 HLT /202409	EUR	J.P. Morgan SE	241,190	(54)
6	S&P 500 EMIN /202409	USD	J.P. Morgan SE	1,528,476	(7,054)
6	DJ.STOXX600. /202409	EUR	J.P. Morgan SE	110,421	(1,071)
16	EUX STX SMAL /202409	EUR	J.P. Morgan SE	266,584	(2,832)
20	DJ STX 600 R /202409	EUR	J.P. Morgan SE	126,480	(1,350)
(48)	STOXX EUR 60 /202409	EUR	J.P. Morgan SE	1,227,408	9,063
Futures auf Anleihen					
3	EURO BUND FU /202409	EUR	J.P. Morgan SE	303,095	5,569
5	US 10YR NOTE 0924	USD	J.P. Morgan SE	473,233	4,563
					2,027



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Futures (Fortsetzung)

Candriam L Multi-Asset Income

Anzahl (Kauf/(Verkauf))	Bezeichnung	Währung	Gegenpartei	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Nicht realisiert (in EUR)
Futures auf Index					
(20)	FTSE 100 IND /202409	GBP	J.P. Morgan SE	1,925,841	2,359
44	S&P 500 EMIN /202409	USD	J.P. Morgan SE	11,208,823	(61,356)
144	ZTS MSCI EME /202409	USD	J.P. Morgan SE	7,709,425	66,402
39	FTSE 250 Y2 /202409	GBP	J.P. Morgan SE	1,866,262	(322)
61	TOPIX (OSE) /202409	JPY	J.P. Morgan SE	9,941,168	201,680
283	DJ STX 600 R /202409	EUR	J.P. Morgan SE	1,789,692	(19,103)
223	EUX STX SMAL /202409	EUR	J.P. Morgan SE	3,715,515	(39,471)
Futures auf Anleihen					
85	LONG GILT FUT 202409	GBP	J.P. Morgan SE	10,005,608	59,150
179	EURO BOBL FU /202409	EUR	J.P. Morgan SE	17,595,521	204,060
179	EURO BUND FU /202409	EUR	J.P. Morgan SE	18,084,639	332,272
					745,671

Candriam L Multi-Asset Income & Growth

Anzahl (Kauf/(Verkauf))	Bezeichnung	Währung	Gegenpartei	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Nicht realisiert (in EUR)
Futures auf Index					
(14)	FTSE 100 IND /202409	GBP	J.P. Morgan SE	1,348,088	1,651
12	S&P 500 EMIN /202409	USD	J.P. Morgan SE	3,056,952	(14,107)
23	TOPIX (OSE) /202409	JPY	J.P. Morgan SE	3,748,309	76,043
46	STOXX EUR 60 /202409	EUR	J.P. Morgan SE	1,176,266	(8,142)
148	EUX STX SMAL /202409	EUR	J.P. Morgan SE	2,465,902	(26,196)
26	FTSE 250 Y2 /202409	GBP	J.P. Morgan SE	1,244,175	(215)
203	ZTS MSCI EME /202409	USD	J.P. Morgan SE	10,868,147	146,035
187	DJ STX 600 R /202409	EUR	J.P. Morgan SE	1,182,588	(12,623)
Futures auf Anleihen					
29	LONG GILT FUT 202409	GBP	J.P. Morgan SE	3,413,678	20,180
61	EURO BOBL FU /202409	EUR	J.P. Morgan SE	5,996,239	69,540
61	EURO BUND FU /202409	EUR	J.P. Morgan SE	6,162,922	113,232
					365,398

Candriam L Multi-Asset Premia

Anzahl (Kauf/(Verkauf))	Bezeichnung	Währung	Gegenpartei	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Nicht realisiert (in EUR)
Futures auf Index					
(1)	CAC40 10 EUR /202407	EUR	J.P. Morgan SE	74,794	(80)
(1)	SPI 200 INDE /202409	AUD	J.P. Morgan SE	121,004	16
1	DAX INDEX GE /202409	EUR	J.P. Morgan SE	455,886	3,263
2	EM RUSS 2000 /202409	USD	J.P. Morgan SE	191,061	2,188
3	DJIA MINI FU /202409	USD	J.P. Morgan SE	547,500	3,993
3	HANG SENG IN /202407	HKD	J.P. Morgan SE	2,479,861	(2,904)
4	NIKKEI 225 202409	JPY	J.P. Morgan SE	459,196	6,337
5	S&P 500 EMIN /202409	USD	J.P. Morgan SE	1,273,730	1,712
8	EURO STOXX 50 202409	EUR	J.P. Morgan SE	391,522	(1,815)
9	FTSE 100 IND /202409	GBP	J.P. Morgan SE	866,628	(4,582)
9	TOPIX (OSE) /202409	JPY	J.P. Morgan SE	1,466,730	29,965
13	NASDAQ 100 E/202409	USD	J.P. Morgan SE	4,774,944	(60,396)
135	FTSE DVD IDX /202512	GBP	J.P. Morgan SE	283,295	39,966
190	DJ ESTOXX50D 1225	EUR	J.P. Morgan SE	2,484,060	856,400
235	DJ EURO STOXX /202612	EUR	J.P. Morgan SE	3,072,390	1,001,883
250	FTSE DVD IDX 1224	GBP	J.P. Morgan SE	524,621	85,510
(89)	CBOE VIX FUT /202407	USD	J.P. Morgan SE	1,033,039	25,184
76	EUR HY /202409	EUR	J.P. Morgan SE	4,259,473	(8,208)
Futures auf Anleihen					
(59)	EURO BUND FU /202409	EUR	J.P. Morgan SE	5,960,859	23,190
(42)	EURO-OAT-FUT /202409	EUR	J.P. Morgan SE	4,135,362	45,100
(18)	US ULTRA BD /202409	USD	J.P. Morgan SE	1,731,062	(19,784)
(10)	US 5YR 202409	USD	J.P. Morgan SE	931,741	(758)



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Futures (Fortsetzung)

Candriam L Multi-Asset Premia (Fortsetzung)

Anzahl (Kauf/(Verkauf))	Bezeichnung	Währung	Gegenpartei	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Nicht realisiert (in EUR)
Futures auf Index					
(10)	US TBOND 30 0924	USD	J.P. Morgan SE	919,932	933
(8)	US 2 YEARS N /202409	USD	J.P. Morgan SE	1,489,241	(4,619)
8	JPN 10 YEARS BOND	JPY	J.P. Morgan SE	4,422,161	(7,773)
90	EURO BTP FUT /202409	EUR	J.P. Morgan SE	9,331,470	(126,370)
(83)	KOREA 3YR BO /202409	KRW	J.P. Morgan SE	5,622,455	(6,975)
(105)	US 10YR NOTE 0924	USD	J.P. Morgan SE	9,937,894	(16,742)
Futures auf Währungen					
(38)	USD/NZD (CME /202409	USD	J.P. Morgan SE	2,159,846	(4,833)
(7)	INR/USD- CME /202407	USD	J.P. Morgan SE	391,621	(588)
(5)	USD/CHF (CME /202409	USD	J.P. Morgan SE	648,822	4,735
(3)	JPN YEN CURR /202409	USD	J.P. Morgan SE	217,488	1,330
5	USD/NOK (CME /202409	USD	J.P. Morgan SE	873,727	(15,302)
13	USD/MXN (CME /202409	USD	J.P. Morgan SE	331,199	8,551
23	USD/AUD (CME /202409	USD	J.P. Morgan SE	1,431,333	2,458
30	EUR/JPY (CM /202409	JPY	J.P. Morgan SE	3,748,970	64,972
(11)	USD/GBP (CME /202409	USD	J.P. Morgan SE	811,145	(671)
26	USD/ZAR (CME /202409	USD	J.P. Morgan SE	666,723	(82)
(62)	USD/CAD (CME /202409	USD	J.P. Morgan SE	4,228,899	(5,676)
(19)	EUR/USD (CME /202409	USD	J.P. Morgan SE	2,374,004	11,037
(56)	BRAZIL REAL /202408	USD	J.P. Morgan SE	934,037	27,035
					1,957,600

Siehe Anhangangabe 9 über Barmittel bei Brokern im Zusammenhang mit Futures.



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Differenzkontrakte

Zum 30. Juni 2024 waren die folgenden CFD-Kontrakte ausstehend:

Candriam L Multi-Asset Premia

Anzahl	Long- / Short-Position	Währung	Basiswert	Gegenpartei	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Nicht realisiert (in EUR)
68,000	Short	HKD	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	172,284	(5,282)
5,500	Short	JPY	COSMO ENERGY HOLDINGS CO LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	258,408	(10,241)
5,000	Long	JPY	TDK CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	286,105	29,060
6,000	Long	JPY	TOYOTA MOTOR CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	114,500	8,840
9,000	Long	JPY	RENESAS ELECTRONICS	Citibank Europe plc, Germany Branch	157,081	(6,995)
21,000	Long	JPY	OJI HOLDINGS	Citibank Europe plc, Germany Branch	77,324	2,899
28,000	Long	JPY	KYUSHU FINANCIAL GROUP INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	153,186	2,030
38,000	Long	JPY	SEKISUI CHEMICAL CO LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	490,645	3,306
44,000	Long	JPY	CYBER AGENT	Citibank Europe plc, Germany Branch	257,132	8,473
60,000	Long	JPY	DAIWA SECURITIES GROUP INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	427,026	20,185
12	Long	EUR	HERMES INTERNATIONAL SA	Citibank Europe plc, Germany Branch	25,680	180
4,506	Short	GBP	INCHCAPE	Citibank Europe plc, Germany Branch	39,541	345
4,506	Short	USD	CORTEVA - REGISTERED SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	226,782	(7,988)
3,856	Long	CHF	ALCON INC. - REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	321,197	6,647
250	Long	USD	LAM RESEARCH CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	248,390	(1,598)
10,400	Long	JPY	YAMATAKE CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	270,313	21,355
28,600	Long	JPY	SANTEN PHARMACEUTICAL CO LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	272,726	9,456
700	Short	JPY	SMC CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	309,962	650
7,200	Short	JPY	TAISEI	Citibank Europe plc, Germany Branch	248,531	(8,227)
1,409	Long	DKK	PANDORA	Citibank Europe plc, Germany Branch	198,574	283
9,600	Long	JPY	ISETAN MITSUKOSHI	Citibank Europe plc, Germany Branch	168,165	(6,571)
1,672	Short	USD	EXTRA SPACE STORAGE INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	242,450	(780)
681	Long	EUR	CARL ZEISS MEDITEC AG - INHABER-AKT	Citibank Europe plc, Germany Branch	44,708	(953)
32	Long	USD	UNITEDHEALTH GROUP INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	15,205	598
15,038	Short	SEK	SANDVIK AB	Citibank Europe plc, Germany Branch	281,416	4,107
110,057	Long	EUR	KONINKLIJKE KPN NV - BEARER/REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	394,004	9,905
110,975	Long	SEK	TELIA COMPANY AB	Citibank Europe plc, Germany Branch	277,975	17,404
18,100	Short	JPY	OTSUKA CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	324,516	(21,575)
3,006	Short	EUR	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	Citibank Europe plc, Germany Branch	83,928	(661)
1,101	Short	USD	ILLUMINA INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	107,229	4,818
18,269	Short	GBP	SMITH AND NEPHEW PLC	Citibank Europe plc, Germany Branch	211,294	1,422
6,073	Short	DKK	GN GREAT NORDIC	Citibank Europe plc, Germany Branch	158,066	10,587
15,400	Short	JPY	ABC MART INC. TOKYO	Citibank Europe plc, Germany Branch	252,347	(1,385)
1,670	Long	USD	DAVITA	Citibank Europe plc, Germany Branch	215,920	(4,160)
974	Long	DKK	GENMAB AS	Citibank Europe plc, Germany Branch	227,910	(7,118)
4,066	Short	EUR	DEUTSCHE POST AG REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	153,654	(529)
7,455	Short	USD	US BANCORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	276,150	(4,243)
4,691	Long	CHF	NOVARTIS AG PREFERENTIAL SHARE	Citibank Europe plc, Germany Branch	468,442	12,811
7,194	Short	CHF	ADECCO REG.SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	222,756	11,354
2,117	Short	CHF	BALOISE HOLDING - REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	347,759	(4,177)
4,480	Long	EUR	STMICROELECTRONICS NV - BEARER/REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	165,155	(12,858)
1,610	Short	USD	CHEVRON CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	234,977	(4,852)
118,133	Short	GBP	BT GROUP PLC	Citibank Europe plc, Germany Branch	195,553	(2,369)
2,822	Short	USD	3M CO	Citibank Europe plc, Germany Branch	269,074	(4,371)
2,587	Long	USD	SKYWORKS SOLUTIONS INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	257,264	676
17,999	Long	GBP	BURBERRY GROUP PLC	Citibank Europe plc, Germany Branch	186,348	(22,927)
1,168	Long	AUD	BLUESCOPE STEEL	Citibank Europe plc, Germany Branch	14,869	153
83,000	Long	HKD	BOC HONG KONG (HOLDINGS) LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	238,557	(1,984)
2,895	Long	USD	CARMAX INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	198,105	4,484
560	Short	CHF	SWISS LIFE HOLDING N-NAMEN REGISTERED	Citibank Europe plc, Germany Branch	384,130	(13,374)
2,667	Long	GBP	NEXT PLC	Citibank Europe plc, Germany Branch	284,237	(63)
1,064	Long	USD	COMCAST CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	38,877	1,837
17,600	Long	JPY	MIZUHO FINANCIAL GROUP INC - REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	342,809	34,097



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Differenzkontrakte (Fortsetzung)

Candriam L Multi-Asset Premia (Fortsetzung)

Anzahl	Long- / Short- Position	Wahrung	Basiswert	Gegenpartei	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Nicht realisiert (in EUR)
22,600	Long	JPY	SEIKO EPSON CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	327,592	12,847
883,301	Short	EUR	TELECOM ITALIA	Citibank Europe plc, Germany Branch	197,418	2,562
12,500	Long	JPY	OSAKA SECURITIES EXCHANGE	Citibank Europe plc, Germany Branch	272,039	12,978
11,100	Long	JPY	T&D HOLDING	Citibank Europe plc, Germany Branch	180,824	14,068
3,000	Short	JPY	ULVAC INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	182,887	783
3,000	Short	JPY	MISUMI GROUP	Citibank Europe plc, Germany Branch	47,862	(2,149)
97,614	Long	GBP	J SAINSBURY PLC	Citibank Europe plc, Germany Branch	293,585	(4,375)
202	Long	USD	DECKERS OUTDOOR	Citibank Europe plc, Germany Branch	182,436	(9,337)
2,599	Short	USD	MICROCHIP TECHNOLOGY	Citibank Europe plc, Germany Branch	221,888	(1,164)
113	Short	USD	MICROSTRATEGY -A-	Citibank Europe plc, Germany Branch	145,235	13,683
702	Long	USD	CHENIERE ENERGY INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	114,514	12,930
3,808	Short	USD	REALTY INCOME CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	187,673	888
903	Long	USD	AMERIPRISE FINANCIAL INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	359,928	(4,516)
9,284	Short	SEK	INDUTRADE AB	Citibank Europe plc, Germany Branch	222,162	(1,963)
9,833	Short	SEK	GETINGE -B-	Citibank Europe plc, Germany Branch	155,985	(1,386)
21,200	Long	JPY	SUMCO CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	284,734	(3,812)
15,503	Short	USD	AT&T INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	276,429	(20,830)
30,473	Short	SEK	HUSQVARNA -B-	Citibank Europe plc, Germany Branch	228,051	8,108
2,232	Long	CHF	LOGITECH INTERNATIONAL SA - NAMEN-AKT	Citibank Europe plc, Germany Branch	201,449	(1,808)
43,823	Long	AUD	BRAMBLES	Citibank Europe plc, Germany Branch	396,777	4,096
555	Long	USD	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	170,573	(3,464)
1,315	Long	USD	DEXCOM INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	139,113	(3,865)
403	Long	USD	FIRST SOLAR INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	84,778	(13,488)
12,824	Long	NOK	SUBSEA 7 SA	Citibank Europe plc, Germany Branch	225,655	13,373
1,497	Short	DKK	DSV A/S	Citibank Europe plc, Germany Branch	214,188	1,706
2,098	Long	USD	DISCOVER FINANCIAL SERVICES - SHS WI	Citibank Europe plc, Germany Branch	256,067	9,983
8,172	Long	GBP	3I GROUP PLC	Citibank Europe plc, Germany Branch	295,516	1,446
1,472	Short	EUR	DIASORIN	Citibank Europe plc, Germany Branch	136,984	6,035
6,163	Short	GBP	ANGLO AMERICAN PLC	Citibank Europe plc, Germany Branch	181,870	(9,522)
715	Long	USD	LULULEMON ATHLETICA INC SHS WHEN ISSUED	Citibank Europe plc, Germany Branch	199,273	(9,480)
115	Long	USD	MERCADOLIBRE	Citibank Europe plc, Germany Branch	176,339	9,032
2,155	Long	USD	NEUROCRINE BIOSCIENCES	Citibank Europe plc, Germany Branch	276,817	4,786
18,412	Short	USD	INVESCO LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	257,004	(6,356)
2,601	Short	CAD	FRANCO-NEVADA CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	287,670	(5,143)
48,455	Short	AUD	THE LOTTERY CORPORATION LIMITED	Citibank Europe plc, Germany Branch	153,083	3,623
79,679	Long	AUD	DEXUS AMERICAN DEPOSITARY RECEIPTS	Citibank Europe plc, Germany Branch	321,735	497
2,326	Short	USD	DOLLAR TREE INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	231,721	4,080
515	Long	CHF	SWISSQUOTE GROUP HOLDING	Citibank Europe plc, Germany Branch	151,658	321
1,904	Long	USD	VISA INC -A-	Citibank Europe plc, Germany Branch	466,287	(15,456)
15,700	Long	JPY	TIS SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	283,945	25,271
10,949	Short	NOK	AKER BP SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	261,168	(15,735)
28,852	Long	GBP	UNITED UTILITIES GROUP PLC - REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	334,375	(9,835)
2,279	Long	CHF	NESTLE SA PREFERENTIAL SHARE	Citibank Europe plc, Germany Branch	217,050	(7,999)
37,700	Long	USD	CFD OVERSEA-CHINESE BANKING CORPORATION	Citibank Europe plc, Germany Branch	374,534	(128)
43,400	Long	USD	CFD SINGAPORE EXCHANGE	Citibank Europe plc, Germany Branch	283,258	7,027
9,571	Short	EUR	E.ON SE	Citibank Europe plc, Germany Branch	117,293	1,149
62,600	Long	HKD	THE LINK REIT UNITS	Citibank Europe plc, Germany Branch	227,056	(15,711)
17,932	Long	GBP	GSK REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	323,489	(14,911)
3,428	Long	EUR	VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	Citibank Europe plc, Germany Branch	361,311	857
5,730	Long	EUR	FREENET AG - REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	142,104	(458)
22,173	Short	GBP	ENTAIN PLC	Citibank Europe plc, Germany Branch	164,758	10,252
5,180	Long	CHF	JULIUS BAER GROUP - REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	270,013	(6,992)
3,556	Long	USD	FORTINET	Citibank Europe plc, Germany Branch	199,972	(2,090)
1,641	Short	USD	DOLLAR GENERAL	Citibank Europe plc, Germany Branch	202,463	(8,176)
8,800	Short	JPY	DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	219,385	(22,153)



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Differenzkontrakte (Fortsetzung)

Candriam L Multi-Asset Premia (Fortsetzung)

Anzahl	Long- / Short-Position	Wahrung	Basiswert	Gegenpartei	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Nicht realisiert (in EUR)
308	Long	NOK	BAKKAUFROST	Citibank Europe plc, Germany Branch	14,629	(945)
2,900	Short	JPY	ENEOS HOLDINGS INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	13,904	(330)
10,324	Short	USD	SS C TECHNOLOGIERS HOLDINGS	Citibank Europe plc, Germany Branch	603,690	(12,908)
15,100	Long	JPY	KDDI CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	372,591	6,919
26,373	Short	GBP	OCADO GROUP PLC	Citibank Europe plc, Germany Branch	89,864	18,228
879	Long	EUR	ADIDAS AG - REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	196,017	3,428
970	Short	DKK	ZEALAND PHARMA	Citibank Europe plc, Germany Branch	116,089	(31,867)
4,808	Short	AUD	MINERAL RESOURCES	Citibank Europe plc, Germany Branch	161,545	21,242
23,325	Short	USD	KINDER MORGAN INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	432,440	(4,353)
35,008	Short	AUD	TREASURY WINE ESTATES LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	271,373	(9,817)
4,975	Short	USD	FORTUNE BRANDS	Citibank Europe plc, Germany Branch	301,448	11,234
391,000	Short	HKD	HKT LTD - STAPLED SECURITY	Citibank Europe plc, Germany Branch	409,336	(3,738)
12,100	Short	JPY	NEXON CO LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	208,800	(4,843)
2,475	Long	EUR	BEIERSDORF AG	Citibank Europe plc, Germany Branch	337,961	(23,760)
2,909	Long	AUD	REA GROUP LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	356,483	9,190
768	Short	USD	EPAM SYSTEMS	Citibank Europe plc, Germany Branch	134,797	(9,853)
1,859	Long	EUR	NEMETSCHKE	Citibank Europe plc, Germany Branch	170,749	4,090
4,638	Long	EUR	HUGO BOSS AG	Citibank Europe plc, Germany Branch	193,729	(10,204)
2,218	Short	EUR	DR ING HCF PORSCHE AKTIENGESSELLSCH	Citibank Europe plc, Germany Branch	154,195	1,153
367	Long	USD	SERVICENOW INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	269,380	20,946
20,500	Short	JPY	NTT DATA GROUP CORPORATION	Citibank Europe plc, Germany Branch	280,862	(17,955)
778	Long	USD	WORKDAY INC -A-	Citibank Europe plc, Germany Branch	162,286	8,058
234	Long	EUR	ASML HOLDING NV - BEARER/REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	225,623	(1,217)
7,513	Long	USD	NORVERGIAN CRUISE LINE LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	131,718	13,179
1,819	Long	USD	ZOETIS INC -A-	Citibank Europe plc, Germany Branch	294,231	4,175
6,200	Short	JPY	SOCIONEXT INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	136,981	7,948
8,353	Short	DKK	TOPDANMARK AS	Citibank Europe plc, Germany Branch	411,968	(15,457)
2,920	Short	SEK	SAGAX -B-	Citibank Europe plc, Germany Branch	69,771	(2,110)
5,363	Long	EUR	KION GROUP AG - INHABER-AKT	Citibank Europe plc, Germany Branch	209,640	(6,543)
7,958	Short	EUR	OCI REG.SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	181,363	2,069
1,595	Short	CHF	CIE FINANCIERE RICHEMONT NAMEN AKT	Citibank Europe plc, Germany Branch	232,282	3,064
894	Long	USD	VEEVA SYSTEMS -A-	Citibank Europe plc, Germany Branch	152,658	2,719
26,600	Short	JPY	LIDA GROUP HOLDINGS CO LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	326,711	(2,469)
12,271	Short	GBP	PERSIMMON PLC	Citibank Europe plc, Germany Branch	195,676	10,131
326,506	Long	GBP	VODAFONE GROUP PLC	Citibank Europe plc, Germany Branch	268,645	(77)
1,307	Long	USD	PAYLOCITY HLDG	Citibank Europe plc, Germany Branch	160,791	(7,463)
6,104	Long	USD	SYNCHRONY FINANCIAL	Citibank Europe plc, Germany Branch	268,764	23,351
2,595	Long	USD	CATALENT	Citibank Europe plc, Germany Branch	136,148	2,470
66,000	Short	HKD	SINO LAND	Citibank Europe plc, Germany Branch	63,495	1,341
5,678	Long	EUR	ZALANDO SE	Citibank Europe plc, Germany Branch	124,291	(4,997)
4,500	Long	JPY	RECRUIT HOLDINGS CO LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	224,658	18,846
716	Long	USD	ELEVANCE HEALTH	Citibank Europe plc, Germany Branch	361,998	4,997
111,907	Long	AUD	MEDIBANK PRIVATE LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	260,103	(2,789)
5,423	Short	CAD	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	356,467	(4,696)
4,060	Short	EUR	KBC GROUPE SA/NV	Citibank Europe plc, Germany Branch	267,554	(1,218)
1,603	Short	USD	MEDTRONIC HLD	Citibank Europe plc, Germany Branch	117,725	1,855
5,301	Long	GBP	AUTO TRADER GROUP PLC	Citibank Europe plc, Germany Branch	50,093	(613)
8,040	Long	AUD	CAR GROUP LIMITED	Citibank Europe plc, Germany Branch	176,601	50
1,933	Long	USD	GODADDY -A-	Citibank Europe plc, Germany Branch	251,980	3,012
13,893	Short	DKK	TRYG A/S	Citibank Europe plc, Germany Branch	283,544	(6,148)
9,357	Short	EUR	SPIE SA	Citibank Europe plc, Germany Branch	316,079	(10,854)
83,218	Long	EUR	NOKIA OYJ	Citibank Europe plc, Germany Branch	296,131	11,734
33,618	Short	EUR	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	Citibank Europe plc, Germany Branch	327,776	(2,689)
8,782	Short	USD	THE KRAFT HEINZ	Citibank Europe plc, Germany Branch	264,013	5,736
2,205	Long	CAD	SHOPIFY -A- SUBORD VOTING	Citibank Europe plc, Germany Branch	135,934	(1,383)
2,245	Long	EUR	PUMA AG	Citibank Europe plc, Germany Branch	96,243	(4,827)
4,301	Short	EUR	AXA SA	Citibank Europe plc, Germany Branch	131,482	(2,538)
11,245	Long	EUR	FORVIA	Citibank Europe plc, Germany Branch	124,313	(11,189)



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Differenzkontrakte (Fortsetzung)

Candriam L Multi-Asset Premia (Fortsetzung)

Anzahl	Long- / Short-Position	Wahrung	Basiswert	Gegenpartei	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Nicht realisiert (in EUR)
949	Short	USD	ANSYS INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	284,678	5,069
1,956	Short	EUR	ESSILORLUXOTTICA SA	Citibank Europe plc, Germany Branch	393,547	9,780
1,626	Long	USD	ALPHABET INC -A-	Citibank Europe plc, Germany Branch	276,348	7,449
4,114	Short	EUR	REMY COINTREAU SA	Citibank Europe plc, Germany Branch	320,481	5,965
741	Long	EUR	L'OREAL SA	Citibank Europe plc, Germany Branch	303,847	(27,306)
14,600	Short	JPY	JP POST INSRAN CO	Citibank Europe plc, Germany Branch	264,305	(16,810)
1,890	Short	EUR	PERNOD RICARD SA	Citibank Europe plc, Germany Branch	239,463	8,694
4,644	Short	EUR	VINCI SA	Citibank Europe plc, Germany Branch	456,877	(372)
1,227	Long	EUR	SOPRA STERIA GROUP	Citibank Europe plc, Germany Branch	222,210	(6,871)
1,227	Long	USD	OKTA -A-	Citibank Europe plc, Germany Branch	107,170	4,385
6,417	Short	EUR	AMUNDI SA	Citibank Europe plc, Germany Branch	386,624	4,813
17,100	Long	JPY	WEST JAPAN RAILWAY COMPANY	Citibank Europe plc, Germany Branch	297,065	10,415
14,014	Short	EUR	GRIFOLS SA -A-	Citibank Europe plc, Germany Branch	110,150	18,022
1,010	Short	EUR	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	Citibank Europe plc, Germany Branch	154,833	18,887
773	Short	USD	CHARTER COMM -A-	Citibank Europe plc, Germany Branch	215,625	(9,383)
5,083	Long	DKK	DEMANT A/S	Citibank Europe plc, Germany Branch	205,434	(12,269)
12,455	Long	EUR	SIGNIFY NV - REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	290,202	249
5,152	Short	USD	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	Citibank Europe plc, Germany Branch	350,293	7,691
27,352	Long	EUR	VALEO SA	Citibank Europe plc, Germany Branch	271,824	5,142
4,469	Long	DKK	ORSTED - REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	222,088	(7,850)
2,288	Long	USD	TWILIO INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	121,279	7,002
4,800	Short	JPY	ORIENTAL LAND CO LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	124,788	(2,701)
4,123	Short	USD	CVS HEALTH	Citibank Europe plc, Germany Branch	227,203	7,809
1,765	Long	USD	STEEL DYNAMICS	Citibank Europe plc, Germany Branch	213,266	4,858
14,112	Long	EUR	GLANBIA PLC	Citibank Europe plc, Germany Branch	256,838	(9,032)
4,860	Short	EUR	ANHEUSER-BUSCH INBEV	Citibank Europe plc, Germany Branch	263,023	7,290
489,959	Long	EUR	BCP SHARES FROM REVERSE SPLIT	Citibank Europe plc, Germany Branch	164,920	1,911
92,837	Short	EUR	ITALGAS SPA PREFERENTIAL SHARE	Citibank Europe plc, Germany Branch	427,236	14,854
3,626	Long	USD	LAMB WESTON HOLDINGS INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	284,464	(10,251)
21,798	Short	EUR	MEDIOBANCA	Citibank Europe plc, Germany Branch	298,415	(1,526)
1,390	Short	EUR	SOITEC SA RGPT	Citibank Europe plc, Germany Branch	144,838	6,116
33,865	Short	NOK	NORSK HYDRO ASA	Citibank Europe plc, Germany Branch	197,347	(9,378)
10,753	Long	SEK	ESSITY AB REGISTERED -B-CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	257,125	(853)
58,500	Short	HKD	DELIVERY HERO	Citibank Europe plc, Germany Branch	308,314	(4,544)
4,869	Short	EUR	TELEFON ERICSSON	Citibank Europe plc, Germany Branch	107,848	26,877
39,227	Short	SEK	BIOMERIEUX SA	Citibank Europe plc, Germany Branch	227,413	(13,272)
3,540	Long	EUR	ROKU	Citibank Europe plc, Germany Branch	314,175	(7,257)
2,128	Short	USD	SEA -A- ADR REPR1 SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	118,993	(11,834)
1,824	Short	USD	AIB GRP - REGISTERED	Citibank Europe plc, Germany Branch	121,549	5,957
41,167	Long	EUR	AMBU AS - BEARER -B-	Citibank Europe plc, Germany Branch	203,200	1,729
9,143	Long	DKK	SAMSARA INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	164,287	(1,594)
5,910	Short	USD	SIEMENS HEALTHINEERS AG - REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	185,833	(29,888)
5,933	Short	EUR	DAY FORCE INC REGISTERED SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	319,195	(7,594)
4,954	Long	USD	DOCUSIGN INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	229,268	(1,941)
3,075	Long	USD	RIGHTMOVE -REGISTERED SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	153,499	7,087
49,893	Long	GBP	XERO	Citibank Europe plc, Germany Branch	316,006	(5,649)
2,934	Long	AUD	CAMECO CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	249,375	13,127
3,604	Long	CAD	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	Citibank Europe plc, Germany Branch	165,412	(7,569)
7,168	Long	CAD	SIG GROUP PREFERENTIAL SHARE	Citibank Europe plc, Germany Branch	317,942	(489)
16,812	Short	CHF	CENTRAL JAPAN RAILWAY CO	Citibank Europe plc, Germany Branch	287,168	(9,252)
3,000	Long	JPY	MODERNA INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	60,434	3,202
1,113	Short	USD	DELL TECHNOLOGIES INC -C- REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	123,321	19,887
1,886	Short	USD	ROGERS COMMUNICATIONS -B-NON VOTING	Citibank Europe plc, Germany Branch	242,686	7,250
5,845	Short	CAD	ROYAL BANK OF CANADA	Citibank Europe plc, Germany Branch	201,669	4,783
3,366	Short	CAD			334,293	(7,735)



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Differenzkontrakte (Fortsetzung)

Candriam L Multi-Asset Premia (Fortsetzung)

Anzahl	Long- / Short-Position	Wahrung	Basiswert	Gegenpartei	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Nicht realisiert (in EUR)
2,715	Short	CAD	TECK RESOURCES LTD -B-	Citibank Europe plc, Germany Branch	121,370	(19)
4,479	Long	CAD	TORONTO DOMINION BANK	Citibank Europe plc, Germany Branch	229,669	4,031
3,598	Long	EUR	UNIBAIL RODAMCO	Citibank Europe plc, Germany Branch	264,525	10,650
2,800	Short	JPY	OBIC	Citibank Europe plc, Germany Branch	336,841	(6,253)
23,940	Long	GBP	MELROSE IND --- REGISTERED SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	156,259	(6,946)
42,591	Short	USD	CFD AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	184,778	(608)
7,437	Short	SEK	AVANZA BANK HLD --- REGISTERED SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	168,725	4,521
10,416	Long	GBP	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	Citibank Europe plc, Germany Branch	303,936	(2,088)
78,720	Long	AUD	TELSTRA CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	177,571	3,434
90,700	Short	JPY	LY CORPORATION	Citibank Europe plc, Germany Branch	204,599	(12,784)
1,789	Long	USD	FUTU HOLDINGS - ADR	Citibank Europe plc, Germany Branch	109,510	(5,751)
9,487	Short	USD	KENVUE INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	160,927	5,400
4,763	Short	USD	DYNATRACE INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	198,831	2,978
75,695	Short	AUD	PILBARA MINERALS LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	144,805	3,302
8,946	Short	USD	BANK OF AMERICA CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	331,964	(2,170)
174,880	Long	GBP	M AND G REGISTERED SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	420,776	6,394
8,000	Short	JPY	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	263,338	(2,088)
17,400	Long	JPY	BROTHER INDUSTRIES	Citibank Europe plc, Germany Branch	285,725	5,400
27,400	Short	JPY	CHIBA BANK	Citibank Europe plc, Germany Branch	227,589	(11,523)
17,200	Long	JPY	CANON INC - REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	434,386	(499)
23,000	Long	JPY	FUJITSU LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	335,791	18,744
22,700	Short	JPY	ISUZU MOTORS LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	280,587	(20,014)
31,700	Long	JPY	PANASONIC HOLDINGS CORPORATION - REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	242,161	10,665
800	Short	JPY	KEYENCE CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	327,375	(12,807)
19,700	Short	JPY	MURATA MANUFACTURING CO LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	379,598	(9,599)
8,200	Short	JPY	NITERRA CO.,LTD.	Citibank Europe plc, Germany Branch	222,121	(2,854)
3,100	Long	JPY	NEC CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	238,162	16,183
41,600	Short	JPY	NIPPON PAINT HOLDINGS CO LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	252,879	(1,206)
18,800	Long	JPY	ROHM CO LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	234,452	2,890
57,200	Long	JPY	NOMURA HOLDINGS INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	305,904	7,963
16,400	Short	JPY	RINNAI CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	348,164	6,183
21,600	Long	JPY	ONO PHARMACEUTICAL CO LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	275,197	6,766
18,000	Long	JPY	SANWA HOLDING CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	307,114	9,449
7,000	Long	JPY	SHINOBI CO LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	254,864	5,278
16,200	Short	JPY	SHIMADZU CORPORATION	Citibank Europe plc, Germany Branch	378,216	(10,148)
25,800	Short	JPY	SUZUKI MOTOR CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	277,003	(9,503)
12,600	Short	JPY	TAKEDA PHARMACEUTICAL	Citibank Europe plc, Germany Branch	304,911	(365)
2,400	Short	JPY	TOKYO SEIMITSU	Citibank Europe plc, Germany Branch	171,158	(6,543)
33,400	Short	JPY	ASTELLAS PHARMA	Citibank Europe plc, Germany Branch	308,036	(15,596)
397,000	Short	JPY	NIPPON TELEGRAPH AND TELEPHONE-REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	349,559	(15,889)
400	Short	JPY	DISCO CO LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	141,623	6,589
8,440	Short	USD	EQUITABLE HOLDINGS INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	321,771	(6,536)
2,100	Short	JPY	NITORI	Citibank Europe plc, Germany Branch	206,953	(2,802)
1,962	Short	USD	VERTIV HOLDINGS CO-A	Citibank Europe plc, Germany Branch	158,479	5,455
1,123	Short	USD	AON PREFERENTIAL SHARE	Citibank Europe plc, Germany Branch	307,619	6,737
15,441	Short	AUD	AMPOL - REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	311,168	1,155
4,500	Short	JPY	SCSK CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	83,865	(3,785)
4,500	Short	JPY	ORACLE CORP JAPAN	Citibank Europe plc, Germany Branch	289,730	16,966
5,529	Long	EUR	VALLOUREC - SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	80,972	(636)
3,165	Short	CHF	BC VAUDOISE - REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	313,361	1,808
137,100	Short	USD	CFD SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	Citibank Europe plc, Germany Branch	408,704	(10,339)
2,242	Short	USD	EXXON MOBIL CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	240,820	(14,141)
3,680	Short	USD	DEVON ENERGY CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	162,754	(5,631)
5,735	Short	USD	CAESARS ENTERTAINMENT - REGISTERED SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	212,651	(19,371)
7,453	Long	CAD	BROOKFIELD RENEWABLE COR W/I	Citibank Europe plc, Germany Branch	196,978	(7,775)



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Differenzkontrakte (Fortsetzung)

Candriam L Multi-Asset Premia (Fortsetzung)

Anzahl	Long- / Short-Position	Wahrung	Basiswert	Gegenpartei	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Nicht realisiert (in EUR)
1,380	Long	CAD	THOMSON REUTERS COR	Citibank Europe plc, Germany Branch	217,000	1,045
258	Long	USD	METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	Citibank Europe plc, Germany Branch	336,439	(12,077)
4,770	Long	USD	CRH PLC	Citibank Europe plc, Germany Branch	333,711	(16,645)
4,533	Short	USD	BENTLEY SYSTEMS --- REGISTERED SHS -B-	Citibank Europe plc, Germany Branch	208,770	8,078
5,584	Short	EUR	SIEMENS ENERGY - REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	135,747	(5,752)
13,114	Short	GBP	VISTRY GROUP PLC	Citibank Europe plc, Germany Branch	182,979	5,104
10,039	Short	SEK	LAGERCANTZ GRP - REGISTERED SHS -B-	Citibank Europe plc, Germany Branch	152,310	7,607
21,332	Short	AUD	REECE LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	334,575	5,184
48,717	Short	GBP	BP PLC	Citibank Europe plc, Germany Branch	273,047	(8,360)
1,013	Short	USD	CHORD ENERGY CORPORATION	Citibank Europe plc, Germany Branch	158,488	(4,716)
13,335	Short	SEK	NORDNET AB PUBL	Citibank Europe plc, Germany Branch	260,121	(1,175)
567	Short	USD	VERISIGN INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	94,064	259
1,395	Long	USD	AIRBNB INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	197,363	2,772
13,332	Long	USD	HOST HOTELS RESORT	Citibank Europe plc, Germany Branch	223,662	249
13,467	Long	EUR	STELLANTIS NV-BEARER AND REGISTERED SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	248,735	(6,922)
10,824	Long	EUR	INPOST SA	Citibank Europe plc, Germany Branch	178,163	(3,355)
3,633	Short	USD	ROBLOX CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	126,134	(4,441)
229	Short	USD	TEXAS PACIFIC LAND TRUST	Citibank Europe plc, Germany Branch	156,891	5,500
14,322	Short	SEK	BEIJER REF - REG SHS -B-	Citibank Europe plc, Germany Branch	206,313	0
30,415	Short	EUR	ALLFUNDS GROUP PLC	Citibank Europe plc, Germany Branch	159,375	(1,217)
7,714	Long	DKK	VESTAS WIND SYSTEMS AS - BEARER/ REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	166,797	(14,430)
26,867	Short	SEK	HEXAGON - REG SHS -B-	Citibank Europe plc, Germany Branch	283,228	(8,167)
3,815	Long	USD	LIBERTY MEDI CORP-LIBERTY-C	Citibank Europe plc, Germany Branch	255,722	(2,954)
117,572	Short	AUD	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	Citibank Europe plc, Germany Branch	369,977	3,663
2,301	Long	USD	AKAMAI TECHNOLOGIES	Citibank Europe plc, Germany Branch	193,398	2,083
3,450	Short	EUR	AZELIS GROUP NV	Citibank Europe plc, Germany Branch	57,822	6,348
7,893	Short	USD	TOAST INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	189,786	(23,346)
350	Long	USD	ADOBE INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	181,422	12,018
968	Long	USD	ADVANCED MICRO DEVICES INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	146,507	3,441
113	Long	DKK	A.P. MOELLER-MAERSK A/S -B-	Citibank Europe plc, Germany Branch	183,423	6,288
581	Long	USD	PALO ALTO NETWORKS	Citibank Europe plc, Germany Branch	183,779	10,528
1,561	Long	USD	APPLE INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	306,767	(8,812)
1,020	Long	USD	APPLIED MATERIALS INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	224,595	(6,538)
1,349	Long	USD	AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	300,436	(7,892)
6,708	Short	USD	BAXTER INTERNATIONAL INC - REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	209,361	2,879
1,841	Short	USD	BECTON DICKINSON - REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	401,456	(1,649)
8,100	Long	JPY	MITSUI OSK LINES LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	226,366	(1,503)
316	Short	USD	CAMPBELL SOUP CO	Citibank Europe plc, Germany Branch	13,324	(83)
918	Long	USD	CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	263,601	(12,274)
2,425	Long	EUR	AURUBIS	Citibank Europe plc, Germany Branch	177,631	3,031
2,396	Long	USD	APOLLO GLB MGMT --- REGISTERED SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	263,957	3,979
27,254	Long	SEK	FORTNOX AB	Citibank Europe plc, Germany Branch	153,631	(816)
1,316	Long	USD	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS -A-	Citibank Europe plc, Germany Branch	83,497	3,045
1,052	Long	USD	CONSTELLATION ENERGY	Citibank Europe plc, Germany Branch	196,579	(11,533)
52	Short	USD	EQUIFAX INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	11,764	(165)
4,345	Short	USD	FMC CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	233,314	(6,487)
14,524	Short	USD	FRANKLIN RESOURCES INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	302,880	(2,575)
3,014	Long	USD	HOLLYFRONTIER SHARES	Citibank Europe plc, Germany Branch	150,004	2,728
402	Long	USD	WASTE MANAGEMENT	Citibank Europe plc, Germany Branch	80,021	2,611
162,100	Long	USD	CFD CAPITALAND INVESTMENT LIMITED	Citibank Europe plc, Germany Branch	296,858	(853)
19,367	Short	USD	WARNER BROS DISCOVERY INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	134,444	(5,060)
699	Long	USD	IDEXX LABS CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	317,754	(11,172)
1,953	Short	USD	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES-REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	315,159	(6,287)



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Differenzkontrakte (Fortsetzung)

Candriam L Multi-Asset Premia (Fortsetzung)

Anzahl	Long- / Short- Position	Wahrung	Basiswert	Gegenpartei	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Nicht realisiert (in EUR)
338	Long	USD	KLA CORPORATION	Citibank Europe plc, Germany Branch	260,027	(7,686)
8,250	Short	EUR	SAMPO OYJ-A SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	330,825	(10,643)
154,931	Long	USD	CFD SPARK NEW ZEALAND LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	366,471	(8,790)
1,863	Long	USD	MICRON TECHNOLOGY INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	228,636	(28,334)
925	Long	USD	MICROSOFT CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	385,751	(1,226)
5,582	Short	USD	NEWMONT CORPORATION - REG SHS	Citibank Europe plc, Germany Branch	218,072	(5,000)
3,814	Short	USD	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	224,303	(10,071)
1,978	Short	USD	ORACLE CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	260,596	203
1,058	Short	USD	ROPER TECHNOLOGIES	Citibank Europe plc, Germany Branch	556,429	(9,941)
9,722	Short	USD	PFIZER INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	253,811	(9,071)
16,482	Short	USD	CFD FISCHER AND PAYKEL INDUSTRIES LTD	Citibank Europe plc, Germany Branch	281,900	4,689
1,451	Long	USD	PROGRESSIVE CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	281,210	(718)
4,636	Long	USD	ROBERT HALF INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	276,754	0
3,007	Short	USD	CHARLES SCHWAB CORP/THE	Citibank Europe plc, Germany Branch	206,751	(2,469)
183	Short	USD	GRAIL INC-WI	Citibank Europe plc, Germany Branch	2,624	(2,624)
1,479	Short	USD	TELEFLEX INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	290,252	(6,293)
2,690	Long	EUR	ACCIONA SA	Citibank Europe plc, Germany Branch	296,707	(2,690)
602	Long	USD	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	Citibank Europe plc, Germany Branch	263,279	(2,792)
2,468	Long	USD	WESTERN DIGITAL CORP	Citibank Europe plc, Germany Branch	174,481	(9,418)
610	Long	USD	WILLIAMS-SONOMA	Citibank Europe plc, Germany Branch	160,714	(12,960)
906	Short	USD	ZEBRA TECHNOLOGIES -A-	Citibank Europe plc, Germany Branch	261,153	(5,520)
2,376	Short	EUR	ALTEN SA	Citibank Europe plc, Germany Branch	243,540	14,969
1	Long	USD	BROADCOM INC - REGISTERED SHS	J.P. Morgan SE	1,498	265
1	Long	AUD	BLUESCOPE STEEL	UBS Europe SE Frankfurt	13	0
1	Long	NZD	SPARK NEW	UBS Europe SE Frankfurt	2	0
500	Long	HKD	BOC HONG KONG (HOLDINGS) LTD	UBS Europe SE Frankfurt	1,437	(11)
100	Long	JPY	OJI HOLDINGS	UBS Europe SE Frankfurt	368	5
100	Long	SGD	CAPITALAND INV --- REGISTERED SHS	UBS Europe SE Frankfurt	183	0
1	Short	USD	PALO ALTO NETWORKS	J.P. Morgan SE	316	(42)
						(215,157)

Siehe Anhangangabe 10 zu den Barmitteln beim Broker im Zusammenhang mit CFD-Vertragen.



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Credit Default Swaps („CDS“)

Zum 30. Juni 2024 waren die offenen Credit Default Swaps wie folgt:

Candriam L Multi-Asset Premia

Bezeichnung / Basiswert	Gegenpartei	Nennwert	Fälligkeit	Währung	Kauf-/Verkauf- absicherung	Spread	Nicht realisiert (in EUR)
ITRAXX XOVER S38 V2 MKT	BNP Paribas Paris	2,959,980	20/12/2027	EUR	Verkauf	0.05	236,673
							236,673

Einzelheiten zu Sicherheiten finden Sie in Anhangangabe 10 im Abschnitt „Sonstige Erläuterungen zum Abschluss“.



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 1 – Allgemeines

Candriam L (nachstehend die „SICAV“) ist eine offene Investmentgesellschaft nach luxemburgischem Recht. Sie wurde am 17. Dezember 2013 in Luxemburg gemäß der Gesetzgebung des Großherzogtums Luxemburg auf unbegrenzte Zeit gegründet. Die SICAV unterliegt den Bestimmungen des Gesetzes vom 10. August 1915 in aktueller Fassung über Handelsgesellschaften (nachstehend das „Gesetz vom 10. August 1915“), sofern sie nicht durch dieses Gesetz davon befreit ist.

Ihr Mindestkapital beträgt 1.250.000 EUR.

Die SICAV unterliegt dem Teil I des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen („OGA“) in seiner geänderten Fassung.

Zurzeit stehen den Anlegern folgende Teilfonds zur Verfügung:

<u>Teilfonds</u>	<u>Referenzwährung</u>
Candriam L Balanced Asset Allocation	EUR
Candriam L Conservative Asset Allocation	EUR
Candriam L Dynamic Asset Allocation	EUR
Candriam L Multi-Asset Income	EUR
Candriam L Multi-Asset Income & Growth	EUR
Candriam L Multi-Asset Premia	EUR

Die SICAV ist ein Umbrella-Fonds, d. h. sie setzt sich aus mehreren Teilfonds zusammen, von denen jeder eine spezifische Sammlung von Vermögenswerten und Verbindlichkeiten darstellt und einer eigenen Anlagepolitik entspricht.

Die aus mehreren Teilfonds bestehende Struktur bietet Anlegern nicht nur den Vorteil, zwischen verschiedenen Teilfonds wählen zu können, sondern auch von einem Teilfonds in einen anderen wechseln zu können, sofern dies zulässig ist. In jedem Teilfonds kann die SICAV Namensanteile in verschiedenen Kategorien mit unterschiedlichen Rechten und Provisionen oder Ausschüttungsregeln ausgeben.

Die Anteile sind nur als Namensanteile erhältlich. Folgende Anteilsklassen wurden aufgelegt:

- Die **Anteilsklasse C** wird natürlichen und juristischen Personen angeboten.
- Die **Anteilsklasse I** ist ausschließlich institutionellen Anlegern vorbehalten.
- Die **Anteilsklasse N** ist Vertriebsstellen vorbehalten, die von der Verwaltungsgesellschaft eigens genehmigt wurden.
- Die **Anteilsklasse PI** ist institutionellen Anlegern vorbehalten, die Anteile des Teilfonds vor Erreichen einer kritischen Größe hinsichtlich des verwalteten Vermögens zeichnen. Bei Erstzeichnung gilt ein Mindestanlagebetrag in Höhe von 1.000.000 EUR bzw. für die auf eine Fremdwährung lautenden Anteilsklassen in Höhe des entsprechenden Gegenwerts in dieser Fremdwährung. Der Verwaltungsrat kann diesen Mindestbetrag unter Wahrung der Gleichbehandlung der Anteilinhaber an einem Bewertungstag nach eigenem Ermessen ändern. Diese Klasse kann gezeichnet werden bis zum Eintritt eines der folgenden Ereignisse:
 - (i) die vom Verwaltungsrat festgelegte Laufzeit ist abgelaufen;
 - (ii) der Teilfonds hat in Bezug auf das verwaltete Vermögen eine vom Verwaltungsrat bestimmte kritische Größe erreicht; oder
 - (iii) der Verwaltungsrat hat aus berechtigten Gründen beschlossen, diese Klasse für eine Zeichnung zu schließen.
 Der Verwaltungsrat kann die Klasse PI nach eigenem Ermessen ohne vorherige Mitteilung an die Anteilinhaber wieder eröffnen.
- Die **Anteilsklasse R**, die Finanzintermediären (einschließlich Vertreibern und Plattformen) vorbehalten ist, die:
 - die gesonderte Vereinbarungen mit ihren Kunden bezüglich der Bereitstellung von Wertpapierdienstleistungen hinsichtlich des Teilfonds geschlossen haben, und
 - denen es aufgrund der für sie geltenden Rechts- und Verwaltungsvorschriften oder aufgrund von Vereinbarungen mit ihren Kunden untersagt ist, für die Bereitstellung der oben genannten Wertpapierdienstleistungen von der Verwaltungsgesellschaft Gebühren, Provisionen oder sonstige finanzielle Vergünstigungen anzunehmen oder einzubehalten.
- Die **Anteilsklasse R2** ist folgenden Anlegern vorbehalten:
 - Vertriebsstellen und/oder Finanzintermediären, die von der Verwaltungsgesellschaft zugelassen wurden und die für Anlagen in dieser Anteilsklasse von keinem Unternehmen der Candriam-Gruppe eine Vergütung erhalten, wenn die Anlagen in den Anteilen letztlich im Rahmen eines Mandats erfolgen.
 - OGA, die von der Verwaltungsgesellschaft zugelassen wurden.
- Die **Anteilsklasse S** ist institutionellen Anlegern vorbehalten, die von der Verwaltungsgesellschaft eigens genehmigt wurden.
- Die **Anteilsklasse V** ist ausschließlich institutionellen Anlegern mit einer Mindesterstzeichnung von 15.000.000 EUR vorbehalten. Der Verwaltungsrat kann diesen Mindestbetrag nach eigenem Ermessen anpassen, sofern alle Anteilinhaber an einem bestimmten Bewertungstag gleich behandelt werden.
- Die **Anteilsklasse Z** ist folgenden Anlegern vorbehalten:
 - institutionelle oder professionelle Anleger, die von der Verwaltungsgesellschaft zugelassen wurden. Die Portfolioverwaltungstätigkeit für diese Anteilsklasse wird direkt über einen mit dem Anleger geschlossenen Verwaltungsvertrag vergütet. Daher wird auf die Vermögenswerte dieser Anteilsklasse keine Portfolioverwaltungsgebühr erhoben.
 - OGA, die von der Verwaltungsgesellschaft zugelassen wurden und von einem Unternehmen der Candriam-Gruppe verwaltet werden.



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 1 – Allgemeines (Fortsetzung)

Die Vermögenswerte der verschiedenen Klassen werden zu einer einzigen Einheit zusammengefasst.

Die SICAV ist bestrebt, den Aktionären über die verfügbaren Teilfonds ein ideales Anlageinstrument zur Verfügung zu stellen, das unter Berücksichtigung des Risikos, das der Anleger zu akzeptieren bereit ist, ein bestimmtes Verwaltungsziel verfolgt.

Darüber hinaus kann für die Anteilsklassen ein Verfahren zur Währungsabsicherung angewandt werden:

- **Basiswährungsgesicherte Anteilsklassen:**
Ziel dieser abgesicherten Anteilsklassen ist es, die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Basiswährung des Teilfonds und der Währung, auf die die jeweilige abgesicherte Anteilsklasse lautet, zu verringern.
Mit dieser Art der Absicherung soll erreicht werden, dass sich die Performance der abgesicherten Anteilsklasse auf angemessener Grundlage (d. h. um die Zinsdifferenz zwischen den beiden Währungen bereinigt) mit der Performance einer Anteilsklasse, die auf die Basiswährung des Teilfonds lautet, vergleichen lässt. Diese Absicherungsart wird in der Bezeichnung der Anteilsklasse durch Hinzufügung des Suffixes H gekennzeichnet.
- **Anteilsklassen mit Absicherung gegenüber den Währungen der Vermögenswerte**
Ziel dieser abgesicherten Anteilsklassen ist es, die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen den Währungen, auf die die Vermögenswerte des Teilfonds lauten, und der Währung, auf die die jeweilige abgesicherte Anteilsklasse lautet, zu verringern. Diese Absicherungsart wird in der Bezeichnung der Anteilsklasse durch Hinzufügung des Suffixes AH gekennzeichnet.

Die ausgegebenen Anteile werden im Abschnitt „Statistik“ zu den einzelnen Teilfonds ausführlich beschrieben.

Anhangangabe 2 – Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze

Der Abschluss der SICAV wurde in Übereinstimmung mit den luxemburgischen Vorschriften für Organismen für gemeinsame Anlagen erstellt. Aufgrund von Rundungsregeln können in einigen Summen oder Zwischensummen des Abschlusses geringfügige Abweichungen auftreten.

Dieser Jahresbericht wurde auf der Grundlage der letzten inoffiziellen technischen Nettoinventarwerte erstellt, die für den Jahresabschluss zum 30. Juni 2024 berechnet wurden.

Der Nettoinventarwert der Teilfonds wurde zum 1. Juli 2024 basierend auf den zuletzt bekannten Preisen zum Bewertungszeitpunkt berechnet.

a) Bewertung des Portfolios der einzelnen Teilfonds

Die Bewertung eines Wertpapiers, das zum Handel an einer amtlichen Notierung oder an einem anderen geregelten Markt mit ordnungsgemäßer Funktionsweise, der anerkannt und für das Publikum offen ist, zugelassen ist, erfolgt auf der Grundlage des letzten in Luxemburg am Bewertungstag bekannten Kurses oder, wenn diese Aktie an mehreren Märkten gehandelt wird, auf der Grundlage des letzten bekannten Kurses an dem Hauptmarkt, an dem sie gehandelt wird. Ist der letzte bekannte Preis nicht repräsentativ, erfolgt die Bewertung auf der Grundlage des wahrscheinlichen Veräußerungswerts, der vom Verwaltungsrat nach bestem Wissen und Gewissen geschätzt wird. Wertpapiere, die weder an einer Börse noch an einem anderen geregelten Markt, der anerkannt und für das Publikum offen ist, notiert sind oder gehandelt werden, werden auf der Grundlage des wahrscheinlichen Veräußerungswerts bewertet, der mit der gebotenen Vorsicht und in gutem Glauben geschätzt wird. Alle anderen Vermögenswerte werden von den Geschäftsführern auf der Grundlage des wahrscheinlichen Veräußerungswerts bewertet, der nach Treu und Glauben und nach allgemein anerkannten Grundsätzen und Verfahren geschätzt werden muss.

b) Realisierte Nettogewinne oder -verluste aus dem Verkauf von Kapitalanlagen

Die realisierten Gewinne oder Verluste aus Wertpapierverkäufen in jedem Teilfonds werden auf der Grundlage der durchschnittlichen Kosten der verkauften Wertpapiere berechnet.

c) Umrechnung von Fremdwährungen

Die in einer anderen Währung als der Referenzwährung der einzelnen Teilfonds ausgedrückten Werte werden zu dem am Abschlussdatum geltenden Wechselkurs in diese Währung umgerechnet.

Erträge und Aufwendungen, die auf eine andere Währung als die Referenzwährung des jeweiligen Teilfonds lauten, werden zu den am Transaktionsdatum geltenden Wechselkursen in die jeweilige Währung umgerechnet.

Die Erwerbskosten von Wertpapieren der einzelnen Teilfonds, die auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lauten, werden zu den am Tag des Erwerbs geltenden Wechselkursen in diese Währung umgerechnet.

Zum 30. Juni 2024 verwendete Wechselkurse:

1 EUR =	1.604800	AUD	1 EUR =	0.847850	GBP	1 EUR =	11.411500	NOK	1 EUR =	1.071750	USD
1 EUR =	1.466550	CAD	1 EUR =	8.367600	HKD	1 EUR =	1.758850	NZD			
1 EUR =	0.963050	CHF	1 EUR =	172.401700	JPY	1 EUR =	11.350000	SEK			
1 EUR =	7.457450	DKK	1 EUR =	1475.263900	KRW	1 EUR =	1.452500	SGD			

d) Kombinierte Abschlüsse der SICAV

Die kombinierte Aufstellung des Nettovermögens der SICAV und die kombinierte Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens, die in EUR ausgedrückt sind, sind die Summe der Aufstellung des Nettovermögens und der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens jedes Teilfonds, umgerechnet in die Währung der SICAV unter Verwendung der am Abschlussdatum geltenden Wechselkurse.

Die von bestimmten Teilfonds der SICAV in anderen Teilfonds der SICAV getätigten Anlagen wurden in der kombinierten Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2024 nicht herausgerechnet. Zum 30. Juni 2024 belief sich der Gesamtbetrag der SICAV-internen Anlagen auf EUR 20.772.239,00. Dies bedeutet, dass sich das Gesamtvermögen am Bilanzstichtag auf insgesamt EUR 889.101.581,00 belaufen hätte, wenn man diese innerhalb der SICAV erfolgten Anlagevorgänge nicht berücksichtigt hätte.



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 2 – Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

Teilfonds	SICAV-interne Anlagen	Betrag (EUR)
Candriam L Balanced Asset Allocation	CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME & GROWTH Z C	2,700,622
Candriam L Balanced Asset Allocation	CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME Z C	3,982,630
Candriam L Balanced Asset Allocation	CANDRIAM L MULTI-ASSET PREMIA Z C	668,752
Candriam L Conservative Asset Allocation	CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME & GROWTH Z C	4,828,340
Candriam L Conservative Asset Allocation	CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME Z C	7,090,993
Candriam L Conservative Asset Allocation	CANDRIAM L MULTI-ASSET PREMIA Z C	1,194,693
Candriam L Dynamic Asset Allocation	CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME & GROWTH Z C	111,704
Candriam L Dynamic Asset Allocation	CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME Z C	163,404
Candriam L Dynamic Asset Allocation	CANDRIAM L MULTI-ASSET PREMIA Z C	31,101

e) Bewertung von Optionen und Futures

Die Bewertung von Optionen und Futures, die an einer amtlichen Notierung oder einem sonstigen geregelten Markt zugelassen sind, erfolgt auf der Grundlage des letzten bekannten Kurses oder, wenn die Option an mehreren Märkten gehandelt wird, auf der Grundlage des letzten bekannten Kurses an dem Markt, an dem der Vertrag von der SICAV abgeschlossen wurde.

Optionen und Futures, die nicht an einer Börse oder einem sonstigen geregelten Markt gehandelt werden, werden zu ihrem wahrscheinlichen Marktwert bewertet, der konservativ und in gutem Glauben geschätzt wird. Der Marktwert der Optionen ist in der Aufstellung des Nettovermögens unter der Rubrik „Optionen (Long-Position) / (Short-Position) zum Marktwert“ enthalten.

Die realisierten Gewinne / (Verluste) und die Veränderung der nicht realisierten Wertsteigerungen / Abschreibungen auf Optionen werden in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter den Überschriften „Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Optionen“ und „Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung / -abschreibung aus Optionen“ ausgewiesen.

Der nicht realisierte Wertzuwachs / (Wertverlust) von Terminkontrakten wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Wertzuwachs / (Wertverlust) von Terminkontrakten (netto)“ ausgewiesen. Veränderungen am Marktwert von offenen Futures werden als nicht realisierte Gewinne/Verluste in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Veränderung bei nicht realisierten Gewinnen/Verlusten aus Futures“ erfasst.

Realisierte Gewinne oder Verluste, die der Differenz zwischen dem Wert des Kontrakts zum Zeitpunkt seiner Eröffnung und dem Wert zum Zeitpunkt seiner Schließung entsprechen, werden bei der Schließung oder dem Verfall von Futures-Kontrakten in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures“ ausgewiesen.

Einzelheiten zu ausstehenden Optionen und Finanzterminkontrakten finden Sie ggf. im Abschnitt „Anhang zum Jahresabschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente“.

f) Bewertung von Devisenterminkontrakten

Die Devisenterminkontrakte werden auf der Grundlage der am Abschlussdatum geltenden Devisenterminkurse bewertet, die für den verbleibenden Zeitraum bis zum Verfallsdatum gelten. Der nicht realisierte Gewinn/(Verlust) aus Devisenterminkontrakten wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) aus Devisenterminkontrakten“ ausgewiesen.

Die daraus resultierenden realisierten Gewinne / (Verluste) und die Veränderung der nicht realisierten Wertsteigerung / Wertminderung sind in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Devisenterminkontrakten“ bzw. „Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/-verlusts aus Devisenterminkontrakten“ enthalten.

Einzelheiten zu Devisenterminkontrakten finden Sie ggf. im Abschnitt „Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente“.

g) Bewertung von Differenzkontrakten („CFD“)

CFD werden zum angemessenen Wert auf der Grundlage der letzten bekannten Spread- und Zinskurven bzw. des letzten bekannten Schlusskurses des Basiswerts bewertet.

Die nicht realisierte Wertsteigerung / (Wertminderung) aus CFD wird in der Nettovermögensaufstellung unter der Rubrik „Nicht realisierter Gewinn / (Verlust) aus CFD“ erfasst. Realisierte Gewinne / (Verluste) und die sich hieraus ergebende Veränderung der nicht realisierten Wertsteigerungen / Wertminderungen werden in der Gewinn- und Verlustrechnung bzw. in der Aufstellung über die Veränderung des Nettovermögens in der Rubrik „Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus CFD“ sowie der Rubrik „Veränderung des nicht realisierten Gewinns / Verlusts aus CFD“ erfasst.

Einzelheiten zu ausstehenden CFD finden Sie ggf. im Abschnitt „Anhang zum Abschluss - Aufstellung der derivativen Instrumente“.

h) Bewertung von Kreditausfallkontrakten („CDS“)

Die Ermittlung des Werts eines "Credit Default Swaps" erfolgt über eine Gegenüberstellung der abgezinsten künftigen Prämienströme, die durch den Käufer der Sicherheit bezahlt werden, und des aktuellen Werts der erwarteten Verluste des Referenzobjekts im Falle von Kreditereignissen, die im Swapvertrag definiert sind. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus Credit Default Swaps werden in der Nettovermögensaufstellung in der Rubrik „Nicht realisierter Gewinn / (Verlust) aus Swaps“ erfasst.

Realisierte Gewinne / (Verluste) und die sich daraus ergebende Veränderung der nicht realisierten Wertsteigerungen / Wertminderungen werden in der Gewinn- und Verlustrechnung bzw. in der Aufstellung über die Veränderung des Nettovermögens in der Rubrik „Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Swaps“ sowie der Rubrik „Veränderung der nicht realisierten Gewinne / Verluste aus Swaps“ erfasst.

Einzelheiten zu ausstehenden Credit Default Swaps finden Sie ggf. im Abschnitt „Anhang zum Jahresabschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente“.



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 2 – Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

i) Bewertung von Total Return Swaps-Kontrakten („TRS“)

Die tägliche marktnahe Bewertung (Mark-to-market) der Total Return Swaps erfolgt unter Bezugnahme auf den Marktwert des jeweils zugrundeliegenden Vermögenswertes. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus Total Return Swaps werden in der Nettovermögensaufstellung in der Rubrik „Nicht realisierter Gewinn / (Verlust) aus Swaps“ erfasst.

Realisierte Gewinne / (Verluste) und die sich daraus ergebende Veränderung der nicht realisierten Wertsteigerungen / Wertminderungen werden in der Gewinn- und Verlustrechnung bzw. in der Aufstellung über die Veränderung des Nettovermögens in der Rubrik „Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Swaps“ sowie der Rubrik „Veränderung der nicht realisierten Gewinne / Verluste aus Swaps“ erfasst.

Nähere Angaben zu den ausstehenden Total Return Swaps finden Sie gegebenenfalls im Abschnitt „Erläuterungen zum Jahresabschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente“.

j) Pensionsgeschäfte

Ein umgekehrtes Pensionsgeschäft ist eine Vereinbarung, bei der die SICAV gegen Zahlung eines Betrags übertragbare Wertpapiere von einer Gegenpartei erhält (kauft), die sich verpflichtet, diese zu einem Preis und innerhalb einer Frist zurückzukaufen, die zwischen den beiden Parteien bei Abschluss der Vereinbarung festgelegt werden. In seinen Auswirkungen ähnelt ein umgekehrtes Pensionsgeschäft einem Darlehen der SICAV an die Gegenpartei, das durch übertragbare Wertpapiere gesichert ist. Die SICAV verbucht das Pensionsgeschäft wie ein Darlehen und weist es in der Nettovermögensaufstellung unter der Rubrik „Forderungen aus umgekehrten Pensionsgeschäften / Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften“ aus. Zinsforderungen / Zinsverpflichtungen (im Falle negativer Zinsen) aus dieser Transaktion werden unter der Position sonstige Vermögenswerte/sonstige Verbindlichkeiten in der Vermögensaufstellung ausgewiesen. Ein umgekehrtes Pensionsgeschäft ist im Allgemeinen nur von kurzer Dauer und nicht übertragbar. Die SICAV bewertet diese Art von Vereinbarung zu Anschaffungskosten, was in Verbindung mit Stückzinsen eine Annäherung an den Wert darstellt, zu dem die Wertpapiere von der Gegenpartei zurückgekauft werden. Die erhaltenen oder gezahlten Zinsen (im Falle negativer Zinssätze) werden in der Entwicklung des Nettovermögens unter dem Posten „Zinsen aus umgekehrten Pensionsgeschäften“ ausgewiesen.

k) Transaktionskosten

In der am 30. Juni 2024 endenden Periode fielen für die SICAV beim Kauf und Verkauf von Wertpapieren, Geldmarktinstrumenten, sonstigen zulässigen Anlagen und Derivaten Transaktionskosten und Maklergebühren an. Diese Kosten werden in der Übersicht über die Entwicklung des Nettovermögens unter der Überschrift „Transaktionskosten“ ausgewiesen.

l) Erträge

Zinserträge laufen gemäß den Bedingungen der zugrunde liegenden Anlage auf. Erträge werden nach Abzug einer etwaigen Quellensteuer erfasst. Dividenden werden auf EX-Datumsbasis ausgewiesen.

m) In Anlageportfolios verwendete Abkürzungen

A: Jährliche
 FL.R: Variabel verzinsliche Anleihen
 Q: Vierteljährlich
 S: Halbjährlich
 XX: Anleihen ohne festgelegte Laufzeit
 ZCP oder U: Null-Coupon

Anhangangabe 3 – Verwaltungsgebühren

Candriam (nachstehend die „Verwaltungsgesellschaft“), eine Kommanditgesellschaft auf Aktien mit Sitz in SERENITY – Bloc B 19-21, Route d'Arlon, L-8009 Strassen, wurde von der SICAV aufgrund eines zwischen der SICAV und der Verwaltungsgesellschaft geschlossenen Vertrags zur Verwaltungsgesellschaft der SICAV bestellt.

Candriam wurde am 10. Juli 1991 in Luxemburg gegründet. Sie nahm ihre Verwaltungstätigkeit am 1. Februar 1999 auf. Sie ist eine Tochtergesellschaft der Candriam Group (vormals New York Life Investment Management Global Holdings S.à r.l.), einem Unternehmen der New York Life Insurance Company Group.

Sie ist als Verwaltungsgesellschaft gemäß Kapitel 15 des Gesetzes von 2010 über OGAW zugelassen und darf die Tätigkeiten der gemeinsamen Portfolioverwaltung, der Verwaltung von Anlageportfolios und der Erbringung von Anlageberatungsdienstleistungen ausüben.

Die Funktion der Portfolioverwaltung wird direkt von Candriam und/oder von einer oder mehrerer ihrer Niederlassungen sichergestellt: Candriam-Belgian Branch, Candriam – Succursale française, Candriam – UK Establishment.



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 3 – Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

Der zum 30. Juni 2024 geltende Satz der Verwaltungsgebühren:

Teilfonds	Anteilsklasse	Anteilsart	ISIN	Verwaltungsgebühr
Candriam L Balanced Asset Allocation	C	Thesaurierung	LU0982874694	1.25%
	C	Ausschüttung	LU0982874777	1.25%
	I	Thesaurierung	LU0982874850	0.45%
	I	Ausschüttung	LU1207304871	0.45%
	R2	Thesaurierung	LU1427870321	0.31%
	R2	Ausschüttung	LU1427870594	0.31%
	V	Thesaurierung	LU0982874934	0.30%
Candriam L Conservative Asset Allocation	Z	Thesaurierung	LU0982875071	0.00%
	C	Thesaurierung	LU0982875154	1.20%
	I	Thesaurierung	LU0982875311	0.40%
	I	Ausschüttung	LU1207304798	0.40%
	R2	Thesaurierung	LU1427870164	0.30%
	R2	Ausschüttung	LU1427870248	0.30%
	V	Thesaurierung	LU0982875402	0.25%
Candriam L Dynamic Asset Allocation	Z	Thesaurierung	LU0982875584	0.00%
	C	Thesaurierung	LU0982876806	1.30%
	C	Ausschüttung	LU0982876988	1.30%
	I	Thesaurierung	LU0982877101	0.50%
	R	Thesaurierung	LU1427870677	0.70%
	V	Thesaurierung	LU0982877283	0.35%
	Z	Thesaurierung	LU0982877366	0.00%
Candriam L Multi-Asset Income	C	Thesaurierung	LU0982876392	1.10%
	C	Ausschüttung	LU0982876475	1.10%
	C (q)	Ausschüttung	LU1236612575	1.10%
	I	Thesaurierung	LU0982876558	0.40%
	R	Thesaurierung	LU1427871139	0.55%
	R2	Thesaurierung	LU1427871303	0.27%
	R2	Ausschüttung	LU1427871485	0.27%
	V	Thesaurierung	LU0982876632	0.28%
	V (q)	Ausschüttung	LU1207305092	0.28%
	Z	Thesaurierung	LU0982876715	0.00%
	Z (q)	Ausschüttung	LU1207305175	0.00%
Candriam L Multi-Asset Income & Growth	C	Thesaurierung	LU1207305258	1.25%
	C	Ausschüttung	LU1236612658	1.25%
	C (q)	Ausschüttung	LU1207305332	1.25%
	I	Thesaurierung	LU1207305415	0.50%
	I (q)	Ausschüttung	LU1207305506	0.50%
	R	Thesaurierung	LU1427871725	0.65%
	R2	Ausschüttung	LU1427872293	0.32%
	V	Thesaurierung	LU1207305688	0.30%
	Z	Thesaurierung	LU1207305845	0.00%
	Z (q)	Ausschüttung	LU1207305928	0.00%
Candriam L Multi-Asset Premia	C	Thesaurierung	LU1797471627	1.50%
	I	Thesaurierung	LU1797471890	0.75%
	PI	Thesaurierung	LU1797472195	0.38%
	R	Thesaurierung	LU1797472278	0.75%
	S	Thesaurierung	LU1797472351	0.04%
	Z	Thesaurierung	LU1797472435	0.00%

Die nachfolgende Tabelle gibt Auskunft über die jährliche maximale Verwaltungsgebühr derjenigen OGAW, in welche die verschiedenen Teilfonds von Candriam L zum 30. Juni 2024 investiert sind:

Zielfonds	Höchstsatz
CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQUITY MARKET NEUTRAL Z C	0.00%
CANDRIAM BONDS CREDIT ALPHA Z C	0.00%
CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z C	0.00%
CANDRIAM BONDS EMERGING MARKETS CORPORATE Z C	0.00%
CANDRIAM BONDS EMERGING MARKETS TOTAL RETURN Z C	0.00%
CANDRIAM BONDS EURO DIVERSIFIED Z C	0.00%
CANDRIAM BONDS EURO GOVERNMENT Z C	0.00%
CANDRIAM BONDS EURO SHORT TERM Z C	0.00%
CANDRIAM BONDS GLOBAL HIGH YIELD Z C	0.00%
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z C	0.25%
CANDRIAM EQUITIES L EMERGING MARKETS Z C	0.00%
CANDRIAM EQUITIES L EUROPE INNOVATION Z C	0.00%
CANDRIAM EQUITIES L LIFE CARE Z C	0.00%
CANDRIAM EQUITIES L RISK ARBITRAGE OPPORTUNITIES Z C	0.00%
CANDRIAM EQUITIES L ROBOTICS & INNOVATIVE TECHNOLOGY Z C	0.00%
CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME & GROWTH Z C	0.00%
CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME Z C	0.00%
CANDRIAM L MULTI-ASSET PREMIA Z C	0.00%
CANDRIAM MONEY MARKET USD SUSTAINABLE Z C	0.00%
CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EMERGING MARKETS Z C	0.00%
CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO CORPORATE Z C	0.00%



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 3 – Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

Zielfonds	Höchstsatz
CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO Z C	0.00%
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY CIRCULAR ECONOMY Z C	0.00%
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY CLIMATE ACTION Z C	0.00%
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY EMERGING MARKETS Z C	0.00%
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY QUANT EUROPE Z C	0.00%
CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY US Z C	0.00%
CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO Z C	0.00%
CLEOME INDEX EUROPE EQUITIES Z C	0.00%
CLEOME INDEX USA EQUITIES Z C	0.00%
INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE CORPORATE EURO BOND UCITS ETF D	0.20%
INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE EUROPE EQUITY UCITS ETF C	0.15%
INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE JAPAN EQUITY UCITS ETF C	0.20%
LUMYNA MW TOPS MARKET NEUTRAL UCITS CL B	1.50%
LYXOR HONG KONG HSI-DIST	0.55%

Anhangangabe 4 – Betriebs- und Verwaltungskosten

Die SICAV trägt die laufenden Betriebs- und Verwaltungskosten, die zur Deckung aller Gemeinkosten und variablen Kosten, der Gebühren, Entgelte und sonstigen Aufwendungen, wie nachstehend definiert („Betriebs- und Verwaltungskosten“), anfallen.

Die Betriebs- und Verwaltungskosten umfassen unter anderem die folgenden Ausgaben:

a) die direkt von der SICAV getätigten Ausgaben, darunter unter anderem die Gebühren und Kosten der Depotbank, die Gebühren und Auslagen der zugelassenen unabhängigen Wirtschaftsprüfer, die Kosten für die Absicherung von Anteilsklassen, einschließlich der von der Verwaltungsgesellschaft in Rechnung gestellten Kosten, die an die Verwaltungsratsmitglieder gezahlten Gebühren und die angemessenen Ausgaben und Aufwendungen, die den Verwaltungsratsmitgliedern entstanden sind oder für sie getätigt wurden;

b) eine an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlende „Servicegebühr“, die den nach Abzug der vorstehend unter (a) aufgeführten Ausgaben verbleibenden Teil der Betriebs- und Verwaltungskosten abdeckt, das heißt unter anderem die folgenden Kosten und Gebühren: die Gebühren und Kosten der Domizilstelle, der Verwaltungsstelle sowie der Übertragungs- und Registerführungsstelle; die Kosten für die Registrierung und Aufrechterhaltung der Registrierung in allen relevanten Rechtsgebieten (z. B. die von den betreffenden Aufsichtsbehörden erhobenen Gebühren, die Kosten für Übersetzungen und die Vergütungen der Vertreter im Ausland und der lokalen Zahlstellen); die Kosten für die Börsennotierung und deren Aufrechterhaltung; die Kosten für die Veröffentlichung der Anteilspreise; die Kosten für Porto und Telekommunikation; die Kosten für die Erstellung, den Druck, die Übersetzung und die Verteilung der Prospekte, der Dokumente mit den wesentlichen Anlegerinformationen, der Mitteilungen an die Anteilinhaber, der Finanzberichte oder aller sonstigen Dokumente für die Anteilinhaber; die Honorare und Kosten für rechtliche Belange; die Gebühren und Kosten für Zugriffe auf kostenpflichtige Informationen oder Daten (Abonnements, Lizenzgebühren und jegliche anderen Kosten); die Kosten für die Verwendung eingetragener Marken durch die SICAV sowie die Kosten und Gebühren, die der Verwaltungsgesellschaft und/oder den von ihr beauftragten Stellen und/oder jeder anderen von der SICAV selbst beauftragten Stelle und/oder unabhängigen Sachverständigen zustehen.

Die Betriebs- und Verwaltungskosten werden als jährlicher Prozentsatz des durchschnittlichen Nettoinventarwerts der einzelnen Anteilsklassen ausgedrückt und sind monatlich zu zahlen.

Sollten am Ende eines bestimmten Zeitraums die tatsächlichen Gebühren und Aufwendungen höher sein als der für eine Anteilsklasse festgelegte Prozentsatz der Betriebs- und Verwaltungskosten, so würde die Verwaltungsgesellschaft die Differenz selbst bezahlen. Sollten hingegen die tatsächlichen Gebühren und Aufwendungen unter dem für eine Anteilsklasse festgelegten Prozentsatz der Betriebs- und Verwaltungskosten liegen, würde die Verwaltungsgesellschaft die Differenz einbehalten.

Die Verwaltungsgesellschaft ist berechtigt, die SICAV anzuweisen, alle oder einen Teil der oben aufgeführten Kosten direkt aus ihrem Vermögen zu begleichen.

In einem solchen Fall würde sich der Betrag der Betriebs- und Verwaltungskosten entsprechend verringern.

Zum 30. Juni 2024 gelten die folgenden Höchstsätze:

Teilfonds	Anteilsklasse	Anteilsart	ISIN	Höchstsatz
Candriam L Balanced Asset Allocation	C	Ausschüttung	LU0982874777	0.10%
	C	Thesaurierung	LU0982874694	0.10%
	I	Ausschüttung	LU1207304871	0.05%
	I	Thesaurierung	LU0982874850	0.05%
	R2	Ausschüttung	LU1427870594	0.10%
	R2	Thesaurierung	LU1427870321	0.10%
	V	Thesaurierung	LU0982874934	0.05%
	Z	Thesaurierung	LU0982875071	0.05%
Candriam L Conservative Asset Allocation	C	Thesaurierung	LU0982875154	0.10%
	I	Ausschüttung	LU1207304798	0.05%
	I	Thesaurierung	LU0982875311	0.05%
	R2	Ausschüttung	LU1427870248	0.10%
	R2	Thesaurierung	LU1427870164	0.10%
	V	Thesaurierung	LU0982875402	0.05%
	Z	Thesaurierung	LU0982875584	0.05%
Candriam L Dynamic Asset Allocation	C	Ausschüttung	LU0982876988	0.10%



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 4 – Betriebs- und Verwaltungskosten (Fortsetzung)

Teilfonds	Anteilsklasse	Anteilsart	ISIN	Höchstsatz
Candriam L Dynamic Asset Allocation (Fortsetzung)	C	Thesaurierung	LU0982876806	0.10%
	I	Thesaurierung	LU0982877101	0.05%
	R	Thesaurierung	LU1427870677	0.10%
	V	Thesaurierung	LU0982877283	0.05%
	Z	Thesaurierung	LU0982877366	0.05%
Candriam L Multi-Asset Income	C	Ausschüttung	LU0982876475	0.10%
	C	Thesaurierung	LU0982876392	0.10%
	C (q)	Ausschüttung	LU1236612575	0.10%
	I	Thesaurierung	LU0982876558	0.05%
	R	Thesaurierung	LU1427871139	0.10%
	R2	Ausschüttung	LU1427871485	0.10%
	R2	Thesaurierung	LU1427871303	0.10%
	V	Thesaurierung	LU0982876632	0.05%
	V (q)	Ausschüttung	LU1207305092	0.05%
	Z	Thesaurierung	LU0982876715	0.05%
	Z (q)	Ausschüttung	LU1207305175	0.05%
Candriam L Multi-Asset Income & Growth	C	Ausschüttung	LU1236612658	0.10%
	C	Thesaurierung	LU1207305258	0.10%
	C (q)	Ausschüttung	LU1207305332	0.10%
	I	Thesaurierung	LU1207305415	0.05%
	I (q)	Ausschüttung	LU1207305506	0.05%
	R	Thesaurierung	LU1427871725	0.10%
	R2	Ausschüttung	LU1427872293	0.10%
	V	Thesaurierung	LU1207305688	0.05%
	Z	Thesaurierung	LU1207305845	0.05%
	Z (q)	Ausschüttung	LU1207305928	0.05%
	Candriam L Multi-Asset Premia	C	Thesaurierung	LU1797471627
I		Thesaurierung	LU1797471890	0.40%
PI		Thesaurierung	LU1797472195	0.40%
R		Thesaurierung	LU1797472278	0.50%
S		Thesaurierung	LU1797472351	0.40%
Z		Thesaurierung	LU1797472435	0.40%

Anhangangabe 5 – Performancegebühren

Die Verwaltungsgesellschaft erhält für einige Anteilsklassen von Candriam L Multi-Asset Income, Candriam L Multi-Asset Income & Growth und Candriam L Multi-Asset Premia eine Performancegebühr, die einer High-Water-Mark und einer Hurdle-Rate unterliegt und auf das Nettovermögen des Teilfonds erhoben wird.

Die Methode zur Berechnung der Performance-Provision wird in den verschiedenen technischen Spezifikationen, die dem geltenden Prospekt der SICAV beigefügt sind, detailliert beschrieben.

Candriam L Multi-Asset Income

Anteilsklasse	Klassentyp	Währung	Performancegebührensatz	Höhe der für die Periode in Rechnung gestellten Performancegebühr	% des NIW der Anteilsklasse, der für die Periode als Performancegebühr erhoben wurde
I	Thesaurierung	EUR	20.00%	0	0.00%
V	Thesaurierung	EUR	20.00%	0	0.00%
V (q)	Ausschüttung	EUR	20.00%	0	0.00%

In der Periode zum 30. Juni 2024 wurde keine Performancegebühr in Rechnung gestellt.

Candriam L Multi-Asset Income & Growth

Anteilsklasse	Klassentyp	Währung	Performancegebührensatz	Höhe der für die Periode in Rechnung gestellten Performancegebühr	% des NIW der Anteilsklasse, der für die Periode als Performancegebühr erhoben wurde
I	Thesaurierung	EUR	20.00%	0	0.00%
I (q)	Ausschüttung	EUR	20.00%	0	0.00%
V	Thesaurierung	EUR	20.00%	0	0.00%

In der Periode zum 30. Juni 2024 wurde keine Performancegebühr in Rechnung gestellt.

Candriam L Multi-Asset Premia

Anteilsklasse	Klassentyp	Währung	Performancegebührensatz	Höhe der für die Periode in Rechnung gestellten Performancegebühr	% des NIW der Anteilsklasse, der für die Periode als Performancegebühr erhoben wurde
C	Thesaurierung	EUR	20.00%	2	0.17%
I	Thesaurierung	EUR	20.00%	30	0.29%
PI	Thesaurierung	EUR	20.00%	51,952	0.47%
R	Thesaurierung	EUR	20.00%	3	0.25%
Z	Thesaurierung	EUR	20.00%	152,759	0.44%

Die in der Periode zum 30. Juni 2024 in Rechnung gestellte Performancegebühr belief sich auf EUR 204.746.



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 6 – Zeichnungssteuer

Die SICAV unterliegt dem luxemburgischen Steuerrecht.

Aufgrund der geltenden Gesetze und Vorschriften unterliegt die SICAV in Luxemburg einer jährlichen Steuer in Höhe von 0,05% des Nettoinventarwerts der SICAV; dieser Satz wird für die institutionellen Anlegern vorbehaltenen Klassen auf 0,01 % reduziert. Diese Steuer ist vierteljährlich auf der Grundlage des Nettovermögens der SICAV zu zahlen, das am Ende des Quartals berechnet wird, auf das sich die Steuer bezieht.

Die belgische Regierung hat ein Gesetz erlassen, wonach der Nettoinventarwert der in Belgien registrierten ausländischen Anlagefonds einmal pro Jahr besteuert wird. Diese jährliche Steuer wird auf die Nettobeträge berechnet, die von belgischen Finanzintermediären als in Belgien investiert gelten. In Ermangelung einer ausreichenden Erklärung in Bezug auf diese Zahlen ist die Steuerbehörde berechtigt, die Steuer auf das gesamte Vermögen dieser Teilfonds zu berechnen. Mit dem belgischen Gesetz vom 17. Juni 2013, das steuerliche und finanzielle Bestimmungen sowie Bestimmungen zur nachhaltigen Entwicklung enthält, wurde der Satz der jährlichen Steuer für Organismen für gemeinsame Anlagen mit Wirkung vom 1. Januar 2014 auf 0,0925 % festgelegt.

Die SICAV hat vorsorglich bei der belgischen Steuerbehörde und beim Gericht erster Instanz in Brüssel eine Klage auf Rückerstattung der Steuer eingereicht. Zum jetzigen Zeitpunkt ist es nicht möglich, dem Ausgang des Rechtsstreits oder einer eventuellen Erstattung zugunsten der SICAV vorzugreifen. In einem ähnlichen Fall legte der belgische Staat beim Kassationsgerichtshof Berufung gegen die zugunsten des Klägers ergangenen Urteile des Berufungsgerichts ein. Die Verwaltungsgesellschaft wurde unterrichtet, dass der Kassationsgerichtshof am 25. März 2022 zu Ungunsten des Klägers entschieden hat. Der Kassationsgerichtshof (französischsprachige Kammer) ist der Ansicht, dass das Berufungsgericht in Brüssel die belgische Zeichnungssteuer zu Unrecht als unter das Doppelbesteuerungsabkommen zwischen Belgien und Luxemburg fallende Vermögenssteuer bezeichnete (diesem Abkommen gemäß ist ausschließlich Luxemburg berechtigt, luxemburgische SICAVs zu besteuern, nicht aber Belgien, was den Anspruch auf Rückerstattung der belgischen Zeichnungssteuer begründet).

Der Fall wurde zurück an das Berufungsgericht Lüttich verwiesen, das an die Einschätzung des Kassationsgerichtshofs gebunden ist.

In einer anderen Entscheidung des Kassationsgerichtshofs (flämischsprachige Kammer) vom 21. April 2022 wird zwar nicht bestritten, dass es sich bei der belgischen Zeichnungssteuer um eine Vermögenssteuer handelt, aber die Auffassung vertreten, dass eine in Belgien erhobene Vermögenssteuer nicht unter das Doppelbesteuerungsabkommen zwischen Belgien und Luxemburg fällt (anders als bei dem Abkommen mit den Niederlanden).

Die Aussichten auf eine Rückerstattung halten sich daher in Grenzen, und eine Rückerstattung wird in jedem Fall nicht kurzfristig möglich sein.

Anhangangabe 7 – Wertpapierleihgeschäfte

Zum 30. Juni 2024 gab es keine verliehenen Wertpapiere.

Die Beträge der im Zusammenhang mit diesen Wertpapierleihgeschäften erhaltenen Zinsen sind in der Position „Zinsen aus Wertpapierleihgeschäften“ in der Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens enthalten.

Die folgenden Ertragsposten wurden in der Periode zum 30. Juni 2024 verbucht:

Der Ertrag, nach Abzug von Kosten, Gebühren und Kommissionen für die Verwaltungsstelle wird von der SICAV entgegengenommen.

Die direkten und indirekten Kosten und Gebühren, die Candriam erhalten hat, belaufen sich für alle Teilfonds auf 19 % bzw. 1 %.

Die von CACEIS Bank, Luxembourg Branch erhaltenen Provisionen belaufen sich auf 20 % des Bruttoertrags.

Candriam – Succursale française und Candriam sind verbundene Parteien der SICAV.

Anhangangabe 8 – Dividenden

Die SICAV hat in der Periode zum 30. Juni 2024 die folgenden Dividenden ausgeschüttet:

Teilfonds	Anteilsklasse	Währung	Ausschüttung	Ex-Tag
Candriam L Balanced Asset Allocation	C	EUR	5.17	29/04/2024
	I	EUR	49.08	29/04/2024
	R2	EUR	4.92	29/04/2024
Candriam L Conservative Asset Allocation	I	EUR	50.69	29/04/2024
	R2	EUR	4.89	29/04/2024
Candriam L Multi-Asset Income	C	EUR	1.36	29/04/2024
	C (q)	EUR	0.36	15/01/2024
	C (q)	EUR	0.36	15/04/2024
	R2	EUR	1.42	29/04/2024
	V (q)	EUR	3.71	15/01/2024
	V (q)	EUR	3.71	15/04/2024
	Z (q)	EUR	3.87	15/01/2024
	Z (q)	EUR	3.87	15/04/2024
Candriam L Multi-Asset Income & Growth	C	EUR	3.27	29/04/2024
	C (q)	EUR	0.89	15/01/2024
	C (q)	EUR	0.89	15/04/2024
	I (q)	EUR	9.01	15/01/2024
	I (q)	EUR	9.01	15/04/2024
	R2	EUR	3.62	29/04/2024
	Z (q)	EUR	9.47	15/01/2024
	Z (q)	EUR	9.47	15/04/2024



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 9 – Guthaben bei Banken und Brokern

Die Guthaben bei Kreditinstituten und Brokern in der Nettovermögensaufstellung umfassen die Kassenkonten und die Guthaben bei Brokern für Terminkontrakte und börsennotierte Optionen.

Der in der Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2024 enthaltene Teil der Guthaben bei Banken und Brokern stellt sich wie folgt dar:

Teilfonds	Währung	Barmittel bei Brokern
Candriam L Balanced Asset Allocation	EUR	1,038,651
Candriam L Conservative Asset Allocation	EUR	1,289,140
Candriam L Dynamic Asset Allocation	EUR	132,224
Candriam L Multi-Asset Income	EUR	1,935,316
Candriam L Multi-Asset Income & Growth	EUR	1,282,883
Candriam L Multi-Asset Premia	EUR	426,665

Anhangangabe 10 – Sicherheiten

Im Zusammenhang mit den OTC-Derivaten wurden Barsicherheiten in folgender Höhe von BNP PARIBAS SA und Société Générale SA empfangen:

Teilfonds	Währung	Verbuchte Barsicherheiten	Gehaltene Barsicherheiten
Candriam L Multi-Asset Income	EUR	(110,000)	0
Candriam L Multi-Asset Premia	EUR	(3,860,000)	260,000

Anhangangabe 11 – Änderungen der Portfoliozusammensetzung

Eine Liste der Transaktionen (Verkäufe und Käufe) in den Anlageportfolios ist kostenlos am Gesellschaftssitz der SICAV erhältlich.

Anhangangabe 12 – Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Es gibt keine Ereignisse nach dem Bilanzstichtag.



Zusätzliche ungeprüfte Angaben

Globale Risikoexposition

Risikomanagement – Berechnung des Gesamtrisikos

Für alle Teilfonds außer Candriam L Multi-Asset Income, Candriam L Multi-Asset Income & Growth und Candriam L Multi-Asset Premia verwendet die SICAV den Commitment-Ansatz gemäß CSSF-Rundschreiben 11/512.

Die SICAV verwendet den absoluten „Value at Risk“-Ansatz (VaR), die historische Methode zur Berechnung des Gesamtrisikos der Teilfonds Candriam L Multi-Asset Income, Candriam L Multi-Asset Income & Growth und Candriam L Multi-Asset Premia. Dieser Ansatz misst den maximalen potenziellen Verlust bei einem gegebenen Konfidenzniveau (Wahrscheinlichkeit) über einen definierten Zeitraum unter normalen Marktumständen. Diese Berechnungen werden auf der Basis der folgenden Parameter ausgeführt: Konfidenzintervall von 99 %, Haltefrist von einem Tag (umgewandelt in eine Haltefrist von 20 Tagen) und historische Daten von drei Jahren.



Zusätzliche ungeprüfte Angaben

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

Informationen für Anleger in der Bundesrepublik Deutschland

Für die folgenden Teilfonds ist keine Anzeige nach § 310 Kapitalanlagegesetzbuch erstattet worden und Anteile dieser Teilfonds dürfen in der Bundesrepublik Deutschland nicht vertrieben werden:

- **Candriam L Balanced Asset Allocation**
- **Candriam L Conservative Asset Allocation**
- **Candriam L Dynamic Asset Allocation**
- **Candriam L Multi-Asset Premia**

Unberührt bleibt eine etwaige im Rahmen des § 355 Absatz 4 Kapitalanlagegesetzbuch fortbestehende Berechtigung zu Tätigkeiten, die nach dem Investmentgesetz nicht als öffentlicher Vertrieb gelten.

Einrichtung gemäß Art. 92 Abs. 1 der Richtlinie 2009/65/EG in der Fassung der Richtlinie (EU) 2021/2261 beziehungsweise § 306a KAGB

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

- Bei dieser Einrichtung können Aufträge zur Zeichnung, Rücknahme und zum Umtausch von Anteilen des OGAW 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, die Satzung der SICAV, 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.
- Die Einrichtung versorgt die Anleger mit relevanten Informationen in Bezug auf die Aufgaben, die die Einrichtung erfüllt, auf einem dauerhaften Datenträger.
- Diese Einrichtung fungiert als Kontaktstelle für die Kommunikation mit der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht.

Die Website www.candriam.com:

- Der Verkaufsprospekt, die Basisinformationsblätter, die Satzung der SICAV, die letzten veröffentlichten Jahres- und Halbjahresberichte sowie sonstige Angaben und Unterlagen werden auf dieser Website veröffentlicht und sind dort kostenlos verfügbar.
- Der Nettoinventarwert pro Anteil sowie die Ausgabe-, Rücknahme-, und Umtauschpreise werden auf dieser Website veröffentlicht und sind dort kostenlos verfügbar.

Der Gesellschaftssitz der SICAV:

- Der Verkaufsprospekt, die Basisinformationsblätter, die Satzung der SICAV, die letzten veröffentlichten Jahres- und Halbjahresberichte – auf Anfrage jeweils in Papierform – sowie sonstige Angaben und Unterlagen sind am Gesellschaftssitz der SICAV kostenlos verfügbar.
- Der Nettoinventarwert pro Anteil sowie die Ausgabe-, Rücknahme-, und Umtauschpreise sind am Gesellschaftssitz der SICAV 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.