



Unselbständiger Investmentfonds (FCP) nach  
französischem Recht

HALBJAHRESBERICHT

## **Candriam Long Short Credit**

zum 28. Juni 2024

Verwaltungsgesellschaft: CANDRIAM

Abschlussprüfer: PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDIT

CANDRIAM - 19-21 route d'Arlon - L-8009 Strassen - Großherzogtum Luxemburg

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG IN EUR

Elemente der Vermögensaufstellung	Betrag des Zwischenabschlusses (*)
a) Zulässige Wertpapiere im Sinne von Artikel L.214-20 Abschnitt I Punkt 1 des französischen Code Monétaire et Financier	340 161 460,79
b) Bankguthaben	32 754 630,11
c) Sonstige vom OGA gehaltene Vermögenswerte	61 981 014,25
d) Vermögenswerte im Bestand des OGA insgesamt (Zeilen a+b+c)	434 897 105,15
e) Passiva	-21 879 009,23
f) Nettoinventarwert (Zeilen d+e = Nettovermögen des OGA)	413 018 095,92

(\*) Die Beträge weisen Vorzeichen auf.

## ANZAHL DER IM UMLAUF BEFINDLICHEN ANTEILE UND NETTOINVENTARWERT JE ANTEIL

Anteil	Art des Anteils	Nettovermögen der Anteilsklasse	Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil
CANDRIAM LONG SHORT CREDIT C CHF in CHF	C	2 309 068,10	2 200,000	1 049,57
CANDRIAM LONG SHORT CREDIT Anteil CLASSIQUE EUR in EUR	C	121 787 905,74	96 885,486	1 257,02
CANDRIAM LONG SHORT CREDIT R2 EUR in EUR	C	260 349,68	1 589,960	163,74
CANDRIAM LONG SHORT CREDIT R EUR in EUR	C	75 503 722,86	669 887,563	112,71
CANDRIAM LONG SHORT CREDIT RS EUR in EUR	C	1 153,11	7,006	164,58
CANDRIAM LONG SHORT CREDIT V in EUR	C	154 142 372,71	135 153,841	1 140,49
CANDRIAM LONG SHORT CREDIT Z EUR in EUR	C	58 924 930,12	35 526,832	1 658,60

## ELEMENT DES WERTPAPIERBESTANDS

Elemente des Wertpapierbestands	Prozentsatz Nettovermögen (*)	Prozentsatz Vermögenswerte insgesamt (**)
A) Zulässige Wertpapiere und die Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden, im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Code Monétaire et financier.  Und B) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem sonstigen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist und in einem Mitgliedsstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Unterzeichnerstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum liegt, gehandelt werden.	64,92	61,65
C) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer geregelten Wertpapierbörse eines Drittlandes amtlich notiert sind oder an einem sonstigen Markt eines Drittlandes gehandelt werden, die/der für das Publikum offen, anerkannt ist und ordnungsgemäß funktioniert, sofern diese Börse bzw. dieser Markt nicht auf einer von der Autorité des Marchés Financiers erstellten Liste der ausgeschlossenen Länder steht bzw. sofern die Wahl dieser Börse bzw. dieses Marktes in den gesetzlichen Vorschriften und/oder den Vertragsbedingungen oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist.	17,44	16,56
D) Zulässige Wertpapiere aus Neuemissionen im Sinne von Artikel R214-11 Abschnitt I Punkt 4 des französischen Code Monétaire et Financier.	0,00	0,00
E) Sonstige Vermögenswerte.	5,92	5,63

(\*) Siehe f) in der Vermögensaufstellung

(\*\*) Siehe d) in der Vermögensaufstellung

## AUFTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE VON A), B), C) UND D) DES WERTPAPIERBESTANDS, NACH WÄHRUNG

Wertpapiere	Währung	Als Betrag (EUR)	Prozentsatz Nettovermögen (*)	Prozentsatz Vermögenswerte insgesamt (**)
Euro	EUR	328 905 676,13	79,63	75,63
US-Dollar	USD	8 877 800,45	2,15	2,04
Pfund Sterling	GBP	2 377 984,21	0,58	0,55
<b>INSGESAMT</b>		<b>340 161 460,79</b>	<b>82,36</b>	<b>78,22</b>

(\*) Siehe f) in der Vermögensaufstellung

(\*\*) Siehe d) in der Vermögensaufstellung

**AUFTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE VON A), B), C) UND D) DES WERTPAPIERBESTANDS, NACH SITZLAND DES EMITTENTEN**

Land	Prozentsatz Nettovermögen (*)	Prozentsatz Vermögenswerte insgesamt (**)
FRANKREICH	30,08	28,56
DEUTSCHLAND	10,26	9,74
USA	8,13	7,72
ITALIEN	7,07	6,71
GROSSBRITANNIEN	5,67	5,38
SPANIEN	5,34	5,07
NIEDERLANDE	5,25	4,99
LUXEMBURG	1,70	1,62
SCHWEIZ	1,47	1,39
BELGIEN	1,38	1,31
IRLAND	1,35	1,28
SCHWEDEN	1,23	1,17
AUSTRALIEN	1,20	1,14
KANADA	0,97	0,92
NORWEGEN	0,78	0,74
PORTUGAL	0,48	0,45
<b>INSGESAMT</b>	<b>82,36</b>	<b>78,22</b>

(\*) Siehe f) in der Vermögensaufstellung

(\*\*) Siehe d) in der Vermögensaufstellung

## AUFTEILUNG DER SONSTIGEN VERMÖGENSWERTE VON E) DES WERTPAPIERBESTANDS, NACH ART

Art der Vermögenswerte	Prozentsatz Nettovermögen (*)	Prozentsatz Vermögenswerte insgesamt (**)
OGAW und vergleichbare Fonds aus anderen Mitgliedstaaten der Europäischen Union	5,92	5,63
Andere OGA und Investmentfonds	0,00	0,00
AIF und vergleichbare Fonds aus anderen Mitgliedstaaten der Europäischen Union	0,00	0,00
Sonstige	0,00	0,00
<b>INSGESAMT</b>	<b>5,92</b>	<b>5,63</b>

(\*) Siehe f) in der Vermögensaufstellung

(\*\*) Siehe d) in der Vermögensaufstellung

## VERÄNDERUNGEN DES WERTPAPIERBESTANDS IM LAUFE DES ZEITRAUMS IN EUR

Elemente des Wertpapierbestands	Veränderungen (als Betrag)	
	Käufe	Verkäufe
<p>A) Zulässige Wertpapiere und die Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden, im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Code Monétaire et financier.</p> <p>Und B) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem sonstigen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist und in einem Mitgliedsstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Unterzeichnerstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum liegt, gehandelt werden.</p>	855 736 549,79	845 806 733,44
<p>C) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer geregelten Wertpapierbörse eines Drittlandes amtlich notiert sind oder an einem sonstigen Markt eines Drittlandes gehandelt werden, die/der für das Publikum offen, anerkannt ist und ordnungsgemäß funktioniert, sofern diese Börse bzw. dieser Markt nicht auf einer von der Autorité des Marchés Financiers erstellten Liste der ausgeschlossenen Länder steht bzw. sofern die Wahl dieser Börse bzw. dieses Marktes in den gesetzlichen Vorschriften und/oder den Vertragsbedingungen oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist.</p>	244 682 065,01	237 521 820,79
<p>D) Zulässige Wertpapiere aus Neuemissionen im Sinne von Artikel R.214-11 Abschnitt I Punkt 4 des französischen Code Monétaire et Financier.</p>	0,00	0,00
<p>E) Sonstige Vermögenswerte.</p>	23 001 207,80	11 822 756,70

## INFORMATION ÜBER VARIABLE VERWALTUNGSGEBÜHREN

	28/06/2024
<b>Anteil CANDRIAM LONG SHORT CREDIT C CHF</b>	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	1 408,59
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,06
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
<b>Anteil CANDRIAM LONG SHORT CREDIT Part CLASSIQUE EUR</b>	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	89 643,05
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,07
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	10 509,63
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,01
<b>Anteil CANDRIAM LONG SHORT CREDIT R2 EUR</b>	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	269,09
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,09
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	26,05
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,01
<b>Anteil CANDRIAM LONG SHORT CREDIT R EUR</b>	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	72 877,63
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,09
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	4 707,95
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,01
<b>Anteil CANDRIAM LONG SHORT CREDIT RS EUR</b>	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	1,11
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,10
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
<b>Anteil CANDRIAM LONG SHORT CREDIT V</b>	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	180 249,52
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,10
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	36 059,13
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,02

»Die oben ausgewiesene Höhe der variablen Verwaltungsgebühren entspricht der Summe aus Rückstellungen und Auflösungen von Rückstellungen, die das Nettovermögen in der Berichtsperiode beeinflusst haben.«

	<b>28/06/2024</b>
<b>Anteil CANDRIAM LONG SHORT CREDIT Z EUR</b>	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	44 847,24
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,11
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	428,85
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00

»Die oben ausgewiesene Höhe der variablen Verwaltungsgebühren entspricht der Summe aus Rückstellungen und Auflösungen von Rückstellungen, die das Nettovermögen in der Berichtsperiode beeinflusst haben.«

**TRANSPARENZ VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN UND DER WEITERVERWENDUNG VON FINANZINSTRUMENTEN – UNTER ANWENDUNG DES SFTR – in der Rechnungswährung des OGA (EUR)**

Im Verlauf des Geschäftsjahres hat der OGAW keine Geschäfte getätigt, die der SFTR-Verordnung unterliegen.

## AUFSTELLUNG DER AKTIVA UND PASSIVA

### Aufstellung der Bilanzpositionen

Bezeichnung der Wertpapiere nach Wirtschaftssektor (*)	Wahrung	Stuckzahl/ Nennwert	Zeitwert	% Netto- vermogen
<b>ANLEIHEN UND ÄHNLICHE WERTPAPIERE</b>			<b>330 169 255,82</b>	<b>79,94</b>
<b>An einem geregelten Markt gehandelte Anleihen und ahnliche Wertpapiere</b>			<b>330 169 255,82</b>	<b>79,94</b>
<b>Versicherungen</b>			<b>15 331 811,97</b>	<b>3,71</b>
A 3.941% PERP EMTN	EUR	7 815 000	7 979 289,02	1,93
CNP ASSURANCES 4.0% PERP	EUR	7 200 000	7 352 522,95	1,78
<b>Geschaftsbanken</b>			<b>85 026 901,38</b>	<b>20,59</b>
AUSTRALIA NEW ZEA BANKING GRP LTD GTO 1.125% 21-11-29	EUR	5 000 000	4 968 176,23	1,20
BANCO DE BADELL 2.5% 15-04-31	EUR	3 000 000	2 896 363,40	0,70
BARCLAYS 8.5% PERP	GBP	2 000 000	2 377 984,21	0,58
BBVA 1.0% 16-01-30	EUR	4 000 000	3 936 900,66	0,95
BQ POSTALE 0.875% 26-01-31	EUR	5 900 000	5 631 652,20	1,36
CA 4.0% PERP	EUR	2 600 000	2 410 208,48	0,58
CA 6.875% PERP	USD	2 000 000	1 898 932,18	0,46
CAIXABANK 2.25% 17-04-30 EMTN	EUR	7 200 000	7 083 179,51	1,71
CMZB FRANCFORT 4.0% 05-12-30	EUR	5 000 000	5 068 454,10	1,23
DEUTSCHE BK 5.625% 19-05-31	EUR	11 000 000	11 226 499,04	2,74
HSBC 3.755% 20-05-29	EUR	5 000 000	5 014 268,49	1,21
KBC GROUPE 0.5% 03-12-29 EMTN	EUR	3 000 000	2 957 253,52	0,72
KBC GROUPE 4.25% PERP	EUR	2 800 000	2 742 620,43	0,66
NATWEST GROUP 4.6% PERP	USD	1 250 000	924 612,52	0,22
ROYAL BANK OF CANADA E3R+0.6% 02-07-28	EUR	4 000 000	4 000 860,00	0,97
SG 1.125% 30-06-31 EMTN	EUR	2 000 000	1 869 173,29	0,45
SOCIETE GENERALE	EUR	3 000 000	2 878 869,75	0,70
UBS GROUP AG 4.375% PERP	USD	2 000 000	1 549 000,07	0,38
UBS GROUP AG 6.875% PERP	USD	2 000 000	1 969 220,38	0,48
UBS GROUP AG 9.25% PERP	USD	2 500 000	2 536 035,30	0,61
UNICREDIT 2.0% 23-09-29 EMTN	EUR	10 995 000	11 086 637,62	2,68
<b>Getranke</b>			<b>18 277 732,65</b>	<b>4,43</b>
PERNOD RICARD 3.625% 07-05-34	EUR	7 000 000	6 925 706,51	1,68
PERNOD RICARD 3.75% 02-11-32	EUR	5 000 000	5 162 662,70	1,25
PERNOD RICARD 3.75% 15-09-33	EUR	6 000 000	6 189 363,44	1,50
<b>Bau- und Ingenieurwesen</b>			<b>5 453 281,76</b>	<b>1,32</b>
ABERTIS FINANCE BV 3.248% PERP	EUR	3 000 000	2 951 843,61	0,71
HOCHTIEF AG 4.25% 31-05-30	EUR	2 477 000	2 501 438,15	0,61
<b>Post, Luftfracht und Logistik</b>			<b>7 807 145,90</b>	<b>1,89</b>
DEUTSCHE POST AG 3.375% 03-07-33	EUR	7 500 000	7 807 145,90	1,89
<b>Elektrizitat</b>			<b>44 607 611,47</b>	<b>10,80</b>
EDF SA TF/TV 29/12/2049	EUR	11 700 000	11 963 284,84	2,90
EDP SERVICIOS FINANCIEROS ESPANA 4.375% 04-04-32	EUR	4 000 000	4 184 151,23	1,01
ENEL 3.5% 24-05-80	EUR	2 000 000	1 988 939,45	0,48
ENEL 6.375% PERP EMTN	EUR	4 000 000	4 460 645,90	1,08
ENERGIAS DE PORTUGAL EDP 1.7% 20-07-80	EUR	2 000 000	1 977 327,87	0,48
ORANO 3.375% 23-04-26 EMTN	EUR	11 000 000	10 979 348,63	2,66

## Aufstellung der Bilanzpositionen

Bezeichnung der Wertpapiere nach Wirtschaftssektor (*)	Währung	Stückzahl/ Nennwert	Zeitwert	% Netto- vermögen
REDEIA 3.375% 09-07-32	EUR	4 000 000	3 964 660,00	0,96
RTE EDF TRANSPORT 3.5% 07-12-31	EUR	5 000 000	5 089 253,55	1,23
<b>Verpackung und Aufmachung</b>			<b>8 344 000,76</b>	<b>2,02</b>
SILGAN 3.25% 15-03-25	EUR	8 337 000	8 344 000,76	2,02
<b>Kommunikationsausrüstung</b>			<b>6 597 580,82</b>	<b>1,60</b>
DEUTSCHE TELEKOM INTL FIN.4.5% 28/10/30	EUR	6 000 000	6 597 580,82	1,60
<b>Elektroausrüstung</b>			<b>10 589 247,21</b>	<b>2,56</b>
SCHNEIDER ELECTRIC SE 3.0% 10-01-31	EUR	5 000 000	4 970 611,48	1,20
SCHNEIDER ELECTRIC SE 3.5% 12-06-33	EUR	5 600 000	5 618 635,73	1,36
<b>Immobilienfonds für Privatanleger</b>			<b>4 961 468,31</b>	<b>1,20</b>
KLEPIERRE 3.875% 23-09-33 EMTN	EUR	5 000 000	4 961 468,31	1,20
<b>Hotels, Restaurants und Freizeit</b>			<b>5 193 234,84</b>	<b>1,26</b>
MC DONALD S 4.125% 28-11-35	EUR	5 000 000	5 193 234,84	1,26
<b>Luftfahrt- und Verteidigungsindustrie</b>			<b>7 187 160,56</b>	<b>1,74</b>
ROLLS ROYCE 4.625% 16-02-26	EUR	7 000 000	7 187 160,56	1,74
<b>Verkehrsinfrastruktur</b>			<b>4 282 550,00</b>	<b>1,04</b>
ADP 1.5% 02-07-32	EUR	5 000 000	4 282 550,00	1,04
<b>Software</b>			<b>3 384 703,56</b>	<b>0,82</b>
BOUYGUES 5.375% 30-06-42	EUR	3 000 000	3 384 703,56	0,82
<b>Kapitalmärkte</b>			<b>6 980 983,75</b>	<b>1,69</b>
REPSOL INTL FINANCE BV 3.75% PERP	EUR	2 000 000	1 980 375,07	0,48
VOLKSWAGEN INTL FINANCE NV 3.5% PERP	EUR	2 000 000	1 978 646,71	0,48
ZF FINANCE 3.0% 21-09-25 EMTN	EUR	3 000 000	3 021 961,97	0,73
<b>Medien</b>			<b>4 095 627,05</b>	<b>0,99</b>
COMCAST 0.75% 20-02-32	EUR	5 000 000	4 095 627,05	0,99
<b>Öl und Gas</b>			<b>11 663 999,54</b>	<b>2,82</b>
ENI 2.625% PERP	EUR	4 000 000	3 942 237,38	0,95
ENI 4.25% 19-05-33 EMTN	EUR	7 500 000	7 721 762,16	1,87
<b>Lebensmittel</b>			<b>1 837 526,63</b>	<b>0,44</b>
DARLING GLOBAL FINANCE BV 3.625% 15-05-26	EUR	1 850 000	1 837 526,63	0,44
<b>Pharmazeutika</b>			<b>4 579 755,78</b>	<b>1,11</b>
COTY 4.5% 15-05-27	EUR	2 297 000	2 323 415,50	0,56
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 7.375% 15-09-29	EUR	2 000 000	2 256 340,28	0,55
<b>Versorger</b>			<b>4 988 566,78</b>	<b>1,21</b>
EON SE 4.125% 25-03-44 EMTN	EUR	5 000 000	4 988 566,78	1,21
<b>Diversifizierte Telekommunikationsdienste</b>			<b>29 633 207,09</b>	<b>7,17</b>
ATT 3.95% 30-04-31	EUR	3 600 000	3 675 916,11	0,89
BRITISH TEL 3.875% 20-01-34	UNKNOWN_CURRENCY	0,00	0,00	0,00
DEUTSCHE TELEKOM AG 3.25% 20-03-36	EUR	8 000 000	7 760 242,19	1,89
ORANGE 1.875% 12-09-30	EUR	5 000 000	4 642 182,38	1,12
ORANGE 3.875% 11-09-35 EMTN	EUR	5 000 000	5 262 539,62	1,27
TELENOR AS 0.625% 25-09-31	EUR	2 000 000	1 660 286,99	0,40
TELIA COMPANY AB 3.625% 22-02-32	EUR	5 000 000	5 085 873,63	1,23
TELNO 0 7/8 02/14/35	EUR	2 000 000	1 546 166,17	0,37

## Aufstellung der Bilanzpositionen

Bezeichnung der Wertpapiere nach Wirtschaftssektor (*)	Währung	Stückzahl/ Nennwert	Zeitwert	% Netto- vermögen
<b>Diversifizierte Telekommunikationsdienste</b>			<b>2 733 282,54</b>	<b>0,66</b>
VODAFONE GROUP 2.875% 20-11-37	EUR	3 000 000	2 733 282,54	0,66
<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen</b>			<b>31 833 394,65</b>	<b>7,71</b>
ARAMARK INTL FINANCE SARL 3.125% 01-04-25	EUR	3 000 000	2 999 007,92	0,73
AVANTOR FUNDING 2.625% 01-11-25	EUR	3 000 000	2 946 113,75	0,71
BERRY PLASTICS 1.0% 15-01-25	EUR	7 100 000	7 011 128,29	1,70
JAMES HARDIE INTL FINANCE 3.625% 01-10-26	EUR	1 000 000	994 163,19	0,24
MERCEDESBEZ INTL FINANCE BV 3.25% 15-11-30	EUR	4 125 000	4 078 995,09	0,99
NESTLE FIN 3.25% 23-01-37 EMTN	EUR	4 100 000	4 034 385,44	0,98
RECKITT BENCKISER TREASURY SERVICES 3.875% 14-09-33	EUR	5 000 000	5 180 326,50	1,25
VODAFONE INTL FINANCING DAC 3.75% 02-12-34	EUR	4 500 000	4 589 274,47	1,11
<b>Börsennotierte Immobilieninvestmentgesellschaften</b>			<b>4 778 480,82</b>	<b>1,16</b>
UNIBAIL RODAMCO SE 2.875% PERP	EUR	5 000 000	4 778 480,82	1,16
<b>SCHULDITITEL</b>			<b>9 992 204,97</b>	<b>2,42</b>
<b>An einem geregelten Markt gehandelte Schuldtitel und ähnliche Wertpapiere</b>			<b>9 992 204,97</b>	<b>2,42</b>
<b>Versorger</b>			<b>9 992 204,97</b>	<b>2,42</b>
FRENCH REPUBLIC ZCP 03-07-24	EUR	10 000 000	9 992 204,97	2,42
<b>ANTEILE AN OGA</b>			<b>24 467 193,56</b>	<b>5,92</b>
<b>OGAW</b>			<b>24 467 193,56</b>	<b>5,92</b>
<b>Kollektive Verwaltung</b>			<b>24 467 193,56</b>	<b>5,92</b>
CANDRIAM BONDS CAPITAL SECURITIES R EUR ACC	EUR	2 350	402 531,50	0,10
CANDRIAM BONDS CAPITAL SECURITIES Z EUR ACC	EUR	1 863	3 308 799,78	0,80
CANDRIAM BONDS CREDIT ALPHA Z EUR ACC	EUR	3 334	5 833 233,08	1,41
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES I EUR ACC	EUR	200	2 871 816,00	0,70
CANDRIAM MONETAIRE-V ACC EUR	EUR	115	12 050 813,20	2,91
<b>Summe</b>			<b>364 628 654,35</b>	<b>88,28</b>

(\*) Der Wirtschaftszweig spiegelt die Hauptgeschäftstätigkeit des Emittenten des Finanzinstruments wider; die Angabe stammt aus zuverlässigen international anerkannten Quellen (hauptsächlich GICS und NACE).

## Aufstellung der Devisentermingeschäfte

Art der Transaktion	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*) (*)			
	Aktiva	Passiva	Forderungen aus Devisen (+)		Verbindlichkeiten aus Devisen (-)	
			Währung	Betrag (*)	Währung	Betrag (*)
A/EUR/GBP/20240712	10 384,82	0,00	EUR	1 779 565,69	GBP	-1 769 180,87
A/EUR/JPY/20240712	847,62	0,00	EUR	38 550,26	JPY	-37 702,64
<b>Summe</b>	<b>11 232,44</b>	<b>0,00</b>		<b>1 818 115,95</b>		<b>-1 806 883,51</b>

(\*) Der Betrag wird gemäß den Bestimmungen des Reglements zur Darstellung von Risikopositionen bestimmt und in der Rechnungswährung angegeben.

## Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Aktien

Art des Geschäfts	Stückzahl/ Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
<b>1. Futures</b>				
<b>Zwischensumme 1.</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>2. Optionen</b>				
<b>Zwischensumme 2.</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>3. Swaps</b>				
<b>Zwischensumme 3.</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>4. Sonstige Instrumente</b>				
CFD BARC PERP 1230	-4 300	0,00	-59 051,46	-434 710,24
CFD BNP ADP 2.1 1230	-30	14 178,30	0,00	-2 517,51
CFD BNPAFRPP ED 1230	-20	0,00	-6 794,40	-1 739,60
CFD BNP CCEP 33 1230	-5 000	0,00	-19 642,00	-396 870,00
CFD BNP EDF 30 1230	-50	8 042,50	0,00	-4 139,45
CFD BNP HSBC 3. 1230	-4 000	802,03	0,00	-424 523,21
CFD BNP ORAN 1230	-20	6 827,80	0,00	-1 785,44
CFD BNP TELI CO 1230	-2 200	0,00	-3 671,80	-179 333,00
CFD CFD BNPAFRP 1230	-2 750	15 152,50	0,00	-191 259,75
CFD DEUT BK 1.3 1230	-50	20 332,50	0,00	-4 169,35
CFD DEUT PO 1.0 1230	-7 500	0,00	-45 331,50	-652 215,00
CFD DEUT TE 1.3 1230	-3 200	3 296,00	0,00	-269 974,40
CFD ENGIE SA 1230	-30	37 272,00	0,00	-2 480,25
CFD ENI 2.75% P 1230	-3 000	0,00	-6 042,90	-266 925,00
CFD HOCH AG 1230	-3 000	0,00	-330,00	-257 037,00
CFD IBERDROLA I 1230	-50	2 952,50	0,00	-4 343,85
CFD ILIAD 5.625 1230	-30	21 120,00	0,00	-3 076,38
CFD LLOY BA 8.0 1230	-1 500	0,00	-3 009,10	-142 904,13
CFD OBL ANHE IN 1230	-5 000	0,00	-10 717,00	-479 650,00
CFD OBL ANHEUSE 1230	-5 000	0,00	-2 300,50	-432 545,00
CFD OBL BP BNP 1230	-4 000	0,00	-5 515,60	-383 712,00
CFD OBL UNIBA B 1230	-25	1 011,25	0,00	-1 985,80
CFD OBL VODAFON 1230	-2 000	5 468,40	0,00	-181 178,00
CFD SCHNEIDER E 1230	-50	36 865,50	0,00	-4 945,80
CFD SG 1.25 06- 1230	-50	26 005,00	0,00	-4 273,60
CFD SIEM FI 1.2 1230	-5 000	0,00	-2 150,00	-447 090,00
CFD TELE EM 1.9 1230	-30	0,00	-9 421,80	-2 679,33
CFD TELI AB 1230	-2 000	4 792,40	0,00	-166 066,00
CFD TELIA COMPA 1230	-3 750	6 091,13	0,00	-333 746,25
CFD UBS GROUP A 1230	-2 200	0,00	-10 052,16	-209 317,66
CFD UNIBAIL ROD 1230	-30	5 955,00	0,00	-2 473,23
CFD UNIB RO 1.3 1230	-50	6 466,50	0,00	-3 995,25
CFD UNIC 4.45 P 1230	-1 500	18 253,80	0,00	-137 401,50
CFD UNIL FI 1.3 1230	-5 800	0,00	-31 911,02	-520 753,00
CFD VERI CO 0.3 1230	-5 000	0,00	-23 020,50	-434 120,00
CFD VERI CO 0.8 1230	-5 000	0,00	-29 779,00	-410 195,00
CFD VODAFONE 1230	-3 900	0,00	-37 717,28	-387 052,48
ORANGE 0.75 06-34 12	-50	10 111,00	0,00	-3 830,80

## Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Aktien

Art des Geschäfts	Stückzahl/ Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
<b>Zwischensumme 4.</b>		<b>250 996,11</b>	<b>-306 458,02</b>	<b>-7 787 014,26</b>
<b>Summe</b>		<b>250 996,11</b>	<b>-306 458,02</b>	<b>-7 787 014,26</b>

(\*) Der Betrag wird gemäß den Bestimmungen des Reglements zur Darstellung von Risikopositionen bestimmt.

## Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Zinssätze

Art des Geschäfts	Stückzahl/ Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
<b>1. Futures</b>				
EURO BOBL 0924	-43	0,00	-2 060,00	-5 006 920,00
EURO BUND 0924	-235	171 420,00	0,00	-30 930 700,00
EURO-OAT 0924	-4	1 520,00	0,00	-492 480,00
LIFFE LG GILT 0924	8	6 604,94	0,00	920 634,55
US 10YR NOTE 0924	23	33 196,30	0,00	2 360 289,83
US TBOND 30 0924	27	53 533,94	0,00	2 980 580,83
XEUR FGBX BUX 0924	-43	0,00	-9 460,00	-5 600 320,00
<b>Zwischensumme 1.</b>		<b>266 275,18</b>	<b>-11 520,00</b>	<b>-35 768 914,79</b>
<b>2. Optionen</b>				
<b>Zwischensumme 2.</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>3. Swaps</b>				
<b>Zwischensumme 3.</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>4. Sonstige Instrumente</b>				
<b>Zwischensumme 4.</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>Summe</b>		<b>266 275,18</b>	<b>-11 520,00</b>	<b>-35 768 914,79</b>

(\*) Der Betrag wird gemäß den Bestimmungen des Reglements zur Darstellung von Risikopositionen bestimmt.

## Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Wechselkurse

Art des Geschäfts	Stückzahl/ Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
<b>1. Futures</b>				
EC EURUSD 0924	71	0,00	-38 306,51	8 903 568,93
<b>Zwischensumme 1.</b>		<b>0,00</b>	<b>-38 306,51</b>	<b>8 903 568,93</b>
<b>2. Optionen</b>				
<b>Zwischensumme 2.</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>3. Swaps</b>				
<b>Zwischensumme 3.</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>4. Sonstige Instrumente</b>				
<b>Zwischensumme 4.</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>Summe</b>		<b>0,00</b>	<b>-38 306,51</b>	<b>8 903 568,93</b>

(\*) Der Betrag wird gemäß den Bestimmungen des Reglements zur Darstellung von Risikopositionen bestimmt.

## Aufstellung der Finanztermingeschäfte - auf das Kreditrisiko

Art des Geschäfts	Stückzahl/ Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
<b>1. Futures</b>				
<b>Zwischensumme 1.</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>2. Optionen</b>				
<b>Zwischensumme 2.</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>3. Swaps</b>				
<b>Zwischensumme 3.</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>4. Sonstige Instrumente</b>				
ALLI FI 0.0 01-25_20	7 500 000	208 057,50	0,00	7 500 000,00
ALLI SE 2.241 07-45_	2 750 000	0,00	-18 768,20	2 750 000,00
ASSICURAZ FIX 040526	4 000 000	0,00	-50 722,00	4 000 000,00
ASSICURAZ FIX 040526	6 500 000	0,00	-82 423,25	6 500 000,00
BARC PLC 5.2 05-26_2	4 000 000	54 306,80	0,00	4 000 000,00
BBVA 3.5 02-27_20062	4 000 000	0,00	-76 912,80	4 000 000,00
BOUY 1.375 06-27_200	6 900 000	0,00	-180 704,79	6 900 000,00
CARR 1.25 06-25_2006	2 900 000	0,00	-44 879,24	2 900 000,00
CDX NA IG SERIE 40 V	6 531 373,92	112 482,02	0,00	6 531 373,92
COMP DE 1.625 08-25_	4 600 000	0,00	-95 870,44	4 600 000,00
DEUT BK 1.75 11-30_2	5 000 000	0,00	-87 000,50	5 000 000,00
ENGIE 1.5 03-28_2012	7 000 000	82 600,00	0,00	7 000 000,00
E ON AG 0.875 05-24_	10 000 000	0,00	-268 160,00	10 000 000,00
HCA 5.88 02-26_20062	5 924 889,2	0,00	-1 168 555,82	5 924 889,20
ING GRO 1.125 02-25_	4 000 000	85 827,60	0,00	4 000 000,00
INTE 6.184 02-34_200	3 000 000	83 997,60	0,00	3 000 000,00
ITRAXX EUROPE S41 V1	10 000 000	0,00	-180 622,00	10 000 000,00
ITRAXX EUROPE S41 V1	20 000 000	0,00	-361 244,00	20 000 000,00
ITRAXX EUR XOVER S41	500 000	37 700,25	0,00	500 000,00
ITRAXX EUR XOVER S41	2 000 000	150 801,00	0,00	2 000 000,00
KONI PH 0.5 05-26_20	5 700 000	0,00	-141 341,19	5 700 000,00
LVMH MO 0.0 02-26_20	4 500 000	149 168,25	0,00	4 500 000,00
MC DONA 3.5 07-27_20	8 397 480,76	0,00	-266 117,00	8 397 480,76
MEDI CR 4.75 03-28_2	3 600 000	0,00	-55 235,52	3 600 000,00
MUNICH R/ALL 1% 05CV	8 000 000	0,00	-226 828,00	8 000 000,00
REPS INT 2.25 12-26_	5 000 000	85 391,00	0,00	5 000 000,00
SANOFI 0.5 01-27_201	5 000 000	143 571,00	0,00	5 000 000,00
SANOFI 0.5 01-27_201	6 000 000	172 285,20	0,00	6 000 000,00
SG 1.25 06-30_201230	5 000 000	0,00	-43 026,50	5 000 000,00
SG 5.375 PERP_200629	3 700 000	74 048,10	0,00	3 700 000,00
SHEL INT 0.75 05-24_	4 600 000	0,00	-141 989,58	4 600 000,00
STMI NV ZCP 08-25_20	5 500 000	0,00	-190 702,05	5 500 000,00
SVK HAND TV 17_20122	4 000 000	0,00	-37 686,80	4 000 000,00
TELE EM 1.528 01-25_	3 000 000	0,00	-41 002,50	3 000 000,00
TEVA PH 3.15 10-26_2	1 866 106,83	17 324,94	0,00	1 866 106,83
TOTAL CAP FIX 190325	9 100 000	0,00	-279 765,85	9 100 000,00
UNIB RO 1.375 03-26_	4 800 000	0,00	-171 598,08	4 800 000,00
UNIB ROD 1.38 12-26_	2 500 000	0,00	-156 660,00	2 500 000,00

### Aufstellung der Finanztermingeschäfte - auf das Kreditrisiko

Art des Geschäfts	Stückzahl/ Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
UNIC SPA 4.1 06-17_2	5 000 000	141 522,00	0,00	5 000 000,00
VOLV TR 1.625 05-25_	5 000 000	109 413,50	0,00	5 000 000,00
ZURI VE 0.5 12-24_20	7 000 000	151 686,50	0,00	7 000 000,00
ZURI VE 0.5 12-24_20	5 000 000	108 347,50	0,00	5 000 000,00
<b>Zwischensumme 4.</b>		<b>1 968 530,76</b>	<b>-4 367 816,11</b>	<b>229 369 850,71</b>
<b>Summe</b>		<b>1 968 530,76</b>	<b>-4 367 816,11</b>	<b>229 369 850,71</b>

(\*) Der Betrag wird gemäß den Bestimmungen des Reglements zur Darstellung von Risikopositionen bestimmt.

### Aufstellung der Finanztermingeschäfte - andere Risikopositionen

Art des Geschäfts	Stückzahl/ Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
<b>1. Futures</b>				
<b>Zwischensumme 1.</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>2. Optionen</b>				
<b>Zwischensumme 2.</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>3. Swaps</b>				
<b>Zwischensumme 3.</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>4. Sonstige Instrumente</b>				
<b>Zwischensumme 4.</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>Summe</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>

(\*) Der Betrag wird gemäß den Bestimmungen des Reglements zur Darstellung von Risikopositionen bestimmt.

### Aufstellung der Finanztermingeschäfte oder Devisentermingeschäfte, die zur Absicherung einer Anteilsklasse eingesetzt werden

Art der Transaktion	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert		Anlagebetrag (*)				Abgesicherte Anteilsklasse
	Aktiva	Passiva	Forderungen aus Devisen (+)		Verbindlichkeiten aus Devisen (-)		
			Währung	Betrag (*)	Währung	Betrag (*)	
G8/A/CHF/EUR/240717	0,00	-31 100,67	CHF	2 399 535,48	EUR	-2 430 636,15	FR0011352566
<b>Summe</b>	<b>0,00</b>	<b>-31 100,67</b>		<b>2 399 535,48</b>		<b>-2 430 636,15</b>	

(\*) Der Betrag wird gemäß den Bestimmungen des Reglements zur Darstellung von Risikopositionen bestimmt und in der Rechnungswährung angegeben.

## Zusammenfassende Aufstellung

	In der Bilanz ausgewiesener Zeitwert
Gesamtaufstellung zulässiger Aktiva und Passiva (ohne Finanztermingeschäfte)	364 628 654,35
Aufstellung der Finanztermingeschäfte (ohne Geschäfte zur Absicherung ausgegebener Anteile):	
Summe Devisentermingeschäfte	11 232,44
Summe Finanztermingeschäfte - Aktien	-55 461,91
Summe Finanztermingeschäfte - Zinsen	254 755,18
Summe Finanztermingeschäfte - Wechselkurse	-38 306,51
Summe Finanztermingeschäfte - Kreditrisiko	-2 399 285,35
Summe Finanztermingeschäfte - Sonstige Risiken	0,00
Aufstellung der Finanztermingeschäfte zur Absicherung ausgegebener Anteile	-31 100,67
Sonstige Vermögenswerte (+)	67 771 416,31
Sonstige Verbindlichkeiten (-)	-17 123 807,92
Verbindlichkeiten aus Finanzierungen (-)	0,00
<b>Summe = Nettovermögen</b>	<b>413 018 095,92</b>

Bezeichnung der Anteilsklasse	Währung der Anteile	Anzahl der Anteile	Nettoinventarwert
Anteil CANDRIAM LONG SHORT CREDIT C CHF	CHF	2 200,000	1 049,57
Anteil CANDRIAM LONG SHORT CREDIT Part CLASSIQUE EUR	EUR	96 885,486	1 257,02
Anteil CANDRIAM LONG SHORT CREDIT R2 EUR	EUR	1 589,960	163,74
Anteil CANDRIAM LONG SHORT CREDIT R EUR	EUR	669 887,563	112,71
Anteil CANDRIAM LONG SHORT CREDIT RS EUR	EUR	7,006	164,58
Anteil CANDRIAM LONG SHORT CREDIT V	EUR	135 153,841	1 140,49
Anteil CANDRIAM LONG SHORT CREDIT Z EUR	EUR	35 526,832	1 658,60

## Informationen an die Anteilhaber in der Bundesrepublik Deutschland

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 FCP nach Maßgabe der in den Verkaufsunterlagen genannten Voraussetzungen eingereicht werden.
- Sämtliche für einen Anteilhaber bestimmte Zahlungen, einschließlich der Rücknahmeerlöse und etwaiger Ausschüttungen, können auf seinen Wunsch hin über diese Einrichtung geleitet werden.
- Bei dieser Einrichtung können Informationen darüber eingeholt werden, wie die genannten Aufträge erteilt werden können und wie Rücknahmeerlöse ausgezahlt werden.
- Diese Einrichtung erleichtert den Zugang zu Verfahren und Vorkehrungen gemäß Artikel 15 der Richtlinie 2009/65/EG in der Fassung der Richtlinie (EU) 2021/2261 beziehungsweise § 28 Abs. 2 Nr. 1 KAGB in Bezug auf die Wahrnehmung von Anlegerrechten (Anlegerbeschwerden) und informiert darüber.
- Der Verkaufsprospekt, die Basisinformationsblätter, das Verwaltungsreglement des FCP, die letzten veröffentlichten Jahres- und Halbjahresberichte – auf Anfrage jeweils in Papierform – sowie sonstige Angaben und Unterlagen sind bei dieser Einrichtung kostenlos verfügbar.
- Der Nettoinventarwert pro Anteil, die Ausgabe-, Rücknahme-, und Umtauschpreise sind bei dieser Einrichtung kostenlos verfügbar.
- 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](http://www.candriam.com):

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

Der Verwaltungsgesellschaft des FCP:

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

Etwaige Mitteilungen an die Anteilhaber in Deutschland werden unter [www.candriam.com](http://www.candriam.com) veröffentlicht und an die Anteilhaber an ihre im Anteilhaberregister 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 Aufwendererstattungen betreffen, die aus dem Investmentvermögen entnommen werden können (einschließlich der Hintergründe der Änderungen sowie der Rechte der Anleger); die Verschmelzung des Fonds oder eines Teilfonds sowie die Umwandlung des Fonds oder eines Teilfonds in einen Feederfonds.

## **Hinweise für Anleger in Österreich**

### **Kontakt- und Informationsstelle in Österreich**

Kontakt- und Informationsstelle in Österreich gemäß den Bestimmungen nach EU-Richtlinie 2019/1160 Art. 92:  
Erste Bank der oesterreichischen Sparkassen AG  
Am Belvedere 1,  
A-1100 Wien  
E-Mail: [foreignfunds0540@erstebank.at](mailto:foreignfunds0540@erstebank.at)