



Ungeprüfter Halbjahresbericht
Candriam L

30. Juni 2023

*01.01.2023 – 30.06.2023
SICAV luxemburgischen Rechts
R.C.S. Luxemburg Nr. B-182856*



Candriam L

SICAV luxemburgischen Rechts

Ungeprüfter Halbjahresbericht für die Periode
vom 1. Januar 2023 bis zum 30. Juni 2023



Inhalt

| | |
|--|----|
| Verwaltung der SICAV | 4 |
| Angaben zur SICAV | 5 |
| Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2023 | 6 |
| Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für die Periode zum 30. Juni 2023 | 9 |
| Statistiken | 12 |
| Anlageportfolio zum 30. Juni 2023 | 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 | 52 |
| Zusätzliche ungeprüfte Angaben | 62 |



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 und Member of the Group
Strategic Committee
Candriam

Vincent HAMELINK (bis 19. April 2023)
Member of the Group Strategic Committee
Candriam

Aurore PELLE (seit 20. April 2023)
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

„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 Portfoliobewegungen ist auf Anfrage kostenlos am Sitz der SICAV erhältlich.

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



Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2023

| | | Candriam L Balanced Asset Allocation | Candriam L Conservative Asset Allocation | Candriam L Dynamic Asset Allocation |
|--|------|--|--|---|
| | | EUR | EUR | EUR |
| Aktiva | | | | |
| Anlageportfolio zum Marktwert | 2a | 141,029,391 | 195,783,988 | 12,250,122 |
| Optionen zum Marktwert (Long-Position) | 2e | 179,353 | 245,738 | 18,259 |
| Guthaben bei Banken und Brokern | 10 | 1,559,219 | 2,448,782 | 333,136 |
| Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren | | 0 | 0 | 53,655 |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 519 | 104 | 1,663 |
| Forderungen aus CFD | | 0 | 0 | 0 |
| Dividendenforderungen aus CFD | | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus umgekehrten Pensionsgeschäften | 2j,8 | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto | | 9,142 | 12,650 | 812 |
| Nicht realisierter Nettowertzuwachs bei Futures | 2e | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps | 2h | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Vermögenswerte | | 0 | 0 | 0 |
| Aktiva insgesamt | | 142,777,624 | 198,491,262 | 12,657,647 |
| Passiva | | | | |
| Optionen zum Marktwert (Short-Position) | 2e | 57,703 | 78,897 | 5,944 |
| Kontokorrentkredite | | 3,455 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen | | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus CFD | | 0 | 0 | 0 |
| Dividendenverbindlichkeiten aus CFD | | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierte Nettoabschreibungen auf Devisentermingeschäfte | 2f | 66,836 | 76,338 | 8,658 |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures | 2e | 116,506 | 307,225 | 2,357 |
| Nicht realisierter Verlust aus CFD | 2g | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren | 3 | 51,002 | 66,140 | 7,213 |
| Verbindlichkeiten aus Betriebs- und Verwaltungskosten | 4 | 3,082 | 4,025 | 564 |
| Verbindlichkeiten aus Performancegebühren | 5 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Zeichnungssteuer | 6 | 767 | 1,067 | 530 |
| Passiva insgesamt | | 299,351 | 533,692 | 25,266 |
| Nettovermögen insgesamt | | 142,478,273 | 197,957,570 | 12,632,381 |



Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2023

| | | Candriam L Multi- Asset Income | Candriam L Multi- Asset Income & Growth | Candriam L Multi- Asset Premia |
|--|------|-----------------------------------|---|-----------------------------------|
| | | EUR | EUR | EUR |
| Aktiva | | | | |
| Anlageportfolio zum Marktwert | 2a | 324,323,161 | 122,561,544 | 27,571,277 |
| Optionen zum Marktwert (Long-Position) | 2e | 404,813 | 202,961 | 0 |
| Guthaben bei Banken und Brokern | 10 | 13,111,102 | 4,871,260 | 9,045,319 |
| Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren | | 0 | 0 | 1,387,100 |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 1,015,419 | 153,224 | 1,165,468 |
| Forderungen aus CFD | | 0 | 0 | 485,873 |
| Dividendenforderungen aus CFD | | 0 | 0 | 204,115 |
| Forderungen aus umgekehrten Pensionsgeschäften | 2j,8 | 0 | 0 | 7,497,821 |
| Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto | | 2,514,598 | 779,030 | 122,566 |
| Nicht realisierter Nettowertzuwachs bei Futures | 2e | 0 | 0 | 1,151,076 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps | 2h | 0 | 0 | 146,318 |
| Sonstige Vermögenswerte | | 51,175 | 6,325 | 0 |
| Aktiva insgesamt | | 341,420,268 | 128,574,344 | 48,776,933 |
| Passiva | | | | |
| Optionen zum Marktwert (Short-Position) | 2e | 0 | 0 | 0 |
| Kontokorrentkredite | | 0 | 35,135 | 160,056 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 0 | 0 | 1,219,791 |
| Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen | | 843,422 | 325,731 | 56,852 |
| Verbindlichkeiten aus CFD | | 0 | 0 | 370,172 |
| Dividendenverbindlichkeiten aus CFD | | 0 | 0 | 369,245 |
| Nicht realisierte Nettoabschreibungen auf Devisentermingeschäfte | 2f | 277,932 | 183,841 | 0 |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures | 2e | 300,103 | 287,890 | 0 |
| Nicht realisierter Verlust aus CFD | 2g | 0 | 0 | 177,637 |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren | 3 | 33,848 | 39,761 | 3,373 |
| Verbindlichkeiten aus Betriebs- und Verwaltungskosten | 4 | 36,510 | 13,696 | 9,085 |
| Verbindlichkeiten aus Performancegebühren | 5 | 0 | 0 | 222,048 |
| Verbindlichkeiten aus Zeichnungssteuer | 6 | 17,224 | 6,173 | 1,061 |
| Passiva insgesamt | | 1,509,039 | 892,227 | 2,589,320 |
| Nettovermögen insgesamt | | 339,911,229 | 127,682,117 | 46,187,613 |



Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2023

| | | Kombiniert |
|--|------|--------------------|
| | | EUR |
| Aktiva | | |
| Anlageportfolio zum Marktwert | 2a | 823,519,483 |
| Optionen zum Marktwert (Long-Position) | 2e | 1,051,124 |
| Guthaben bei Banken und Brokern | 10 | 31,368,818 |
| Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren | | 1,440,755 |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 2,336,397 |
| Forderungen aus CFD | | 485,873 |
| Dividendenforderungen aus CFD | | 204,115 |
| Forderungen aus umgekehrten Pensionsgeschäften | 2j,8 | 7,497,821 |
| Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto | | 3,438,798 |
| Nicht realisierter Nettowertzuwachs bei Futures | 2e | 1,151,076 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps | 2h | 146,318 |
| Sonstige Vermögenswerte | | 57,500 |
| Aktiva insgesamt | | 872,698,078 |
| Passiva | | |
| Optionen zum Marktwert (Short-Position) | 2e | 142,544 |
| Kontokorrentkredite | | 198,646 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 1,219,791 |
| Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen | | 1,226,005 |
| Verbindlichkeiten aus CFD | | 370,172 |
| Dividendenverbindlichkeiten aus CFD | | 369,245 |
| Nicht realisierte Nettoabschreibungen auf Devisentermingeschäfte | 2f | 613,605 |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures | 2e | 1,014,081 |
| Nicht realisierter Verlust aus CFD | 2g | 177,637 |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren | 3 | 201,337 |
| Verbindlichkeiten aus Betriebs- und Verwaltungskosten | 4 | 66,962 |
| Verbindlichkeiten aus Performancegebühren | 5 | 222,048 |
| Verbindlichkeiten aus Zeichnungssteuer | 6 | 26,822 |
| Passiva insgesamt | | 5,848,895 |
| Nettovermögen insgesamt | | 866,849,183 |



Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für die Periode zum 30. Juni 2023

| | | Candriam L Balanced Asset Allocation | Candriam L Conservative Asset Allocation | Candriam L Dynamic Asset Allocation |
|---|----|--|--|---|
| | | EUR | EUR | EUR |
| Nettovermögen zu Beginn der Periode | | 154,798,931 | 196,285,898 | 11,843,730 |
| Erträge | | | | |
| Dividenden, netto | | 59,707 | 82,050 | 4,178 |
| Zinsen auf Anleihen und Geldmarktinstrumente, netto | | 20,594 | 27,952 | 1,721 |
| Erhaltene Zinsen aus CFD | | 0 | 0 | 0 |
| Zinserträge aus Swaps | | 0 | 0 | 0 |
| Bankzinsen | | 27,526 | 27,434 | 3,892 |
| Zinsen auf umgekehrte Pensionsgeschäfte | | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Erträge | | 58 | 7 | 0 |
| Erträge insgesamt | | 107,885 | 137,443 | 9,791 |
| Aufwendungen | | | | |
| Bezahlte Dividenden, netto | | 0 | 0 | 0 |
| Verwaltungsgebühren | 3 | 324,776 | 402,295 | 42,662 |
| Performancegebühren | 5 | 0 | 0 | 0 |
| Betriebs- und Verwaltungskosten | 4 | 17,157 | 20,359 | 3,062 |
| Depotbankgebühren | 4 | 3,302 | 4,397 | 273 |
| Zeichnungssteuer | 6 | 2,003 | 2,098 | 770 |
| Transaktionskosten | 2k | 16,428 | 21,613 | 1,419 |
| Gezahlte Zinsen auf CFD | | 0 | 0 | 0 |
| Zinszahlungen für Swaps | | 0 | 0 | 0 |
| Bankzinsen | | 263 | 155 | 16 |
| Gezahlte Dividenden aus CFD | | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Aufwendungen | | 0 | 0 | 0 |
| Aufwendungen insgesamt | | 363,929 | 450,917 | 48,202 |
| Nettoertrag/(-verlust) aus Wertpapieren | | (256,044) | (313,474) | (38,411) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Wertpapieren | 2b | (439,664) | (124,260) | (5,847) |
| Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Optionen | 2e | (650,722) | (841,272) | (56,916) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften | 2f | 108,622 | 114,002 | 2,923 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures | 2e | 512,602 | 356,732 | 88,378 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus CFD | 2g | 0 | 0 | 0 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swaps | 2h | 0 | 0 | 0 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen | | 235,181 | 30,922 | 30,173 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | | (490,025) | (777,350) | 20,300 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren | 2a | 7,252,186 | 7,084,835 | 709,222 |
| Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Optionen | 2e | 42,156 | 43,786 | 2,639 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften | 2f | (86,759) | (108,770) | (8,165) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Futures | 2e | 153,857 | 248,464 | 19,744 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus CFD | 2g | 0 | 0 | 0 |
| Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Swaps | 2h | 0 | 0 | 0 |
| Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit | | 6,871,415 | 6,490,965 | 743,740 |
| Entwicklung des Kapitals | | | | |
| Zeichnung von Anteilen | | 2,437,583 | 627,093 | 107,140 |
| Rücknahme von Anteilen | | (21,603,372) | (5,334,734) | (46,145) |
| Ausgeschüttete Dividenden | 9 | (26,284) | (111,652) | (16,084) |
| Nettovermögen zum Ende der Periode | | 142,478,273 | 197,957,570 | 12,632,381 |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.



Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für die Periode zum 30. Juni 2023

| | | Candriam L Multi-Asset Income | Candriam L Multi-Asset Income & Growth | Candriam L Multi-Asset Premia |
|---|----|-------------------------------|--|-------------------------------|
| | | EUR | EUR | EUR |
| Nettovermögen zu Beginn der Periode | | 353,788,946 | 126,237,933 | 44,661,101 |
| Erträge | | | | |
| Dividenden, netto | | 284,145 | 199,730 | 0 |
| Zinsen auf Anleihen und Geldmarktinstrumente, netto | | 3,335,942 | 1,122,326 | 65,225 |
| Erhaltene Zinsen aus CFD | | 0 | 0 | 529,638 |
| Zinserträge aus Swaps | | 0 | 0 | 116,876 |
| Bankzinsen | | 198,961 | 84,362 | 121,387 |
| Zinsen auf umgekehrte Pensionsgeschäfte | | 0 | 0 | 180,477 |
| Sonstige Erträge | | 247 | 29 | 1,158 |
| Erträge insgesamt | | 3,819,295 | 1,406,447 | 1,014,761 |
| Aufwendungen | | | | |
| Bezahlte Dividenden, netto | | 0 | 0 | 2,277 |
| Verwaltungsgebühren | 3 | 213,872 | 245,000 | 20,149 |
| Performancegebühren | 5 | 0 | 0 | 224,573 |
| Betriebs- und Verwaltungskosten | 4 | 217,496 | 80,027 | 53,903 |
| Depotbankgebühren | 4 | 7,639 | 2,827 | 999 |
| Zeichnungssteuer | 6 | 33,933 | 7,136 | 2,094 |
| Transaktionskosten | 2k | 44,691 | 32,791 | 39,169 |
| Gezahlte Zinsen auf CFD | | 0 | 0 | 753,148 |
| Zinszahlungen für Swaps | | 0 | 0 | 80,343 |
| Bankzinsen | | 4,973 | 927 | 19,822 |
| Gezahlte Dividenden aus CFD | | 0 | 0 | 317,870 |
| Sonstige Aufwendungen | | 0 | 0 | 12,717 |
| Aufwendungen insgesamt | | 522,604 | 368,708 | 1,527,064 |
| Nettoertrag/(-verlust) aus Wertpapieren | | 3,296,691 | 1,037,739 | (512,303) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Wertpapieren | 2b | (1,221,053) | (16,364) | 136,544 |
| Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Optionen | 2e | (2,379,633) | (846,495) | 0 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften | 2f | (87,483) | (272,803) | 0 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures | 2e | 1,660,329 | 394,061 | 263,327 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus CFD | 2g | 0 | 0 | 868,847 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swaps | 2h | 0 | 0 | 40,549 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen | | (1,133,370) | (387,378) | (339,096) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | | 135,481 | (91,240) | 457,868 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren | 2a | 9,875,546 | 5,418,692 | 314,963 |
| Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Optionen | 2e | (270,176) | (107,833) | 0 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften | 2f | (700,088) | (356,738) | 0 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Futures | 2e | 267,578 | (101,347) | 978,615 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus CFD | 2g | 0 | 0 | (223,748) |
| Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Swaps | 2h | 0 | 0 | 80,600 |
| Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit | | 9,308,341 | 4,761,534 | 1,608,298 |
| Entwicklung des Kapitals | | | | |
| Zeichnung von Anteilen | | 22,556,156 | 6,679,780 | 2,726,677 |
| Rücknahme von Anteilen | | (43,990,597) | (9,541,708) | (2,808,463) |
| Ausgeschüttete Dividenden | 9 | (1,751,617) | (455,422) | 0 |
| Nettovermögen zum Ende der Periode | | 339,911,229 | 127,682,117 | 46,187,613 |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.



Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für die Periode zum 30. Juni 2023

| | Kombiniert |
|---|--------------------|
| | EUR |
| Nettovermögen zu Beginn der Periode | 887,616,539 |
| Erträge | |
| Dividenden, netto | 629,810 |
| Zinsen auf Anleihen und Geldmarktinstrumente, netto | 4,573,760 |
| Erhaltene Zinsen aus CFD | 529,638 |
| Zinserträge aus Swaps | 116,876 |
| Bankzinsen | 463,562 |
| Zinsen auf umgekehrte Pensionsgeschäfte | 180,477 |
| Sonstige Erträge | 1,499 |
| Erträge insgesamt | 6,495,622 |
| Aufwendungen | |
| Bezahlte Dividenden, netto | 2,277 |
| Verwaltungsgebühren | 3 1,248,754 |
| Performancegebühren | 5 224,573 |
| Betriebs- und Verwaltungskosten | 4 392,004 |
| Depotbankgebühren | 4 19,437 |
| Zeichnungssteuer | 6 48,034 |
| Transaktionskosten | 2k 156,111 |
| Gezahlte Zinsen auf CFD | 753,148 |
| Zinszahlungen für Swaps | 80,343 |
| Bankzinsen | 26,156 |
| Gezahlte Dividenden aus CFD | 317,870 |
| Sonstige Aufwendungen | 12,717 |
| Aufwendungen insgesamt | 3,281,424 |
| Nettoertrag/(-verlust) aus Wertpapieren | 3,214,198 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Wertpapieren | 2b (1,670,644) |
| Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Optionen | 2e (4,775,038) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften | 2f (134,739) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures | 2e 3,275,429 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus CFD | 2g 868,847 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swaps | 2h 40,549 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen | (1,563,568) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | (744,966) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren | 2a 30,655,444 |
| Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Optionen | 2e (289,428) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften | 2f (1,260,520) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Futures | 2e 1,566,911 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus CFD | 2g (223,748) |
| Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Swaps | 2h 80,600 |
| Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit | 29,784,293 |
| Entwicklung des Kapitals | |
| Zeichnung von Anteilen | 35,134,429 |
| Rücknahme von Anteilen | (83,325,019) |
| Ausgeschüttete Dividenden | 9 (2,361,059) |
| Nettovermögen zum Ende der Periode | 866,849,183 |



Statistiken

Candriam L Balanced Asset Allocation

| Name | ISIN | Anteilsart | Währung | Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile | Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2023 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2021 |
|--------------------------------|--------------|---------------|------------|---|--|--|--|
| Nettovermögen insgesamt | | | EUR | | 142,478,273 | 154,798,931 | 172,461,647 |
| C | LU0982874694 | Thesaurierung | EUR | 15,128.98 | 164.98 | 158.41 | 183.27 |
| C | LU0982874777 | Ausschüttung | EUR | 455.00 | 174.93 | 169.90 | 198.58 |
| I | LU0982874850 | Thesaurierung | EUR | 59,681.83 | 2,182.71 | 2,086.29 | 2,391.93 |
| I | LU1207304871 | Ausschüttung | EUR | 59.78 | 1,657.13 | 1,602.56 | 1,854.34 |
| R2 | LU1427870321 | Thesaurierung | EUR | 7.00 | 179.07 | 171.05 | 195.89 |
| R2 | LU1427870594 | Ausschüttung | EUR | 4,628.63 | 166.24 | 160.73 | 185.92 |
| V | LU0982874934 | Thesaurierung | EUR | 1.00 | 1,799.93 | 1,718.44 | 1,966.51 |
| Z | LU0982875071 | Thesaurierung | EUR | 4,954.00 | 1,768.85 | 1,686.93 | 1,925.38 |

Candriam L Conservative Asset Allocation

| Name | ISIN | Anteilsart | Währung | Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile | Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2023 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2021 |
|--------------------------------|--------------|---------------|------------|---|--|--|--|
| Nettovermögen insgesamt | | | EUR | | 197,957,570 | 196,285,898 | 225,152,204 |
| C | LU0982875154 | Thesaurierung | EUR | 9,983.44 | 160.73 | 156.27 | 179.42 |
| I | LU0982875311 | Thesaurierung | EUR | 94,129.09 | 1,919.41 | 1,857.72 | 2,113.57 |
| I | LU1207304798 | Ausschüttung | EUR | 9,766.69 | 1,583.94 | 1,544.00 | 1,764.60 |
| R2 | LU1427870164 | Thesaurierung | EUR | 7.00 | 163.27 | 157.99 | 179.66 |
| R2 | LU1427870248 | Ausschüttung | EUR | 1,350.27 | 153.05 | 149.16 | 170.44 |
| V | LU0982875402 | Thesaurierung | EUR | 1.00 | 1,645.54 | 1,591.13 | 1,806.80 |
| Z | LU0982875584 | Thesaurierung | EUR | 1.00 | 1,668.55 | 1,611.54 | 1,825.76 |

Candriam L Dynamic Asset Allocation

| Name | ISIN | Anteilsart | Währung | Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile | Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2023 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2021 |
|--------------------------------|--------------|---------------|------------|---|--|--|--|
| Nettovermögen insgesamt | | | EUR | | 12,632,381 | 11,843,730 | 14,353,777 |
| C | LU0982876806 | Thesaurierung | EUR | 9,887.54 | 232.28 | 219.33 | 257.23 |
| C | LU0982876988 | Ausschüttung | EUR | 4,125.00 | 197.25 | 189.68 | 225.97 |
| I | LU0982877101 | Thesaurierung | EUR | 3,696.60 | 2,548.26 | 2,395.02 | 2,782.99 |
| R | LU1427870677 | Thesaurierung | EUR | 10.00 | 153.02 | - | - |
| R2 | LU1427870834 | Ausschüttung | EUR | 555.30 | 174.91 | 167.26 | 197.12 |
| V | LU0982877283 | Thesaurierung | EUR | 1.00 | 1,532.71 | - | - |
| Z | LU0982877366 | Thesaurierung | EUR | 1.00 | 1,968.07 | 1,844.99 | 2,132.74 |

Candriam L Multi-Asset Income

| Name | ISIN | Anteilsart | Währung | Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile | Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2023 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2021 |
|--------------------------------|--------------|---------------|------------|---|--|--|--|
| Nettovermögen insgesamt | | | EUR | | 339,911,229 | 353,788,946 | 480,780,013 |
| C | LU0982876392 | Thesaurierung | EUR | 27,727.71 | 145.45 | 142.42 | 156.17 |
| C | LU0982876475 | Ausschüttung | EUR | 22,619.49 | 137.49 | 136.14 | 150.93 |
| C (q) | LU1236612575 | Ausschüttung | EUR | 72.66 | 139.35 | 137.11 | 151.90 |
| I | LU0982876558 | Thesaurierung | EUR | 9,871.75 | 1,694.67 | 1,652.82 | 1,798.97 |
| R | LU1427871139 | Thesaurierung | EUR | 10.00 | 151.38 | - | - |
| R2 | LU1427871303 | Thesaurierung | EUR | 1,169.60 | 154.80 | 150.95 | 164.16 |
| R2 | LU1427871485 | Ausschüttung | EUR | 570,520.77 | 144.09 | 142.03 | 156.04 |
| V | LU0982876632 | Thesaurierung | EUR | 1.00 | 1,516.21 | - | - |
| V (q) | LU1207305092 | Ausschüttung | EUR | 10,001.00 | 1,431.06 | 1,401.74 | 1,539.15 |
| Z | LU0982876715 | Thesaurierung | EUR | 40,177.00 | 1,587.22 | 1,544.95 | 1,674.01 |
| Z (q) | LU1207305175 | Ausschüttung | EUR | 104,667.00 | 1,486.18 | 1,453.71 | 1,591.35 |



Statistiken

Candriam L Multi-Asset Income & Growth

| Name | ISIN | Anteilsart | Währung | Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile | Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2023 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2021 |
|--------------------------------|--------------|---------------|------------|---|--|--|--|
| Nettovermögen insgesamt | | | EUR | | 127,682,117 | 126,237,933 | 165,078,099 |
| C | LU1207305258 | Thesaurierung | EUR | 198,190.15 | 166.92 | 161.54 | 182.50 |
| C | LU1236612658 | Ausschüttung | EUR | 1,000.69 | 131.48 | 130.97 | 151.92 |
| C (q) | LU1207305332 | Ausschüttung | EUR | 591.91 | 140.00 | 137.15 | 158.99 |
| I | LU1207305415 | Thesaurierung | EUR | 1,279.01 | 1,770.61 | 1,706.62 | 1,912.45 |
| I (q) | LU1207305506 | Ausschüttung | EUR | 1.00 | 1,410.69 | 1,375.05 | 1,581.58 |
| R | LU1427871725 | Thesaurierung | EUR | 10.00 | 151.21 | - | - |
| R2 | LU1427872293 | Ausschüttung | EUR | 1,448.65 | 146.53 | 145.18 | 166.62 |
| V | LU1207305688 | Thesaurierung | EUR | 10,667.50 | 1,690.45 | 1,627.75 | 1,820.11 |
| Z | LU1207305845 | Thesaurierung | EUR | 19,333.00 | 1,794.00 | 1,724.89 | 1,922.30 |
| Z (q) | LU1207305928 | Ausschüttung | EUR | 26,507.00 | 1,478.46 | 1,438.78 | 1,645.71 |

Candriam L Multi-Asset Premia

| Name | ISIN | Anteilsart | Währung | Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile | Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2023 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2021 |
|--------------------------------|--------------|---------------|------------|---|--|--|--|
| Nettovermögen insgesamt | | | EUR | | 46,187,613 | 44,661,101 | 53,330,908 |
| C | LU1797471627 | Thesaurierung | EUR | 7.00 | 159.68 | 154.58 | 159.52 |
| I | LU1797471890 | Thesaurierung | EUR | 6.00 | 1,645.98 | 1,590.19 | 1,627.56 |
| PI | LU1797472195 | Thesaurierung | EUR | 6,900.00 | 1,582.88 | 1,528.04 | 1,558.18 |
| R | LU1797472278 | Thesaurierung | EUR | 7.00 | 164.32 | 158.75 | 162.64 |
| S | LU1797472351 | Thesaurierung | EUR | 0.33 | 1,745.09 | 1,674.42 | 1,698.39 |
| Z | LU1797472435 | Thesaurierung | EUR | 21,027.00 | 1,676.56 | 1,617.59 | 1,643.32 |



Candriam L Balanced Asset Allocation

Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

| 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 GOLD ETC | 120,346 | USD | 4,117,245 | 2.89 |
| | | | 4,117,245 | 2.89 |
| Strukturierte Produkte, insgesamt | | | 4,117,245 | 2.89 |
| Aktien | | | | |
| Frankreich | | | | |
| DANONE SA | 4,909 | EUR | 275,591 | 0.19 |
| | | | 275,591 | 0.19 |
| Irland | | | | |
| KERRY GROUP -A- | 2,992 | EUR | 267,425 | 0.19 |
| | | | 267,425 | 0.19 |
| Schweiz | | | | |
| BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT | 143 | CHF | 253,021 | 0.18 |
| NESTLE SA REG SHS | 4,898 | CHF | 539,957 | 0.38 |
| | | | 792,978 | 0.56 |
| Aktien gesamt | | | 1,335,994 | 0.94 |
| Variabel verzinsliche Anleihen | | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | |
| UNITED STATES 0.125 22-52 15/02S | 2,168,000 | USD | 1,431,470 | 1.00 |
| UNITED STATES 1.5 23-53 15/02S | 1,569,000 | USD | 1,423,473 | 1.00 |
| | | | 2,854,943 | 2.00 |
| Variabel verzinsliche Anleihen gesamt | | | 2,854,943 | 2.00 |
| Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt | | | 8,308,182 | 5.83 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | | |
| Anteile/Einheiten an Anlagefonds | | | | |
| Frankreich | | | | |
| CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z C | 1,509 | EUR | 2,302,288 | 1.62 |
| | | | 2,302,288 | 1.62 |
| Irland | | | | |
| MW GAVEKAL CHINA FI -A- CAP | 8,033 | USD | 1,022,127 | 0.72 |
| | | | 1,022,127 | 0.72 |
| Luxemburg | | | | |
| CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQUITY MARKET NEUTRAL Z C | 773 | EUR | 1,442,843 | 1.01 |
| CANDRIAM BONDS CAPITAL SECURITIES Z C | 859 | EUR | 1,327,275 | 0.93 |
| CANDRIAM BONDS CONVERTIBLE DEFENSIVE Z C | 1,787 | EUR | 2,854,107 | 2.00 |
| CANDRIAM BONDS CREDIT ALPHA Z C | 452 | EUR | 743,535 | 0.52 |
| CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z C | 1,484 | USD | 1,512,075 | 1.06 |
| CANDRIAM BONDS EMERGING MARKETS CORPORATE Z C | 532 | USD | 714,445 | 0.50 |
| CANDRIAM BONDS EURO DIVERSIFIED Z C | 13,820 | EUR | 11,557,390 | 8.11 |
| CANDRIAM BONDS EURO GOVERNMENT Z C | 2,625 | EUR | 6,186,049 | 4.34 |
| CANDRIAM BONDS EURO SHORT TERM Z C | 1,823 | EUR | 3,948,381 | 2.77 |
| CANDRIAM BONDS FLOATING RATE NOTES Z C | 417 | EUR | 636,275 | 0.45 |
| CANDRIAM BONDS GLOBAL HIGH YIELD Z C | 10,215 | EUR | 2,839,055 | 1.99 |
| CANDRIAM BONDS TOTAL RETURN Z C | 1,438 | EUR | 2,209,329 | 1.55 |
| CANDRIAM EQUITIES L BIOTECHNOLOGY Z C | 753 | USD | 1,449,114 | 1.02 |
| CANDRIAM EQUITIES L EUROPE INNOVATION Z C | 1,446 | EUR | 3,885,445 | 2.73 |
| CANDRIAM EQUITIES L ONCOLOGY IMPACT Z C | 481 | USD | 1,074,812 | 0.75 |
| CANDRIAM EQUITIES L RISK ARBITRAGE OPPORTUNITIES Z C | 513 | EUR | 736,370 | 0.52 |
| CANDRIAM EQUITIES L ROBOTICS & INNOVATIVE TECHNOLOGY Z C | 482 | USD | 1,744,694 | 1.22 |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME & GROWTH Z C | 788 | EUR | 1,413,672 | 0.99 |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME Z C | 1,666 | EUR | 2,644,309 | 1.86 |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET PREMIA Z C | 372 | EUR | 623,680 | 0.44 |

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 Balanced Asset Allocation

Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

| Bezeichnung | Anzahl | Wahrung | Marktwert (in EUR) | % des NV |
|---|---------|----------|--------------------|--------------|
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EMERGING MARKETS Z C | 717 | USD | 718,643 | 0.50 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO CORPORATE Z C | 17,968 | EUR | 17,394,641 | 12.21 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO Z C | 8,646 | EUR | 7,954,925 | 5.58 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY CIRCULAR ECONOMY Z C | 562 | USD | 735,046 | 0.52 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY CLIMATE ACTION Z C | 1,392 | USD | 2,175,743 | 1.53 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY EMERGING MARKETS Z C | 3,172 | EUR | 6,865,255 | 4.82 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY EUROPE Z C | 2,236 | EUR | 3,865,226 | 2.71 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY QUANT EUROPE Z C | 521 | EUR | 2,343,604 | 1.64 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY US Z C | 10,819 | USD | 10,366,881 | 7.28 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO Z C | 408 | EUR | 435,683 | 0.31 |
| CLEOME INDEX EUROPE EQUITIES Z C | 4,349 | EUR | 10,121,297 | 7.10 |
| CLEOME INDEX USA EQUITIES Z C | 1,139 | USD | 3,679,450 | 2.58 |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE CORPORATE EURO BOND UCITS ETF D | 80,006 | EUR | 1,815,336 | 1.27 |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE EUROPE EQUITY UCITS ETF C | 236,685 | EUR | 8,151,431 | 5.72 |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE JAPAN EQUITY UCITS ETF C | 95,247 | EUR | 3,230,778 | 2.27 |
| | | | 129,396,794 | 90.82 |
| Aktien/Anteile in Anlagementfonds gesamt | | | 132,721,209 | 93.15 |
| Organismen fur gemeinsame Anlagen gesamt | | | 132,721,209 | 93.15 |
| Anlageportfolio gesamt | | | 141,029,391 | 98.98 |
| Erwerbskosten | | | 138,516,279 | |



Candriam L Balanced Asset Allocation

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2023

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

| | |
|--------------------------------|--------------|
| Luxemburg | 90.82 |
| Irland | 3.79 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | 2.00 |
| Frankreich | 1.81 |
| Schweiz | 0.56 |
| | 98.98 |

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

| | |
|---|--------------|
| Anlagefonds | 91.54 |
| Nicht klassifizierbare Institutionen | 2.89 |
| Anleihen von Staaten, Provinzen und Gemeinden | 2.00 |
| Banken und andere Finanzinstitute | 1.62 |
| Lebensmittel und alkoholfreie Getränke | 0.94 |
| | 98.98 |



Candriam L Conservative Asset Allocation

Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

| 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 GOLD ETC | 169,426 | USD | 5,796,357 | 2.93 |
| | | | 5,796,357 | 2.93 |
| Strukturierte Produkte, insgesamt | | | 5,796,357 | 2.93 |
| Aktien | | | | |
| Frankreich | | | | |
| DANONE SA | 6,837 | EUR | 383,829 | 0.19 |
| | | | 383,829 | 0.19 |
| Irland | | | | |
| KERRY GROUP -A- | 4,167 | EUR | 372,446 | 0.19 |
| | | | 372,446 | 0.19 |
| Schweiz | | | | |
| BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT | 200 | CHF | 353,875 | 0.18 |
| NESTLE SA REG SHS | 6,821 | CHF | 751,949 | 0.38 |
| | | | 1,105,824 | 0.56 |
| Aktien gesamt | | | 1,862,099 | 0.94 |
| Variabel verzinsliche Anleihen | | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | |
| UNITED STATES 0.125 22-52 15/02S | 2,999,000 | USD | 1,980,157 | 1.00 |
| UNITED STATES 1.5 23-53 15/02S | 2,171,000 | USD | 1,969,637 | 0.99 |
| | | | 3,949,794 | 2.00 |
| Variabel verzinsliche Anleihen gesamt | | | 3,949,794 | 2.00 |
| Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt | | | 11,608,250 | 5.86 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | | |
| Anteile/Einheiten an Anlagefonds | | | | |
| Frankreich | | | | |
| CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z C | 2,772 | EUR | 4,228,104 | 2.14 |
| | | | 4,228,104 | 2.14 |
| Irland | | | | |
| MW GAVEKAL CHINA FI -A- CAP | 15,040 | USD | 1,913,706 | 0.97 |
| | | | 1,913,706 | 0.97 |
| Luxemburg | | | | |
| CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQUITY MARKET NEUTRAL Z C | 1,534 | EUR | 2,863,288 | 1.45 |
| CANDRIAM BONDS CAPITAL SECURITIES Z C | 1,663 | EUR | 2,569,568 | 1.30 |
| CANDRIAM BONDS CONVERTIBLE DEFENSIVE Z C | 3,524 | EUR | 5,628,357 | 2.84 |
| CANDRIAM BONDS CREDIT ALPHA Z C | 916 | EUR | 1,506,811 | 0.76 |
| CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z C | 2,384 | USD | 2,429,102 | 1.23 |
| CANDRIAM BONDS EMERGING MARKETS CORPORATE Z C | 1,011 | USD | 1,357,715 | 0.69 |
| CANDRIAM BONDS EURO DIVERSIFIED Z C | 28,128 | EUR | 23,522,884 | 11.88 |
| CANDRIAM BONDS EURO GOVERNMENT Z C | 2,076 | EUR | 4,892,281 | 2.47 |
| CANDRIAM BONDS EURO SHORT TERM Z C | 3,709 | EUR | 8,033,212 | 4.06 |
| CANDRIAM BONDS FLOATING RATE NOTES Z C | 749 | EUR | 1,142,854 | 0.58 |
| CANDRIAM BONDS GLOBAL HIGH YIELD Z C | 20,511 | EUR | 5,700,622 | 2.88 |
| CANDRIAM BONDS TOTAL RETURN Z C | 2,744 | EUR | 4,215,854 | 2.13 |
| CANDRIAM EQUITIES L BIOTECHNOLOGY Z C | 609 | USD | 1,171,993 | 0.59 |
| CANDRIAM EQUITIES L EUROPE INNOVATION Z C | 1,095 | EUR | 2,942,298 | 1.49 |
| CANDRIAM EQUITIES L ONCOLOGY IMPACT Z C | 448 | USD | 1,001,073 | 0.51 |
| CANDRIAM EQUITIES L RISK ARBITRAGE OPPORTUNITIES Z C | 911 | EUR | 1,307,668 | 0.66 |
| CANDRIAM EQUITIES L ROBOTICS & INNOVATIVE TECHNOLOGY Z C | 355 | USD | 1,284,993 | 0.65 |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME & GROWTH Z C | 1,612 | EUR | 2,891,928 | 1.46 |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME Z C | 3,320 | EUR | 5,269,570 | 2.66 |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET PREMIA Z C | 757 | EUR | 1,269,156 | 0.64 |

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 Conservative Asset Allocation

Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

| Bezeichnung | Anzahl | Wahrung | Marktwert (in EUR) | % des NV |
|---|---------|----------|--------------------|--------------|
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EMERGING MARKETS Z C | 1,789 | USD | 1,793,099 | 0.91 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO CORPORATE Z C | 34,061 | EUR | 32,974,113 | 16.66 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO Z C | 16,529 | EUR | 15,207,837 | 7.68 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY CIRCULAR ECONOMY Z C | 540 | USD | 706,271 | 0.36 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY CLIMATE ACTION Z C | 1,256 | USD | 1,963,171 | 0.99 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY EMERGING MARKETS Z C | 2,513 | EUR | 5,438,961 | 2.75 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY EUROPE Z C | 1,841 | EUR | 3,182,511 | 1.61 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY QUANT EUROPE Z C | 506 | EUR | 2,276,130 | 1.15 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY US Z C | 9,571 | USD | 9,170,860 | 4.63 |
| CLEOME INDEX EUROPE EQUITIES Z C | 3,521 | EUR | 8,194,318 | 4.14 |
| CLEOME INDEX USA EQUITIES Z C | 889 | USD | 2,871,845 | 1.45 |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE CORPORATE EURO BOND UCITS ETF D | 167,355 | EUR | 3,797,285 | 1.92 |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE EUROPE EQUITY UCITS ETF C | 197,938 | EUR | 6,816,985 | 3.44 |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE JAPAN EQUITY UCITS ETF C | 77,810 | EUR | 2,639,315 | 1.33 |
| | | | 178,033,928 | 89.94 |
| Aktien/Anteile in Anlagementfonds gesamt | | | 184,175,738 | 93.04 |
| Organismen fur gemeinsame Anlagen gesamt | | | 184,175,738 | 93.04 |
| Anlageportfolio gesamt | | | 195,783,988 | 98.90 |
| Erwerbskosten | | | 195,004,407 | |



Candriam L Conservative Asset Allocation

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2023

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

| | |
|--------------------------------|--------------|
| Luxemburg | 89.94 |
| Irland | 4.08 |
| Frankreich | 2.33 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | 2.00 |
| Schweiz | 0.56 |
| | 98.90 |

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

| | |
|---|--------------|
| Anlagefonds | 90.90 |
| Nicht klassifizierbare Institutionen | 2.93 |
| Banken und andere Finanzinstitute | 2.14 |
| Anleihen von Staaten, Provinzen und Gemeinden | 2.00 |
| Lebensmittel und alkoholfreie Getränke | 0.94 |
| | 98.90 |



Candriam L Dynamic Asset Allocation

Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

| 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 GOLD ETC | 10,616 | USD | 363,192 | 2.88 |
| | | | 363,192 | 2.88 |
| Strukturierte Produkte, insgesamt | | | 363,192 | 2.88 |
| Aktien | | | | |
| Frankreich | | | | |
| DANONE SA | 433 | EUR | 24,309 | 0.19 |
| | | | 24,309 | 0.19 |
| Irland | | | | |
| KERRY GROUP -A- | 264 | EUR | 23,596 | 0.19 |
| | | | 23,596 | 0.19 |
| Schweiz | | | | |
| BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT | 13 | CHF | 23,002 | 0.18 |
| NESTLE SA REG SHS | 432 | CHF | 47,624 | 0.38 |
| | | | 70,626 | 0.56 |
| Aktien gesamt | | | 118,531 | 0.94 |
| Variabel verzinsliche Anleihen | | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | |
| UNITED STATES 0.125 22-52 15/02S | 192,500 | USD | 127,102 | 1.01 |
| UNITED STATES 1.5 23-53 15/02S | 139,300 | USD | 126,380 | 1.00 |
| | | | 253,482 | 2.01 |
| Variabel verzinsliche Anleihen gesamt | | | 253,482 | 2.01 |
| Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt | | | 735,205 | 5.82 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | | |
| Anteile/Einheiten an Anlagefonds | | | | |
| Frankreich | | | | |
| CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z C | 63 | EUR | 96,093 | 0.76 |
| | | | 96,093 | 0.76 |
| Irland | | | | |
| MW GAVEKAL CHINA FI -A- CAP | 372 | USD | 47,334 | 0.37 |
| | | | 47,334 | 0.37 |
| Luxemburg | | | | |
| CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQUITY MARKET NEUTRAL Z C | 33 | EUR | 61,596 | 0.49 |
| CANDRIAM BONDS CAPITAL SECURITIES Z C | 40 | EUR | 61,806 | 0.49 |
| CANDRIAM BONDS CONVERTIBLE DEFENSIVE Z C | 82 | EUR | 130,966 | 1.04 |
| CANDRIAM BONDS CREDIT ALPHA Z C | 21 | EUR | 34,545 | 0.27 |
| CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z C | 69 | USD | 70,305 | 0.56 |
| CANDRIAM BONDS EMERGING MARKETS CORPORATE Z C | 25 | USD | 33,574 | 0.27 |
| CANDRIAM BONDS EURO DIVERSIFIED Z C | 617 | EUR | 515,985 | 4.08 |
| CANDRIAM BONDS EURO GOVERNMENT Z C | 193 | EUR | 454,822 | 3.60 |
| CANDRIAM BONDS EURO SHORT TERM Z C | 111 | EUR | 240,412 | 1.90 |
| CANDRIAM BONDS FLOATING RATE NOTES Z C | 16 | EUR | 24,413 | 0.19 |
| CANDRIAM BONDS GLOBAL HIGH YIELD Z C | 457 | EUR | 127,014 | 1.01 |
| CANDRIAM BONDS TOTAL RETURN Z C | 60 | EUR | 92,183 | 0.73 |
| CANDRIAM EQUITIES L BIOTECHNOLOGY Z C | 99 | USD | 190,521 | 1.51 |
| CANDRIAM EQUITIES L EUROPE INNOVATION Z C | 192 | EUR | 515,910 | 4.08 |
| CANDRIAM EQUITIES L ONCOLOGY IMPACT Z C | 66 | USD | 147,479 | 1.17 |
| CANDRIAM EQUITIES L RISK ARBITRAGE OPPORTUNITIES Z C | 21 | EUR | 30,144 | 0.24 |
| CANDRIAM EQUITIES L ROBOTICS & INNOVATIVE TECHNOLOGY Z C | 35 | USD | 126,689 | 1.00 |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME & GROWTH Z C | 32 | EUR | 57,408 | 0.45 |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME Z C | 72 | EUR | 114,280 | 0.90 |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET PREMIA Z C | 18 | EUR | 30,178 | 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 Dynamic Asset Allocation

Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

| Bezeichnung | Anzahl | Wahrung | Marktwert (in EUR) | % des NV |
|---|--------|----------|--------------------|--------------|
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EMERGING MARKETS Z C | 34 | USD | 34,078 | 0.27 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO CORPORATE Z C | 773 | EUR | 748,334 | 5.92 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO Z C | 355 | EUR | 326,625 | 2.59 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY CIRCULAR ECONOMY Z C | 69 | USD | 90,246 | 0.71 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY CLIMATE ACTION Z C | 181 | USD | 282,909 | 2.24 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY EMERGING MARKETS Z C | 404 | EUR | 874,389 | 6.92 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY EUROPE Z C | 332 | EUR | 573,429 | 4.54 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY QUANT EUROPE Z C | 81 | EUR | 364,361 | 2.88 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY US Z C | 1,274 | USD | 1,220,871 | 9.66 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO Z C | 35 | EUR | 37,375 | 0.30 |
| CLEOME INDEX EUROPE EQUITIES Z C | 663 | EUR | 1,542,980 | 12.21 |
| CLEOME INDEX USA EQUITIES Z C | 138 | USD | 445,798 | 3.53 |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE CORPORATE EURO BOND UCITS ETF D | 3,649 | EUR | 82,796 | 0.66 |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE EUROPE EQUITY UCITS ETF C | 36,576 | EUR | 1,259,677 | 9.97 |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE JAPAN EQUITY UCITS ETF C | 12,600 | EUR | 427,392 | 3.38 |
| Aktien/Anteile in Anlagementfonds gesamt | | | 11,371,490 | 90.02 |
| Organismen fur gemeinsame Anlagen gesamt | | | 11,514,917 | 91.15 |
| Anlageportfolio gesamt | | | 12,250,122 | 96.97 |
| Erwerbskosten | | | 11,762,478 | |



Candriam L Dynamic Asset Allocation

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2023

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

| | |
|--------------------------------|--------------|
| Luxemburg | 90.02 |
| Irland | 3.44 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | 2.01 |
| Frankreich | 0.95 |
| Schweiz | 0.56 |
| | 96.97 |

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

| | |
|---|--------------|
| Anlagefonds | 90.39 |
| Nicht klassifizierbare Institutionen | 2.88 |
| Anleihen von Staaten, Provinzen und Gemeinden | 2.01 |
| Lebensmittel und alkoholfreie Getränke | 0.94 |
| Banken und andere Finanzinstitute | 0.76 |
| | 96.97 |



Candriam L Multi-Asset Income

Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

| Bezeichnung | Anzahl | Währung | 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 GOLD ETC | 284,765 | USD | 9,742,304 | 2.87 |
| | | | 9,742,304 | 2.87 |
| Strukturierte Produkte, insgesamt | | | 9,742,304 | 2.87 |
| Aktien | | | | |
| Belgien | | | | |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV | 3,227 | EUR | 167,255 | 0.05 |
| KBC GROUPE SA | 2,621 | EUR | 167,534 | 0.05 |
| | | | 334,789 | 0.10 |
| Kanada | | | | |
| ROYAL BANK OF CANADA | 2,369 | CAD | 207,610 | 0.06 |
| | | | 207,610 | 0.06 |
| Dänemark | | | | |
| ORSTED | 9,269 | DKK | 802,671 | 0.24 |
| | | | 802,671 | 0.24 |
| Frankreich | | | | |
| AIR LIQUIDE SA | 5,367 | EUR | 881,261 | 0.26 |
| AXA SA | 4,622 | EUR | 124,910 | 0.04 |
| DANONE SA | 16,705 | EUR | 937,819 | 0.28 |
| LEGRAND SA | 9,514 | EUR | 863,871 | 0.25 |
| L'OREAL SA | 2,605 | EUR | 1,112,596 | 0.33 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 337 | EUR | 290,831 | 0.09 |
| PERNOD RICARD SA | 5,330 | EUR | 1,078,792 | 0.32 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 5,362 | EUR | 892,559 | 0.26 |
| VINCI SA | 2,124 | EUR | 225,951 | 0.07 |
| | | | 6,408,590 | 1.89 |
| Deutschland | | | | |
| ALLIANZ SE REG SHS | 3,818 | EUR | 813,998 | 0.24 |
| BEIERSDORF AG | 9,091 | EUR | 1,102,284 | 0.32 |
| MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG REG SHS | 2,641 | EUR | 907,448 | 0.27 |
| SAP AG | 7,879 | EUR | 985,978 | 0.29 |
| SIEMENS AG REG | 982 | EUR | 149,794 | 0.04 |
| SIEMENS HEALTHINEERS | 20,282 | EUR | 1,051,825 | 0.31 |
| | | | 5,011,327 | 1.47 |
| Irland | | | | |
| LINDE PLC | 380 | USD | 132,810 | 0.04 |
| | | | 132,810 | 0.04 |
| Italien | | | | |
| ENEL SPA | 142,423 | EUR | 878,465 | 0.26 |
| | | | 878,465 | 0.26 |
| Japan | | | | |
| DAIKIN INDUSTRIES LTD | 644 | JPY | 119,519 | 0.04 |
| HOYA CORP | 800 | JPY | 86,627 | 0.03 |
| MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC | 22,400 | JPY | 151,286 | 0.04 |
| NINTENDO CO LTD | 2,300 | JPY | 95,420 | 0.03 |
| SHIMANO INC | 1,100 | JPY | 167,140 | 0.05 |
| | | | 619,992 | 0.18 |
| Niederländische Antillen | | | | |
| SCHLUMBERGER LTD | 4,556 | USD | 205,124 | 0.06 |
| | | | 205,124 | 0.06 |
| Niederlande | | | | |
| AKZO NOBEL NV | 11,026 | EUR | 823,863 | 0.24 |
| ASML HOLDING NV | 188 | EUR | 124,644 | 0.04 |
| HEINEKEN NV | 12,052 | EUR | 1,135,057 | 0.33 |
| | | | 2,083,564 | 0.61 |

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 2023

| Bezeichnung | Anzahl | Wahrung | Marktwert (in EUR) | % des NV |
|---------------------------------------|--------|----------|--------------------|-------------|
| Spanien | | | | |
| IBERDROLA SA | 88,186 | EUR | 1,053,823 | 0.31 |
| | | | 1,053,823 | 0.31 |
| Schweiz | | | | |
| DSM FIRMENICH | 7,767 | EUR | 765,982 | 0.23 |
| NESTLE SA REG SHS | 12,508 | CHF | 1,378,885 | 0.41 |
| ROCHE HOLDING LTD | 3,076 | CHF | 861,929 | 0.25 |
| SIKA - REGISTERED SHS | 2,764 | CHF | 724,097 | 0.21 |
| | | | 3,730,893 | 1.10 |
| Grobritannien | | | | |
| ASTRAZENECA PLC | 1,555 | GBP | 204,325 | 0.06 |
| DIAGEO PLC | 3,863 | GBP | 152,107 | 0.04 |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 16,329 | GBP | 1,124,944 | 0.33 |
| RELX PLC | 8,366 | EUR | 255,518 | 0.08 |
| UNILEVER | 4,500 | GBP | 214,866 | 0.06 |
| | | | 1,951,760 | 0.57 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | |
| ABBOTT LABORATORIES | 1,771 | USD | 176,970 | 0.05 |
| ADOBE INC | 1,004 | USD | 449,996 | 0.13 |
| ADVANCED MICRO DEVICES INC | 1,480 | USD | 154,525 | 0.05 |
| ALPHABET INC -A- | 5,439 | USD | 596,745 | 0.18 |
| AMAZON.COM INC | 2,294 | USD | 274,103 | 0.08 |
| AMGEN INC | 515 | USD | 104,803 | 0.03 |
| ANALOG DEVICES INC | 1,464 | USD | 261,413 | 0.08 |
| APPLE INC | 6,452 | USD | 1,147,108 | 0.34 |
| BANK OF AMERICA CORP | 5,111 | USD | 134,404 | 0.04 |
| BROADCOM INC - REGISTERED SHS | 268 | USD | 213,081 | 0.06 |
| BROWN AND BROWN INC | 1,371 | USD | 86,507 | 0.03 |
| CATERPILLAR - REGISTERED | 1,655 | USD | 373,247 | 0.11 |
| COCA-COLA CO | 2,828 | USD | 156,097 | 0.05 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 2,882 | USD | 238,802 | 0.07 |
| DANAHER CORP | 1,015 | USD | 223,281 | 0.07 |
| ELECTRONIC ARTS - REGISTERED | 8,762 | USD | 1,041,642 | 0.31 |
| ELI LILLY & CO | 376 | USD | 161,628 | 0.05 |
| EMERSON ELECTRIC CO | 1,272 | USD | 105,386 | 0.03 |
| ESTEE LAUDER COMPANIES INC -A- | 367 | USD | 66,060 | 0.02 |
| FORTIVE CORP | 1,389 | USD | 95,193 | 0.03 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 11,662 | USD | 1,208,743 | 0.36 |
| JOHNSON & JOHNSON | 3,689 | USD | 559,673 | 0.16 |
| JPMORGAN CHASE CO | 2,373 | USD | 316,342 | 0.09 |
| LAM RESEARCH CORP | 304 | USD | 179,129 | 0.05 |
| MASTERCARD INC -A- | 601 | USD | 216,657 | 0.06 |
| MCDONALD'S CORP | 1,361 | USD | 372,260 | 0.11 |
| MERCK & CO INC | 3,258 | USD | 344,584 | 0.10 |
| MICROSOFT CORP | 3,557 | USD | 1,110,267 | 0.33 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 3,821 | USD | 255,457 | 0.08 |
| MORGAN STANLEY | 2,583 | USD | 202,189 | 0.06 |
| NIKE INC | 1,242 | USD | 125,646 | 0.04 |
| OTIS WORLDWIDE CORPORATION | 2,385 | USD | 194,582 | 0.06 |
| OWENS CORNING SHS | 7,850 | USD | 938,978 | 0.28 |
| PALO ALTO NETWORKS | 5,861 | USD | 1,372,634 | 0.40 |
| PARKER-HANNIFIN CORP | 537 | USD | 191,981 | 0.06 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 1,173 | USD | 163,145 | 0.05 |
| PTC INC | 9,821 | USD | 1,280,961 | 0.38 |
| S&P GLOBAL INC | 711 | USD | 261,258 | 0.08 |
| STARBUCKS CORP | 2,294 | USD | 208,289 | 0.06 |
| STRYKER CORP | 641 | USD | 179,251 | 0.05 |
| THERMO FISHER SCIENT SHS | 2,695 | USD | 1,288,832 | 0.38 |
| TJX COS INC | 1,335 | USD | 103,753 | 0.03 |

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 Income

Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

| Bezeichnung | Anzahl | Wahrung | Marktwert (in EUR) | % des NV |
|---|------------|----------|--------------------|--------------|
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 792 | USD | 348,916 | 0.10 |
| VALERO ENERGY CORP | 1,944 | USD | 209,011 | 0.06 |
| VISA INC -A- | 2,012 | USD | 437,956 | 0.13 |
| WASTE MANAGEMENT | 2,145 | USD | 340,959 | 0.10 |
| | | | 18,472,444 | 5.43 |
| Aktien gesamt | | | 41,893,862 | 12.32 |
| Anleihen | | | | |
| osterreich | | | | |
| AUSTRIA 0.5 19-29 20/02A | 2,107,000 | EUR | 1,842,593 | 0.54 |
| AUSTRIA 2.40 13-34 23/05A | 731,000 | EUR | 688,313 | 0.20 |
| | | | 2,530,906 | 0.74 |
| Belgien | | | | |
| BELGIUM 1.00 15-31 22/06A | 885,000 | EUR | 765,472 | 0.23 |
| BELGIUM 3.75 13-45 22/06A | 870,000 | EUR | 927,690 | 0.27 |
| | | | 1,693,162 | 0.50 |
| Kanada | | | | |
| ROYAL BANK OF CANADA 0.125 19-24 23/07A | 1,450,000 | EUR | 1,390,869 | 0.41 |
| TORONTO DOMINION BK 2.551 22-27 03/08A | 1,900,000 | EUR | 1,783,482 | 0.52 |
| | | | 3,174,351 | 0.93 |
| Frankreich | | | | |
| ARVAL SERVICE LEASE 4.75 22-27 22/05A5A | 2,000,000 | EUR | 2,019,330 | 0.59 |
| BANQUE FEDERATIVE DU 1.25 20-30 03/06A | 4,600,000 | EUR | 3,746,148 | 1.10 |
| BFCM 0.125 19-24 05/02A | 1,400,000 | EUR | 1,368,297 | 0.40 |
| BNP PARIBAS 1.00 18-24 17/04A | 1,400,000 | EUR | 1,368,311 | 0.40 |
| BPCE S.A. 0.625 20-30 15/01A | 3,500,000 | EUR | 2,816,642 | 0.83 |
| CAPGEMINI SE 0.625 20-25 23/06A | 800,000 | EUR | 751,444 | 0.22 |
| FAURECIA 7.25 22-26 15/06S | 2,350,000 | EUR | 2,448,406 | 0.72 |
| FRAN TREA BILL BTF ZCP 20-03-24 | 10,100,000 | EUR | 9,777,369 | 2.88 |
| FRANCE 1.00 15-25 25/11A | 4,098,000 | EUR | 3,896,686 | 1.15 |
| FRANCE 1.75 17-39 25/06A | 3,144,000 | EUR | 2,612,507 | 0.77 |
| FRANCE 3.25 12-45 25/05A | 1,509,270 | EUR | 1,515,639 | 0.45 |
| FREN REP PRES ZCP 24-01-24 | 5,300,000 | EUR | 5,144,432 | 1.51 |
| ORANGE SA 1.1250 19-24 15/07A | 2,000,000 | EUR | 1,944,080 | 0.57 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE 0.00 20-26 15/06U | 8,000 | EUR | 1,527,756 | 0.45 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE 0.25 16-24 09/09A | 600,000 | EUR | 575,772 | 0.17 |
| SOCIETE GENERALE SA 0.75 20-27 23/01A | 3,900,000 | EUR | 3,417,980 | 1.01 |
| VERALLIA SASU 1.625 21-28 14/05A | 3,100,000 | EUR | 2,735,905 | 0.80 |
| | | | 47,666,704 | 14.02 |
| Deutschland | | | | |
| ADIDAS AG 0.00 20-24 09/09U | 500,000 | EUR | 477,860 | 0.14 |
| GERM TREA BILL ZCP 20-03-24 | 10,100,000 | EUR | 9,787,728 | 2.88 |
| GERM TREA BILL ZCP 21-02-24 | 5,300,000 | EUR | 5,132,745 | 1.51 |
| GERMANY 1.00 15-25 15/08A | 3,800,000 | EUR | 3,638,405 | 1.07 |
| GERMANY 2.50 12-44 04/07A | 783,000 | EUR | 790,744 | 0.23 |
| SCHAEFFLER AG 3.375 20-28 12/10A | 2,700,000 | EUR | 2,468,667 | 0.73 |
| VONOVIA SE 0.375 21-27 16/06A | 4,500,000 | EUR | 3,745,260 | 1.10 |
| ZF FINANCE GMBH 2.2500 21-28 03/05A | 2,900,000 | EUR | 2,449,932 | 0.72 |
| | | | 28,491,341 | 8.38 |
| Italien | | | | |
| BUONI POLIENNAL 3.8500 18-49 01/09S | 1,635,000 | EUR | 1,526,788 | 0.45 |
| INTE 4.75 22-27 06/09A | 2,000,000 | EUR | 2,009,410 | 0.59 |
| INTESA SANPAOLO 2.1250 20-25 26/05A | 1,000,000 | EUR | 958,385 | 0.28 |
| ITALY 4.50 13-24 01/03S | 5,137,000 | EUR | 5,159,295 | 1.52 |
| ITALY 4.75 13-28 01/09S | 2,426,000 | EUR | 2,544,134 | 0.75 |
| ITALY 5.00 09-40 01/09S | 1,057,000 | EUR | 1,153,620 | 0.34 |
| ITALY BUONI TES BOT ZCP 140224 | 5,300,000 | EUR | 5,125,673 | 1.51 |
| ITALY BUONI TES BOT ZCP 140324 | 10,100,000 | EUR | 9,771,267 | 2.87 |
| | | | 28,248,572 | 8.31 |

Die Erlauterungen 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 2023

| Bezeichnung | Anzahl | Wahrung | Marktwert (in EUR) | % des NV |
|--|------------|----------|--------------------|--------------|
| Niederlande | | | | |
| ENEL FINANCE INTL 3.875 22-29 09/03A/03A | 1,600,000 | EUR | 1,598,840 | 0.47 |
| NETHERLANDS 0.25 19-29 14/02A | 2,534,000 | EUR | 2,192,417 | 0.64 |
| | | | 3,791,257 | 1.12 |
| Portugal | | | | |
| PORTUGAL 4.125 17-27 14/04A | 1,465,000 | EUR | 1,526,918 | 0.45 |
| | | | 1,526,918 | 0.45 |
| Spanien | | | | |
| CELLNEX FINANCE CO 2.25 22-26 12/04A | 1,500,000 | EUR | 1,407,380 | 0.41 |
| SPAI LETR DEL TESO ZCP 08-03-24 | 10,100,000 | EUR | 9,787,989 | 2.88 |
| SPAIN (BON.ESTATADO) 1.25 20-30 31/10A | 2,242,000 | EUR | 1,953,668 | 0.57 |
| SPAIN 1.85 19-35 05/03A | 2,120,000 | EUR | 1,781,521 | 0.52 |
| SPAIN 2.75 14-24 31/10A | 3,137,000 | EUR | 3,109,583 | 0.91 |
| SPAIN LETRAS DEL TES ZCP 090224 | 5,300,000 | EUR | 5,134,704 | 1.51 |
| | | | 23,174,845 | 6.82 |
| Grobritannien | | | | |
| CREDIT AGRICOLE 0.50 19-24 24/06A | 1,400,000 | EUR | 1,353,793 | 0.40 |
| VMED O2 UK FIN I PLC 4.5 21-31 15/07SS | 2,700,000 | GBP | 2,395,347 | 0.70 |
| | | | 3,749,140 | 1.10 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | |
| ABBOTT LABORATORIES 1.4000 20-30 30/06S | 800,000 | USD | 602,390 | 0.18 |
| AMAZON.COM INC 4.95 14-44 05/12S | 500,000 | USD | 464,418 | 0.14 |
| AMERICAN TOWER CORP 1 20-32 10/09A | 3,500,000 | EUR | 2,622,812 | 0.77 |
| AT&T INC 2.60 14-29 17/12A | 3,400,000 | EUR | 3,129,836 | 0.92 |
| AVANTOR FUNDING 3.8750 21-29 01/11S | 3,000,000 | USD | 2,409,713 | 0.71 |
| BANK OF AMERICA CO 3.875 15-25 01/08S | 1,500,000 | USD | 1,337,420 | 0.39 |
| BERRY GLOBAL INC 5.5000 23-28 15/04S | 1,700,000 | USD | 1,536,661 | 0.45 |
| CENTENE CORP 4.2500 19-27 15/12S | 2,400,000 | USD | 2,058,555 | 0.61 |
| CROWN AMERICAS LLC4.7519-26 01/02S | 2,700,000 | USD | 2,403,862 | 0.71 |
| DARLING INGREDI 6.0000 22-30 15/06S | 1,750,000 | USD | 1,568,303 | 0.46 |
| ELI LILLY & CO 3.3750 19-29 15/03S | 1,200,000 | USD | 1,034,530 | 0.30 |
| FORD MOTOR CREDIT CO 5.584 19-24 18/03S | 2,600,000 | USD | 2,368,872 | 0.70 |
| HCA INC 3.5 20-30 01/09S | 2,700,000 | USD | 2,171,533 | 0.64 |
| HILTON DOMESTIC 3.620 21-32 15/02S | 3,150,000 | USD | 2,410,010 | 0.71 |
| IQVIA INC 2.875 20-28 24/06S | 2,450,000 | EUR | 2,212,828 | 0.65 |
| LEVI STRAUSS & CO 3.375 17-27 15/03S | 2,630,000 | EUR | 2,499,250 | 0.74 |
| MERCK & CO INC 2.75 15-25 10/02A | 700,000 | USD | 618,008 | 0.18 |
| MICROSOFT CORP 4.25 17-47 06/02S | 300,000 | USD | 267,718 | 0.08 |
| MORGAN STANLEY 4.00 15-25 23/07S | 1,500,000 | USD | 1,335,502 | 0.39 |
| NETFLIX INC 3.6250 19-30 15/06S | 2,650,000 | EUR | 2,528,617 | 0.74 |
| NOVELIS CORP 3.875 21-31 15/08S | 2,900,000 | USD | 2,189,176 | 0.64 |
| PEPSICO INC 2.75 20-30 19/03S | 1,000,000 | USD | 823,900 | 0.24 |
| PROLOGIS EURO FINANC 3.875 23-30 31/01A | 4,000,000 | EUR | 3,884,740 | 1.14 |
| THERMO FISHER SCIENT 0.1250 19-25 01/03A | 1,450,000 | EUR | 1,361,122 | 0.40 |
| T-MOBILE USA IN 5.3750 17-27 15/04S | 750,000 | USD | 683,596 | 0.20 |
| VERIZON COMMUNICATIO 3.15 20-30 20/03S | 1,400,000 | USD | 1,141,411 | 0.34 |
| | | | 45,664,783 | 13.43 |
| Anleihen gesamt | | | 189,711,979 | 55.81 |
| Wandelanleihen | | | | |
| Frankreich | | | | |
| ELIS SA CV 2.25 22-29 22/09A22-29 22/09A | 1,300,000 | EUR | 1,611,831 | 0.47 |
| | | | 1,611,831 | 0.47 |
| Spanien | | | | |
| CELLNEX TELECOM SA 0.50 19-28 05/07A | 1,200,000 | EUR | 1,257,270 | 0.37 |
| | | | 1,257,270 | 0.37 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | |
| JPMORGAN CHASE BANK 0.0 21-24 18/02U | 2,700,000 | EUR | 2,862,054 | 0.84 |
| | | | 2,862,054 | 0.84 |

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 Income

Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

| Bezeichnung | Anzahl | Wahrung | Marktwert (in EUR) | % des NV |
|--|-----------|----------|--------------------|--------------|
| Wandelanleihen gesamt | | | 5,731,155 | 1.69 |
| Variabel verzinsliche Anleihen | | | | |
| Belgien | | | | |
| KBC GROUPE FL.R 22-27 23/11A | 3,900,000 | EUR | 3,875,918 | 1.14 |
| | | | 3,875,918 | 1.14 |
| Frankreich | | | | |
| AXA SA FL.R 14-XX 07/11A | 2,180,000 | EUR | 2,128,247 | 0.63 |
| BNP PARIBAS FL.R 19-26 04/12A | 4,000,000 | EUR | 3,724,140 | 1.10 |
| CREDIT AGRICOLE FL.R 16-48 27/09A | 2,400,000 | EUR | 2,310,324 | 0.68 |
| LA BANQUE POSTALE FL.R 21-32 02/02A | 1,100,000 | EUR | 889,212 | 0.26 |
| | | | 9,051,923 | 2.66 |
| Deutschland | | | | |
| ALLIANZ SE FL.R 17-47 06/07A | 2,300,000 | EUR | 2,142,140 | 0.63 |
| | | | 2,142,140 | 0.63 |
| Italien | | | | |
| ENEL FL.R 23-XX 16/07A | 3,700,000 | EUR | 3,732,782 | 1.10 |
| UNICREDIT SPA FL.R 20-26 16/06A | 2,400,000 | EUR | 2,253,600 | 0.66 |
| UNICREDIT SPA FL.R 21-29 05/07A | 2,000,000 | EUR | 1,676,930 | 0.49 |
| | | | 7,663,312 | 2.25 |
| Niederlande | | | | |
| IBERDROLA INTL BV FL.R 18-XX 26/03A | 2,400,000 | EUR | 2,367,384 | 0.70 |
| ING GROUP NV FL.R 17-29 26/09A | 1,700,000 | EUR | 1,608,081 | 0.47 |
| ING GROUP NV FL.R 22-27 16/02A | 2,000,000 | EUR | 1,832,020 | 0.54 |
| | | | 5,807,485 | 1.71 |
| Spanien | | | | |
| BANCO DE SABADELL SA FL.R 21-28 16/06A | 3,800,000 | EUR | 3,191,495 | 0.94 |
| BANCO NTANDER FL.R 22-26 27/09A | 3,600,000 | EUR | 3,536,064 | 1.04 |
| IBERDROLA FINANZA SAU FL.R 21-99 31/12A | 1,500,000 | EUR | 1,265,002 | 0.37 |
| | | | 7,992,561 | 2.35 |
| Grobritannien | | | | |
| BARCLAYS PLC 0.453 21-26 12/05Q | 1,700,000 | EUR | 1,689,196 | 0.50 |
| NATWEST GROUP PLC FL.R 22-28 06/09A | 1,600,000 | EUR | 1,552,584 | 0.46 |
| | | | 3,241,780 | 0.95 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | |
| CITIGROUP FL.R 22-28 22/09A | 3,000,000 | EUR | 2,930,640 | 0.86 |
| THERMO FISHER SCIENTIF FL.R 21-24 18/10Q | 2,798,000 | USD | 2,563,427 | 0.75 |
| | | | 5,494,067 | 1.62 |
| Variabel verzinsliche Anleihen gesamt | | | 45,269,186 | 13.32 |
| bertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Brse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt | | | 292,348,486 | 86.01 |
| Organismen fr gemeinsame Anlagen | | | | |
| Anteile/Einheiten an Anlagefonds | | | | |
| Luxemburg | | | | |
| CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQUITY MARKET NEUTRAL Z C | 3,262 | EUR | 6,099,385 | 1.79 |
| CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z C | 18,711 | USD | 18,949,046 | 5.57 |
| CANDRIAM BONDS EMERGING MARKETS TOTAL RETURN Z C | 1,214 | USD | 1,712,007 | 0.50 |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EMERGING MARKETS Z C | 1,681 | USD | 1,682,125 | 0.49 |
| LUMYNA MW TOPS MN UCITS CL B | 19,834 | EUR | 3,532,112 | 1.04 |
| | | | 31,974,675 | 9.41 |
| Aktien/Anteile in Anlagementfonds gesamt | | | 31,974,675 | 9.41 |
| Organismen fr gemeinsame Anlagen gesamt | | | 31,974,675 | 9.41 |
| Anlageportfolio gesamt | | | 324,323,161 | 95.41 |
| Erwerbskosten | | | 336,760,745 | |

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

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



Candriam L Multi-Asset Income

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2023

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

| | |
|--------------------------------|--------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika | 21.33 |
| Frankreich | 19.05 |
| Italien | 10.82 |
| Deutschland | 10.49 |
| Spanien | 9.85 |
| Luxemburg | 9.41 |
| Niederlande | 3.44 |
| Irland | 2.91 |
| Großbritannien | 2.63 |
| Belgien | 1.74 |
| Schweiz | 1.10 |
| Kanada | 0.99 |
| Österreich | 0.74 |
| Portugal | 0.45 |
| Dänemark | 0.24 |
| Japan | 0.18 |
| Niederländische Antillen | 0.06 |
| | 95.41 |

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

| | |
|---|--------------|
| Anleihen von Staaten, Provinzen und Gemeinden | 28.62 |
| Banken und andere Finanzinstitute | 22.79 |
| Anlagefonds | 9.41 |
| Internet und Internet-Dienste | 3.06 |
| Immobilien | 3.02 |
| Nicht klassifizierbare Institutionen | 2.87 |
| Versicherungen | 2.50 |
| Versorger | 2.43 |
| Pharmazeutika | 2.41 |
| Kommunikation | 2.40 |
| Gesundheitswesen | 2.00 |
| Elektrotechnik | 1.91 |
| Elektronik und Halbleiter | 1.83 |
| Kraftfahrzeuge | 1.50 |
| Lebensmittel und alkoholfreie Getränke | 1.11 |
| Textilien und Bekleidung | 1.00 |
| Sonstige Dienstleistungen | 0.83 |
| Verpackungsindustrie | 0.80 |
| Tabak und alkoholische Getränke | 0.75 |
| Chemikalien | 0.71 |
| Kohlebergbau und Stahlindustrie & Chemie | 0.64 |
| Transport | 0.59 |
| Büroausstattung und Computer | 0.40 |
| Sonstige Konsumgüter | 0.38 |
| Baumaterialien | 0.34 |
| Maschinen- und Apparatebau | 0.32 |
| Einzelhandel und Warenhäuser | 0.25 |
| Hotels und Restaurants | 0.17 |
| Grafik und Verlage | 0.15 |
| Erdöl | 0.12 |
| Umweltdienste und Recycling | 0.10 |
| | 95.41 |

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



Candriam L Multi-Asset Income & Growth

Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

| 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 GOLD ETC | 106,213 | USD | 3,633,731 | 2.85 |
| | | | 3,633,731 | 2.85 |
| Strukturierte Produkte, insgesamt | | | 3,633,731 | 2.85 |
| Aktien | | | | |
| Belgien | | | | |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV | 2,824 | EUR | 146,368 | 0.11 |
| KBC GROUPE SA | 3,870 | EUR | 247,370 | 0.19 |
| | | | 393,738 | 0.31 |
| Kanada | | | | |
| ROYAL BANK OF CANADA | 1,943 | CAD | 170,277 | 0.13 |
| | | | 170,277 | 0.13 |
| Dänemark | | | | |
| ORSTED | 6,600 | DKK | 571,543 | 0.45 |
| | | | 571,543 | 0.45 |
| Frankreich | | | | |
| AIR LIQUIDE SA | 3,722 | EUR | 611,152 | 0.48 |
| AXA SA | 4,255 | EUR | 114,991 | 0.09 |
| BUREAU VERITAS SA | 15,239 | EUR | 382,804 | 0.30 |
| CIE DE SAINT-GOBAIN | 7,650 | EUR | 426,334 | 0.33 |
| DANONE SA | 7,712 | EUR | 432,952 | 0.34 |
| KERING | 543 | EUR | 274,541 | 0.22 |
| LEGRAND SA | 6,764 | EUR | 614,171 | 0.48 |
| L'OREAL SA | 1,453 | EUR | 620,576 | 0.49 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 715 | EUR | 617,045 | 0.48 |
| PERNOD RICARD SA | 2,981 | EUR | 603,354 | 0.47 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 3,725 | EUR | 620,064 | 0.49 |
| VINCI SA | 1,517 | EUR | 161,378 | 0.13 |
| | | | 5,479,362 | 4.29 |
| Deutschland | | | | |
| ALLIANZ SE REG SHS | 2,075 | EUR | 442,390 | 0.35 |
| BEIERSDORF AG | 5,070 | EUR | 614,738 | 0.48 |
| MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG REG SHS | 1,295 | EUR | 444,962 | 0.35 |
| SAP AG | 3,752 | EUR | 469,525 | 0.37 |
| SIEMENS AG REG | 3,911 | EUR | 596,584 | 0.47 |
| SIEMENS HEALTHINEERS | 15,118 | EUR | 784,019 | 0.61 |
| | | | 3,352,218 | 2.63 |
| Irland | | | | |
| LINDE PLC | 564 | USD | 197,118 | 0.15 |
| | | | 197,118 | 0.15 |
| Italien | | | | |
| ENEL SPA | 97,261 | EUR | 599,906 | 0.47 |
| | | | 599,906 | 0.47 |
| Japan | | | | |
| DAIKIN INDUSTRIES LTD | 970 | JPY | 180,021 | 0.14 |
| HOYA CORP | 700 | JPY | 75,799 | 0.06 |
| MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC | 20,600 | JPY | 139,129 | 0.11 |
| NINTENDO CO LTD | 4,500 | JPY | 186,692 | 0.15 |
| SHIMANO INC | 600 | JPY | 91,168 | 0.07 |
| | | | 672,809 | 0.53 |
| Niederländische Antillen | | | | |
| SCHLUMBERGER LTD | 3,965 | USD | 178,516 | 0.14 |
| | | | 178,516 | 0.14 |
| Niederlande | | | | |
| AKZO NOBEL NV | 7,459 | EUR | 557,336 | 0.44 |
| ASML HOLDING NV | 179 | EUR | 118,677 | 0.09 |

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 Income & Growth

Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

| Bezeichnung | Anzahl | Wahrung | Marktwert (in EUR) | % des NV |
|---------------------------------------|--------|----------|--------------------|-------------|
| HEINEKEN NV | 6,648 | EUR | 626,109 | 0.49 |
| STMICROELECTRONICS NV | 9,995 | EUR | 455,422 | 0.36 |
| | | | 1,757,544 | 1.38 |
| Spanien | | | | |
| IBERDROLA SA | 67,642 | EUR | 808,322 | 0.63 |
| | | | 808,322 | 0.63 |
| Schweiz | | | | |
| DSM FIRMENICH | 4,152 | EUR | 409,470 | 0.32 |
| NESTLE SA REG SHS | 7,629 | CHF | 841,023 | 0.66 |
| ROCHE HOLDING LTD | 1,514 | CHF | 424,240 | 0.33 |
| SCHINDLER HOLDING SA | 1,800 | CHF | 386,722 | 0.30 |
| SIKA - REGISTERED SHS | 2,180 | CHF | 571,104 | 0.45 |
| | | | 2,632,559 | 2.06 |
| Grobritannien | | | | |
| ASTRAZENECA PLC | 1,276 | GBP | 167,665 | 0.13 |
| DIAGEO PLC | 3,361 | GBP | 132,341 | 0.10 |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 9,648 | GBP | 664,674 | 0.52 |
| RELX PLC | 7,297 | EUR | 222,868 | 0.17 |
| UNILEVER | 3,691 | GBP | 176,238 | 0.14 |
| | | | 1,363,786 | 1.07 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | |
| ABBOTT LABORATORIES | 2,130 | USD | 212,844 | 0.17 |
| ADOBE INC | 608 | USD | 272,508 | 0.21 |
| ADVANCED MICRO DEVICES INC | 1,284 | USD | 134,061 | 0.10 |
| ALPHABET INC -A- | 7,726 | USD | 847,665 | 0.66 |
| AMAZON.COM INC | 1,540 | USD | 184,010 | 0.14 |
| AMGEN INC | 761 | USD | 154,865 | 0.12 |
| ANALOG DEVICES INC | 708 | USD | 126,421 | 0.10 |
| APPLE INC | 5,598 | USD | 995,274 | 0.78 |
| BANK OF AMERICA CORP | 4,555 | USD | 119,783 | 0.09 |
| BROADCOM INC - REGISTERED SHS | 358 | USD | 284,638 | 0.22 |
| BROWN AND BROWN INC | 2,733 | USD | 172,447 | 0.14 |
| CATERPILLAR - REGISTERED | 1,448 | USD | 326,563 | 0.26 |
| COCA-COLA CO | 9,049 | USD | 499,478 | 0.39 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 2,430 | USD | 201,349 | 0.16 |
| DANAHER CORP | 828 | USD | 182,145 | 0.14 |
| ELECTRONIC ARTS - REGISTERED | 6,993 | USD | 831,340 | 0.65 |
| ELI LILLY & CO | 338 | USD | 145,294 | 0.11 |
| EMERSON ELECTRIC CO | 1,826 | USD | 151,285 | 0.12 |
| ESTEE LAUDER COMPANIES INC -A- | 320 | USD | 57,600 | 0.05 |
| FORTIVE CORP | 2,301 | USD | 157,695 | 0.12 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 8,672 | USD | 898,836 | 0.70 |
| JOHNSON & JOHNSON | 2,963 | USD | 449,529 | 0.35 |
| JPMORGAN CHASE CO | 1,990 | USD | 265,285 | 0.21 |
| LAM RESEARCH CORP | 266 | USD | 156,738 | 0.12 |
| MASTERCARD INC -A- | 1,557 | USD | 561,291 | 0.44 |
| MCDONALD'S CORP | 829 | USD | 226,748 | 0.18 |
| MERCK & CO INC | 5,327 | USD | 563,412 | 0.44 |
| MICROSOFT CORP | 2,915 | USD | 909,875 | 0.71 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 3,203 | USD | 214,140 | 0.17 |
| MORGAN STANLEY | 2,005 | USD | 156,945 | 0.12 |
| NIKE INC | 4,045 | USD | 409,209 | 0.32 |
| OTIS WORLDWIDE CORPORATION | 2,305 | USD | 188,055 | 0.15 |
| OWENS CORNING SHS | 6,306 | USD | 754,292 | 0.59 |
| PALO ALTO NETWORKS | 4,431 | USD | 1,037,731 | 0.81 |
| PARKER-HANNIFIN CORP | 470 | USD | 168,028 | 0.13 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 3,883 | USD | 540,061 | 0.42 |
| PTC INC | 7,233 | USD | 943,406 | 0.74 |
| S&P GLOBAL INC | 580 | USD | 213,122 | 0.17 |

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

Etwige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zurckzufhren.



Candriam L Multi-Asset Income & Growth

Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

| Bezeichnung | Anzahl | Wahrung | Marktwert (in EUR) | % des NV |
|---|-----------|----------|--------------------|--------------|
| SALESFORCE.COM INC | 2,450 | USD | 474,415 | 0.37 |
| STARBUCKS CORP | 2,054 | USD | 186,498 | 0.15 |
| STRYKER CORP | 551 | USD | 154,083 | 0.12 |
| THERMO FISHER SCIENT SHS | 2,062 | USD | 986,112 | 0.77 |
| TJX COS INC | 1,885 | USD | 146,498 | 0.11 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 888 | USD | 391,208 | 0.31 |
| VALERO ENERGY CORP | 1,691 | USD | 181,810 | 0.14 |
| VISA INC -A- | 1,651 | USD | 359,376 | 0.28 |
| WASTE MANAGEMENT | 1,600 | USD | 254,328 | 0.20 |
| | | | 17,848,296 | 13.98 |
| Aktien gesamt | | | 36,025,994 | 28.22 |
| Anleihen | | | | |
| osterreich | | | | |
| AUSTRIA 0.5 19-29 20/02A | 512,000 | EUR | 447,749 | 0.35 |
| AUSTRIA 2.40 13-34 23/05A | 196,000 | EUR | 184,555 | 0.14 |
| | | | 632,304 | 0.50 |
| Belgien | | | | |
| BELGIUM 1.00 15-31 22/06A | 238,000 | EUR | 205,856 | 0.16 |
| BELGIUM 3.75 13-45 22/06A | 233,000 | EUR | 248,450 | 0.19 |
| | | | 454,306 | 0.36 |
| Kanada | | | | |
| ROYAL BANK OF CANADA 0.125 19-24 23/07A | 400,000 | EUR | 383,688 | 0.30 |
| TORONTO DOMINION BK 2.551 22-27 03/08A | 460,000 | EUR | 431,790 | 0.34 |
| | | | 815,478 | 0.64 |
| Frankreich | | | | |
| ARVAL SERVICE LEASE 4.75 22-27 22/05A5A | 600,000 | EUR | 605,799 | 0.47 |
| BANQUE FEDERATIVE DU 1.25 20-30 03/06A | 800,000 | EUR | 651,504 | 0.51 |
| BFCM 0.125 19-24 05/02A | 400,000 | EUR | 390,942 | 0.31 |
| BNP PARIBAS 1.00 18-24 17/04A | 400,000 | EUR | 390,946 | 0.31 |
| BPCE S.A. 0.625 20-30 15/01A | 800,000 | EUR | 643,804 | 0.50 |
| CAPGEMINI SE 0.625 20-25 23/06A | 200,000 | EUR | 187,861 | 0.15 |
| FAURECIA 7.25 22-26 15/06S | 250,000 | EUR | 260,469 | 0.20 |
| FRAN TREA BILL BTF ZCP 20-03-24 | 3,300,000 | EUR | 3,192,048 | 2.50 |
| FRANCE 1.00 15-25 25/11A | 1,009,000 | EUR | 959,433 | 0.75 |
| FRANCE 1.75 17-39 25/06A | 760,000 | EUR | 631,522 | 0.49 |
| FRANCE 3.25 12-45 25/05A | 359,000 | EUR | 360,515 | 0.28 |
| FREN REP PRES ZCP 24-01-24 | 3,300,000 | EUR | 3,199,342 | 2.51 |
| ORANGE SA 1.1250 19-24 15/07A | 600,000 | EUR | 583,224 | 0.46 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE 0.00 20-26 15/06U | 1,200 | EUR | 229,163 | 0.18 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE 0.25 16-24 09/09A | 200,000 | EUR | 191,924 | 0.15 |
| SOCIETE GENERALE SA 0.75 20-27 23/01A | 600,000 | EUR | 525,843 | 0.41 |
| VERALLIA SASU 1.625 21-28 14/05A | 700,000 | EUR | 617,785 | 0.48 |
| | | | 13,622,124 | 10.67 |
| Deutschland | | | | |
| ADIDAS AG 0.00 20-24 09/09U | 100,000 | EUR | 95,572 | 0.07 |
| GERM TREA BILL ZCP 20-03-24 | 3,300,000 | EUR | 3,195,540 | 2.50 |
| GERM TREA BILL ZCP 21-02-24 | 3,300,000 | EUR | 3,192,172 | 2.50 |
| GERMANY 1.00 15-25 15/08A | 1,200,000 | EUR | 1,148,970 | 0.90 |
| GERMANY 2.50 12-44 04/07A | 212,000 | EUR | 214,097 | 0.17 |
| SCHAEFFLER AG 3.375 20-28 12/10A | 400,000 | EUR | 365,728 | 0.29 |
| VONOVIA SE 0.375 21-27 16/06A | 800,000 | EUR | 665,824 | 0.52 |
| ZF FINANCE GMBH 2.2500 21-28 03/05A | 800,000 | EUR | 675,843 | 0.53 |
| | | | 9,553,746 | 7.48 |
| Italien | | | | |
| BUONI POLIENNAL 3.8500 18-49 01/09S | 382,000 | EUR | 356,717 | 0.28 |
| INTE 4.75 22-27 06/09A | 500,000 | EUR | 502,352 | 0.39 |
| INTESA SANPAOLO 2.1250 20-25 26/05A | 250,000 | EUR | 239,596 | 0.19 |
| ITALY 4.50 13-24 01/03S | 1,278,000 | EUR | 1,283,547 | 1.01 |

Die Erlauterungen 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 2023

| Bezeichnung | Anzahl | Wahrung | Marktwert (in EUR) | % des NV |
|--|-----------|----------|--------------------|--------------|
| ITALY 4.75 13-28 01/09S | 621,000 | EUR | 651,240 | 0.51 |
| ITALY 5.00 09-40 01/09S | 284,000 | EUR | 309,960 | 0.24 |
| ITALY BUONI TES BOT ZCP 140224 | 3,300,000 | EUR | 3,187,259 | 2.50 |
| ITALY BUONI TES BOT ZCP 140324 | 3,300,000 | EUR | 3,189,969 | 2.50 |
| | | | 9,720,640 | 7.61 |
| Niederlande | | | | |
| ENEL FINANCE INTL 3.875 22-29 09/03A/03A | 400,000 | EUR | 399,710 | 0.31 |
| NETHERLANDS 0.25 19-29 14/02A | 650,000 | EUR | 562,380 | 0.44 |
| | | | 962,090 | 0.75 |
| Portugal | | | | |
| PORTUGAL 4.125 17-27 14/04A | 394,000 | EUR | 410,652 | 0.32 |
| | | | 410,652 | 0.32 |
| Spanien | | | | |
| CELLNEX FINANCE CO 2.25 22-26 12/04A | 500,000 | EUR | 469,126 | 0.37 |
| SPAI LETR DEL TESO ZCP 08-03-24 | 3,300,000 | EUR | 3,195,618 | 2.50 |
| SPAIN (BON.ESTATADO) 1.25 20-30 31/10A | 546,000 | EUR | 475,782 | 0.37 |
| SPAIN 1.85 19-35 05/03A | 511,000 | EUR | 429,414 | 0.34 |
| SPAIN 2.75 14-24 31/10A | 756,000 | EUR | 749,393 | 0.59 |
| SPAIN LETRAS DEL TES ZCP 090224 | 3,300,000 | EUR | 3,192,790 | 2.50 |
| | | | 8,512,123 | 6.67 |
| Grobritannien | | | | |
| CREDIT AGRICOLE 0.50 19-24 24/06A | 400,000 | EUR | 386,798 | 0.30 |
| VMED O2 UK FIN I PLC 4.5 21-31 15/07SS | 600,000 | GBP | 532,299 | 0.42 |
| | | | 919,097 | 0.72 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | |
| ABBOTT LABORATORIES 1.4000 20-30 30/06S | 452,000 | USD | 340,351 | 0.27 |
| AMAZON.COM INC 4.95 14-44 05/12S | 236,000 | USD | 219,205 | 0.17 |
| AMERICAN TOWER CORP 1 20-32 10/09A | 800,000 | EUR | 599,500 | 0.47 |
| AT&T INC 2.60 14-29 17/12A | 800,000 | EUR | 736,432 | 0.58 |
| AVANTOR FUNDING 3.8750 21-29 01/11S | 300,000 | USD | 240,971 | 0.19 |
| BANK OF AMERICA CO 3.875 15-25 01/08S | 806,000 | USD | 718,640 | 0.56 |
| BERRY GLOBAL INC 5.5000 23-28 15/04S | 500,000 | USD | 451,959 | 0.35 |
| CENTENE CORP 4.2500 19-27 15/12S | 350,000 | USD | 300,206 | 0.24 |
| CROWN AMERICAS LLC4.7519-26 01/02S | 300,000 | USD | 267,096 | 0.21 |
| DARLING INGREDI 6.0000 22-30 15/06S | 250,000 | USD | 224,043 | 0.18 |
| ELI LILLY & CO 3.3750 19-29 15/03S | 645,000 | USD | 556,060 | 0.44 |
| FORD MOTOR CREDIT CO 5.584 19-24 18/03S | 600,000 | USD | 546,663 | 0.43 |
| HCA INC 3.5 20-30 01/09S | 400,000 | USD | 321,709 | 0.25 |
| HILTON DOMESTIC 3.620 21-32 15/02S | 800,000 | USD | 612,066 | 0.48 |
| IQVIA INC 2.875 20-28 24/06S | 640,000 | EUR | 578,045 | 0.45 |
| LEVI STRAUSS & CO 3.375 17-27 15/03S | 600,000 | EUR | 570,171 | 0.45 |
| MERCK & CO INC 2.75 15-25 10/02A | 347,000 | USD | 306,356 | 0.24 |
| MICROSOFT CORP 4.25 17-47 06/02S | 178,000 | USD | 158,846 | 0.12 |
| MORGAN STANLEY 4.00 15-25 23/07S | 766,000 | USD | 681,996 | 0.53 |
| NETFLIX INC 3.6250 19-30 15/06S | 660,000 | EUR | 629,769 | 0.49 |
| NOVELIS CORP 3.875 21-31 15/08S | 200,000 | USD | 150,978 | 0.12 |
| PEPSICO INC 2.75 20-30 19/03S | 547,000 | USD | 450,673 | 0.35 |
| PROLOGIS EURO FINANC 3.875 23-30 31/01A | 1,000,000 | EUR | 971,185 | 0.76 |
| THERMO FISHER SCIENT 0.1250 19-25 01/03A | 400,000 | EUR | 375,482 | 0.29 |
| T-MOBILE USA IN 5.3750 17-27 15/04S | 455,000 | USD | 414,715 | 0.32 |
| VERIZON COMMUNICATIO 3.15 20-30 20/03S | 744,000 | USD | 606,578 | 0.48 |
| | | | 12,029,695 | 9.42 |
| Anleihen gesamt | | | 57,632,255 | 45.14 |
| Wandelanleihen | | | | |
| Frankreich | | | | |
| ELIS SA CV 2.25 22-29 22/09A22-29 22/09A | 300,000 | EUR | 371,961 | 0.29 |
| | | | 371,961 | 0.29 |
| Spanien | | | | |
| CELLNEX TELECOM SA 0.50 19-28 05/07A | 400,000 | EUR | 419,090 | 0.33 |

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 Income & Growth

Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

| Bezeichnung | Anzahl | Wahrung | Marktwert (in EUR) | % des NV |
|--|-----------|----------|--------------------|--------------|
| | | | 419,090 | 0.33 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | |
| JPMORGAN CHASE BANK 0.0 21-24 18/02U | 300,000 | EUR | 318,006 | 0.25 |
| | | | 318,006 | 0.25 |
| Wandelanleihen gesamt | | | 1,109,057 | 0.87 |
| Variabel verzinsliche Anleihen | | | | |
| Belgien | | | | |
| KBC GROUPE FL.R 22-27 23/11A | 900,000 | EUR | 894,442 | 0.70 |
| | | | 894,442 | 0.70 |
| Frankreich | | | | |
| AXA SA FL.R 14-XX 07/11A | 425,000 | EUR | 414,910 | 0.32 |
| BNP PARIBAS FL.R 19-26 04/12A | 900,000 | EUR | 837,932 | 0.66 |
| CREDIT AGRICOLE FL.R 16-48 27/09A | 600,000 | EUR | 577,581 | 0.45 |
| LA BANQUE POSTALE FL.R 21-32 02/02A | 400,000 | EUR | 323,350 | 0.25 |
| | | | 2,153,773 | 1.69 |
| Deutschland | | | | |
| ALLIANZ SE FL.R 17-47 06/07A | 700,000 | EUR | 651,956 | 0.51 |
| | | | 651,956 | 0.51 |
| Italien | | | | |
| ENEL FL.R 23-XX 16/07A | 1,050,000 | EUR | 1,059,303 | 0.83 |
| UNICREDIT SPA FL.R 20-26 16/06A | 530,000 | EUR | 497,670 | 0.39 |
| UNICREDIT SPA FL.R 21-29 05/07A | 465,000 | EUR | 389,886 | 0.31 |
| | | | 1,946,859 | 1.52 |
| Niederlande | | | | |
| IBERDROLA INTL BV FL.R 18-XX 26/03A | 900,000 | EUR | 887,769 | 0.70 |
| ING GROUP NV FL.R 17-29 26/09A | 500,000 | EUR | 472,965 | 0.37 |
| ING GROUP NV FL.R 22-27 16/02A | 600,000 | EUR | 549,606 | 0.43 |
| | | | 1,910,340 | 1.50 |
| Spanien | | | | |
| BANCO DE SABADELL SA FL.R 21-28 16/06A | 800,000 | EUR | 671,894 | 0.53 |
| BANCO NTANDER FL.R 22-26 27/09A | 1,000,000 | EUR | 982,240 | 0.77 |
| IBERDROLA FINANZA SAU FL.R 21-99 31/12A | 400,000 | EUR | 337,334 | 0.26 |
| | | | 1,991,468 | 1.56 |
| Grobritannien | | | | |
| BARCLAYS PLC 0.453 21-26 12/05Q | 546,000 | EUR | 542,530 | 0.42 |
| NATWEST GROUP PLC FL.R 22-28 06/09A | 450,000 | EUR | 436,664 | 0.34 |
| | | | 979,194 | 0.77 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | |
| CITIGROUP FL.R 22-28 22/09A | 755,000 | EUR | 737,544 | 0.58 |
| THERMO FISHER SCIENTIF FL.R 21-24 18/10Q | 932,000 | USD | 853,865 | 0.67 |
| UNITED STATES 0.125 22-52 15/02S | 2,120,000 | USD | 1,399,777 | 1.10 |
| UNITED STATES 1.5 23-53 15/02S | 1,440,000 | USD | 1,306,438 | 1.02 |
| | | | 4,297,624 | 3.37 |
| Variabel verzinsliche Anleihen gesamt | | | 14,825,656 | 11.61 |
| bertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Brse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt | | | 113,226,693 | 88.68 |
| Organismen fr gemeinsame Anlagen | | | | |
| Anteile/Einheiten an Anlagefonds | | | | |
| Luxemburg | | | | |
| CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQUITY MARKET NEUTRAL Z C | 1,372 | EUR | 2,565,407 | 2.01 |
| CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z C | 4,461 | USD | 4,517,754 | 3.54 |
| LUMYNA MW TOPS MN UCITS CL B | 12,644 | EUR | 2,251,690 | 1.76 |
| | | | 9,334,851 | 7.31 |
| Aktien/Anteile in Anlagementfonds gesamt | | | 9,334,851 | 7.31 |
| Organismen fr gemeinsame Anlagen gesamt | | | 9,334,851 | 7.31 |
| Anlageportfolio gesamt | | | 122,561,544 | 95.99 |
| Erwerbskosten | | | 123,672,847 | |

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

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



Candriam L Multi-Asset Income & Growth

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2023

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

| | |
|--------------------------------|--------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika | 27.02 |
| Frankreich | 16.94 |
| Deutschland | 10.62 |
| Italien | 9.61 |
| Spanien | 9.19 |
| Luxemburg | 7.31 |
| Niederlande | 3.63 |
| Irland | 3.00 |
| Großbritannien | 2.55 |
| Schweiz | 2.06 |
| Belgien | 1.36 |
| Kanada | 0.77 |
| Japan | 0.53 |
| Österreich | 0.50 |
| Dänemark | 0.45 |
| Portugal | 0.32 |
| Niederländische Antillen | 0.14 |
| | 95.99 |

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

| | |
|---|--------------|
| Anleihen von Staaten, Provinzen und Gemeinden | 29.67 |
| Banken und andere Finanzinstitute | 16.56 |
| Anlagefonds | 7.31 |
| Internet und Internet-Dienste | 5.30 |
| Pharmazeutika | 4.35 |
| Nicht klassifizierbare Institutionen | 2.85 |
| Elektronik und Halbleiter | 2.84 |
| Versorger | 2.71 |
| Elektrotechnik | 2.58 |
| Versicherungen | 2.21 |
| Kommunikation | 2.16 |
| Lebensmittel und alkoholfreie Getränke | 2.05 |
| Immobilien | 1.75 |
| Chemikalien | 1.36 |
| Textilien und Bekleidung | 1.33 |
| Gesundheitswesen | 1.25 |
| Tabak und alkoholische Getränke | 1.18 |
| Maschinen- und Apparatebau | 1.12 |
| Baumaterialien | 1.05 |
| Sonstige Dienstleistungen | 1.00 |
| Büroausstattung und Computer | 1.00 |
| Sonstige Konsumgüter | 0.94 |
| Einzelhandel und Warenhäuser | 0.65 |
| Kraftfahrzeuge | 0.56 |
| Verpackungsindustrie | 0.48 |
| Transport | 0.47 |
| Grafik und Verlage | 0.34 |
| Hotels und Restaurants | 0.32 |
| Erdöl | 0.28 |
| Umweltdienste und Recycling | 0.20 |
| Kohlebergbau und Stahlindustrie & Chemie | 0.12 |
| | 95.99 |

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



Candriam L Multi-Asset Premia

Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

| Bezeichnung | Anzahl | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV |
|---|-----------|---------|--------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden | | | | |
| Aktien | | | | |
| Bermuda | | | | |
| NORVERGIAN CRUISE LINE LTD | 5,677 | USD | 113,280 | 0.25 |
| | | | 113,280 | 0.25 |
| Liberia | | | | |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 1,168 | USD | 111,062 | 0.24 |
| | | | 111,062 | 0.24 |
| Panama | | | | |
| CARNIVAL CORP | 6,914 | USD | 119,331 | 0.26 |
| | | | 119,331 | 0.26 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | |
| BUILDERS FIRSTSOURCE | 871 | USD | 108,576 | 0.24 |
| CARVANA REGISTERED SHS -A- | 4,609 | USD | 109,501 | 0.24 |
| DRAFTKINGS INC | 4,516 | USD | 109,982 | 0.24 |
| EQUITRANS MIDSTREAM CORP- SHS | 12,424 | USD | 108,867 | 0.24 |
| EXACT SCIENCES CORP | 1,258 | USD | 108,273 | 0.23 |
| GOHEALTH INC-CLASS A | 6,042 | USD | 109,155 | 0.24 |
| GS ACQN HLDG - REGISTERED SHS -A- | 4,917 | USD | 111,635 | 0.24 |
| JABIL INC | 1,099 | USD | 108,721 | 0.24 |
| META PLATFOR -A- | 431 | USD | 113,372 | 0.25 |
| MONGODB INC | 294 | USD | 110,753 | 0.24 |
| NETFLIX INC | 277 | USD | 111,838 | 0.24 |
| NVIDIA CORP | 296 | USD | 114,770 | 0.25 |
| OPENDOOR TECH --- REGISTERED SHS | 29,080 | USD | 107,151 | 0.23 |
| PALANTIR TCHNLG - REGISTERED SHS -A- | 7,806 | USD | 109,685 | 0.24 |
| PENUMBRA INC | 349 | USD | 110,061 | 0.24 |
| PULTEGROUP | 1,534 | USD | 109,222 | 0.24 |
| REATA PHARMACEUTICALS INC-A | 1,176 | USD | 109,904 | 0.24 |
| SOFI TECH | 13,622 | USD | 104,132 | 0.23 |
| UPSTART HOLDINGS INC | 3,341 | USD | 109,662 | 0.24 |
| VROOM INC | 75,571 | USD | 99,745 | 0.22 |
| WAYFAIR INC | 1,887 | USD | 112,442 | 0.24 |
| XPO INC | 2,002 | USD | 108,266 | 0.23 |
| | | | 2,405,713 | 5.21 |
| Aktien gesamt | | | 2,749,386 | 5.95 |
| Anleihen | | | | |
| Belgien | | | | |
| BELGIUM 0.80 15-25 22/06A | 2,300,000 | EUR | 2,195,614 | 4.75 |
| EURO UNIO BILL ZCP 04-08-23 | 2,600,000 | EUR | 2,584,777 | 5.60 |
| | | | 4,780,391 | 10.35 |
| Frankreich | | | | |
| FRAN TREA BILL BTF ZCP 13-09-23 | 2,000,000 | EUR | 1,985,085 | 4.30 |
| FRANCE 0.00 19-25 25/03U | 927,200 | EUR | 876,274 | 1.90 |
| | | | 2,861,359 | 6.20 |
| Deutschland | | | | |
| GERMANY 0.00 20-25 10/10U | 2,300,000 | EUR | 2,147,292 | 4.65 |
| | | | 2,147,292 | 4.65 |
| Italien | | | | |
| ITAL BUON ORDI DEL ZCP 31-07-23 | 2,000,000 | EUR | 1,988,714 | 4.31 |
| ITALY 1.8500 20-25 01/07S | 2,300,000 | EUR | 2,216,119 | 4.80 |
| | | | 4,204,833 | 9.10 |
| Spanien | | | | |
| SPAIN 0.00 20-25 31/01U | 2,300,000 | EUR | 2,179,503 | 4.72 |
| SPAIN 0.35 18-23 30/07A | 4,000,000 | EUR | 3,990,740 | 8.64 |
| | | | 6,170,243 | 13.36 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | |
| UNIT STAT TREA BIL ZCP 05-10-23 | 1,000,000 | USD | 879,598 | 1.90 |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

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



Candriam L Multi-Asset Premia

Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

| Bezeichnung | Anzahl | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV |
|--|--------|---------|--------------------|--------------|
| | | | 879,598 | 1.90 |
| Anleihen gesamt | | | 21,043,716 | 45.56 |
| Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt | | | 23,793,102 | 51.51 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | | |
| Anteile/Einheiten an Anlagefonds | | | | |
| Luxemburg | | | | |
| CANDRIAM BONDS EMERGING MARKETS CORPORATE Z C | 2,810 | USD | 3,778,175 | 8.18 |
| | | | 3,778,175 | 8.18 |
| Aktien/Anteile in Anlagementfonds gesamt | | | 3,778,175 | 8.18 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen gesamt | | | 3,778,175 | 8.18 |
| Anlageportfolio gesamt | | | 27,571,277 | 59.69 |
| Erwerbskosten | | | 28,278,105 | |



Candriam L Multi-Asset Premia

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2023

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

| | |
|--------------------------------|--------------|
| Spanien | 13.36 |
| Belgien | 10.35 |
| Italien | 9.10 |
| Luxemburg | 8.18 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | 7.11 |
| Frankreich | 6.20 |
| Deutschland | 4.65 |
| Panama | 0.26 |
| Bermuda | 0.25 |
| Liberia | 0.24 |
| | 59.69 |

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

| | |
|---|--------------|
| Anleihen von Staaten, Provinzen und Gemeinden | 39.97 |
| Anlagefonds | 8.18 |
| Supranationale Organisationen | 5.60 |
| Internet und Internet-Dienste | 1.20 |
| Banken und andere Finanzinstitute | 0.94 |
| Hotels und Restaurants | 0.50 |
| Elektronik und Halbleiter | 0.48 |
| Pharmazeutika | 0.48 |
| Baumaterialien | 0.47 |
| Kraftfahrzeuge | 0.45 |
| Versicherungen | 0.24 |
| Sonstige Konsumgüter | 0.24 |
| Büroausstattung und Computer | 0.24 |
| Erdöl | 0.24 |
| Biotechnologie | 0.23 |
| Transport | 0.23 |
| | 59.69 |



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Optionen

Zum 30. Juni 2023 waren die offenen Optionen und Swaptions wie folgt:

Candriam L Balanced Asset Allocation

| Anzahl | Bezeichnung | Währung | Verpflichtung (in USD) (in absolutem Wert) | Marktwert (in USD) | Nicht realisiert (in USD) |
|---------------------------|---------------------------------------|---------|--|-----------------------|------------------------------|
| Gekauft | | | | | |
| 98,072 | EURO STOXX 50 SEP 4300.0 15.09.23 PUT | EUR | 0 | 98,072 | (46,248) |
| 55,270 | SP 500 SEP 4200.0 15.09.23 PUT | USD | 0 | 55,270 | (61,064) |
| 26,010 | STOXX SEP 590.00 15.09.23 CALL | EUR | 0 | 26,010 | (48,150) |
| Verkaufte Optionen | | | | | |
| 34,440 | EURO STOXX 50 SEP 4000.0 15.09.23 PUT | EUR | 800,810 | (34,440) | 20,500 |
| 23,263 | SP 500 SEP 3900.0 15.09.23 PUT | USD | 506,634 | (23,263) | 27,484 |
| | | | | 121,649 | (107,478) |

Candriam L Conservative Asset Allocation

| Anzahl | Bezeichnung | Währung | Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert) | Marktwert (in EUR) | Nicht realisiert (in EUR) |
|---------------------------|---------------------------------------|---------|--|-----------------------|------------------------------|
| Gekauft | | | | | |
| 136,344 | EURO STOXX 50 SEP 4300.0 15.09.23 PUT | EUR | 0 | 136,344 | (64,296) |
| 73,694 | SP 500 SEP 4200.0 15.09.23 PUT | USD | 0 | 73,694 | (81,418) |
| 35,700 | STOXX SEP 590.00 15.09.23 CALL | EUR | 0 | 35,700 | (66,089) |
| Verkaufte Optionen | | | | | |
| 47,880 | EURO STOXX 50 SEP 4000.0 15.09.23 PUT | EUR | 1,113,322 | (47,880) | 28,500 |
| 31,017 | SP 500 SEP 3900.0 15.09.23 PUT | USD | 675,511 | (31,017) | 36,645 |
| | | | | 166,841 | (146,658) |

Candriam L Dynamic Asset Allocation

| Anzahl | Bezeichnung | Währung | Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert) | Marktwert (in EUR) | Nicht realisiert (in EUR) |
|---------------------------|---------------------------------------|---------|--|-----------------------|------------------------------|
| Gekauft | | | | | |
| 9,568 | EURO STOXX 50 SEP 4300.0 15.09.23 PUT | EUR | 0 | 9,568 | (4,512) |
| 6,141 | SP 500 SEP 4200.0 15.09.23 PUT | USD | 0 | 6,141 | (6,785) |
| 2,550 | STOXX SEP 590.00 15.09.23 CALL | EUR | 0 | 2,550 | (4,721) |
| Verkaufte Optionen | | | | | |
| 3,360 | EURO STOXX 50 SEP 4000.0 15.09.23 PUT | EUR | 78,128 | (3,360) | 2,000 |
| 2,585 | SP 500 SEP 3900.0 15.09.23 PUT | USD | 56,293 | (2,585) | 3,054 |
| | | | | 12,314 | (10,964) |

Candriam L Multi-Asset Income

| Anzahl | Bezeichnung | Währung | Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert) | Marktwert (in EUR) | Nicht realisiert (in EUR) |
|----------------|---------------------------------------|---------|--|-----------------------|------------------------------|
| Gekauft | | | | | |
| 110,293 | SP 500 SEP 4150.0 15.09.23 PUT | USD | 0 | 110,293 | (109,330) |
| 294,520 | DJ EURO STOXX DEC 3800.0 15.12.23 PUT | EUR | 0 | 294,520 | (516,604) |
| | | | | 404,813 | (625,934) |

Candriam L Multi-Asset Income & Growth

| Anzahl | Bezeichnung | Währung | Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert) | Marktwert (in EUR) | Nicht realisiert (in EUR) |
|----------------|--|---------|--|-----------------------|------------------------------|
| Gekauft | | | | | |
| 57,773 | SP 500 SEP 4150.0 15.09.23 PUT | USD | 0 | 57,773 | (57,268) |
| 35,668 | EURO STOXX 50 JUL 4450.0 21.07.23 CALL | EUR | 0 | 35,668 | (16,781) |
| 109,520 | DJ EURO STOXX DEC 3800.0 15.12.23 PUT | EUR | 0 | 109,520 | (192,104) |
| | | | | 202,961 | (266,153) |

Alle Optionsverträge wurden mit der Gegenpartei J.P. Morgan AG 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 2023 waren die folgenden Devisentermingeschäfte ausstehend:

Candriam L Balanced Asset Allocation

| Gekaufte Devisen | Gekaufte Anzahl | Verkaufte Devisen | Verkaufte Anzahl | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Nicht realisiert (in EUR) |
|---------------------|--------------------|----------------------|---------------------|-----------------------|---------------------------|------------------------------|
| CAD | 3,830,000 | EUR | 2,636,633 | 15/12/2023 | Société Générale | 605 |
| CHF | 210,000 | EUR | 216,523 | 15/12/2023 | Société Générale | 627 |
| DKK | 2,134,000 | USD | 316,760 | 15/12/2023 | Société Générale | (666) |
| EUR | 85,518 | AUD | 137,000 | 15/12/2023 | Société Générale | 2,292 |
| EUR | 3,601,620 | USD | 3,933,000 | 15/12/2023 | J.P. Morgan AG | 27,922 |
| EUR | 3,496,388 | USD | 3,844,335 | 15/12/2023 | Société Générale | 3,046 |
| GBP | 1,264,000 | EUR | 1,457,887 | 15/12/2023 | Société Générale | 1,771 |
| JPY | 27,935,000 | EUR | 188,806 | 15/12/2023 | BNP Paribas Paris | (8,300) |
| JPY | 428,661,000 | USD | 3,165,407 | 15/12/2023 | Société Générale | (106,965) |
| NOK | 499,000 | EUR | 42,648 | 15/12/2023 | Société Générale | (110) |
| SEK | 3,984,000 | EUR | 342,612 | 15/12/2023 | Barclays Bank Ireland Plc | (4,740) |
| USD | 156,805 | EUR | 142,000 | 15/12/2023 | Société Générale | 494 |
| USD | 1,563,000 | JPY | 217,280,445 | 15/12/2023 | Société Générale | 17,188 |
| | | | | | | (66,836) |

Candriam L Conservative Asset Allocation

| Gekaufte Devisen | Gekaufte Anzahl | Verkaufte Devisen | Verkaufte Anzahl | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Nicht realisiert (in EUR) |
|---------------------|--------------------|----------------------|---------------------|-----------------------|---------------------------|------------------------------|
| CAD | 5,713,000 | EUR | 3,932,921 | 15/12/2023 | Société Générale | 902 |
| DKK | 2,658,000 | USD | 394,540 | 15/12/2023 | Société Générale | (829) |
| EUR | 138,429 | CAD | 201,000 | 15/12/2023 | UBS Europe SE | 26 |
| EUR | 180,431 | CHF | 175,000 | 15/12/2023 | Barclays Bank Ireland Plc | (527) |
| EUR | 7,150,337 | USD | 7,801,000 | 15/12/2023 | J.P. Morgan SE | 62,058 |
| EUR | 4,547,718 | USD | 5,002,781 | 15/12/2023 | Société Générale | 1,678 |
| GBP | 1,038,000 | EUR | 1,197,221 | 15/12/2023 | Société Générale | 1,454 |
| JPY | 44,712,000 | EUR | 302,198 | 15/12/2023 | BNP Paribas Paris | (13,284) |
| JPY | 594,590,000 | USD | 4,390,694 | 15/12/2023 | Société Générale | (148,370) |
| SEK | 2,763,000 | EUR | 237,610 | 15/12/2023 | Barclays Bank Ireland Plc | (3,287) |
| USD | 2,168,000 | JPY | 301,384,520 | 15/12/2023 | Société Générale | 23,841 |
| | | | | | | (76,338) |

Candriam L Dynamic Asset Allocation

| Gekaufte Devisen | Gekaufte Anzahl | Verkaufte Devisen | Verkaufte Anzahl | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Nicht realisiert (in EUR) |
|---------------------|--------------------|----------------------|---------------------|-----------------------|---------------------------|------------------------------|
| CAD | 334,000 | EUR | 229,931 | 15/12/2023 | Société Générale | 53 |
| DKK | 171,000 | USD | 25,382 | 15/12/2023 | Société Générale | (53) |
| EUR | 13,109 | AUD | 21,000 | 15/12/2023 | Société Générale | 351 |
| EUR | 17,528 | CHF | 17,000 | 15/12/2023 | Barclays Bank Ireland Plc | (51) |
| EUR | 21,657 | USD | 24,000 | 15/12/2023 | J.P. Morgan SE | (153) |
| EUR | 282,670 | USD | 310,792 | 15/12/2023 | Société Générale | 253 |
| GBP | 82,000 | EUR | 94,578 | 15/12/2023 | Société Générale | 115 |
| JPY | 1,142,000 | EUR | 7,719 | 15/12/2023 | BNP Paribas Paris | (339) |
| JPY | 37,967,000 | USD | 280,364 | 15/12/2023 | Société Générale | (9,474) |
| NOK | 59,000 | EUR | 5,042 | 15/12/2023 | Société Générale | (13) |
| SEK | 221,000 | EUR | 19,005 | 15/12/2023 | Barclays Bank Ireland Plc | (263) |
| USD | 76,000 | EUR | 69,669 | 15/12/2023 | Société Générale | (613) |
| USD | 139,000 | JPY | 19,323,085 | 15/12/2023 | Société Générale | 1,529 |
| | | | | | | (8,658) |

Candriam L Multi-Asset Income

| Gekaufte Devisen | Gekaufte Anzahl | Verkaufte Devisen | Verkaufte Anzahl | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Nicht realisiert (in EUR) |
|---------------------|--------------------|----------------------|---------------------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| EUR | 2,033,560 | GBP | 1,752,000 | 15/12/2023 | BNP Paribas Paris | 10,480 |
| EUR | 32,607,000 | USD | 35,580,335 | 15/12/2023 | Société Générale | 277,339 |
| GBP | 1,475,000 | EUR | 1,701,253 | 15/12/2023 | Société Générale | 2,066 |
| JPY | 1,911,155,000 | EUR | 12,917,069 | 15/12/2023 | BNP Paribas Paris | (567,817) |
| | | | | | | (277,932) |



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Candriam L Multi-Asset Income & Growth

| Gekaufte Devisen | Gekaufte Anzahl | Verkaufte Devisen | Verkaufte Anzahl | Fälligkeits- datum | Gegenpartei | Nicht realisiert (in EUR) |
|---------------------|--------------------|----------------------|---------------------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| EUR | 381,873 | GBP | 329,000 | 15/12/2023 | BNP Paribas Paris | 1,968 |
| EUR | 509,000 | USD | 559,487 | 15/12/2023 | UBS Europe SE | 596 |
| EUR | 14,259,000 | USD | 15,569,883 | 15/12/2023 | Société Générale | 111,521 |
| GBP | 752,000 | EUR | 867,351 | 15/12/2023 | Société Générale | 1,053 |
| JPY | 1,006,303,000 | EUR | 6,801,377 | 15/12/2023 | BNP Paribas Paris | (298,979) |
| | | | | | | (183,841) |

Beachten Sie Anhangangabe 11 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 2023 waren die folgenden Futures-Kontrakte ausstehend:

Candriam L Balanced Asset Allocation

| Anzahl (Kauf/(Verkauf)) | Bezeichnung | Währung | Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert) | Gegenpartei | Nicht realisiert (in EUR) |
|-----------------------------|-----------------------|---------|--|----------------|------------------------------|
| Futures auf Anleihen | | | | | |
| 60 | EURO BUND 0923 | EUR | 5,677,560 | J.P. Morgan SE | (74,400) |
| 14 | LONG GILT FU /202309 | GBP | 1,056,155 | J.P. Morgan SE | (3,695) |
| Futures auf Index | | | | | |
| 9 | FTSE 100 IND /202309 | GBP | 789,883 | J.P. Morgan SE | (4,021) |
| 11 | NASDAQ 100 E /202309 | USD | 3,060,886 | J.P. Morgan SE | 71,240 |
| 18 | EM RUSS 2000 /202309 | USD | 1,558,076 | J.P. Morgan SE | 7,069 |
| 112 | ZTS MSCI EME /202309 | USD | 16,181,588 | J.P. Morgan SE | (77,758) |
| (5) | DJ EURO STOXX /202309 | EUR | 219,955 | J.P. Morgan SE | (50) |
| (1) | S&P 500 EMINI I 0923 | USD | 203,959 | J.P. Morgan SE | (67) |
| 86 | DJ.STOXX600. /202309 | EUR | 1,416,033 | J.P. Morgan SE | (20,488) |
| 37 | DJ STOXX 600 /202309 | EUR | 1,418,432 | J.P. Morgan SE | (14,336) |
| | | | | | (116,506) |

Candriam L Conservative Asset Allocation

| Anzahl (Kauf/(Verkauf)) | Bezeichnung | Währung | Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert) | Gegenpartei | Nicht realisiert (in EUR) |
|-----------------------------|-----------------------|---------|--|----------------|------------------------------|
| Futures auf Anleihen | | | | | |
| 20 | LONG GILT FU /202309 | GBP | 1,508,792 | J.P. Morgan SE | (5,279) |
| 190 | EURO BUND 0923 | EUR | 17,978,940 | J.P. Morgan SE | (231,940) |
| Futures auf Index | | | | | |
| (50) | DJ EURO STOXX /202309 | EUR | 2,199,545 | J.P. Morgan SE | (26,750) |
| (8) | FTSE 100 IND /202309 | GBP | 702,118 | J.P. Morgan SE | 763 |
| 15 | NASDAQ 100 E /202309 | USD | 4,173,935 | J.P. Morgan SE | 97,146 |
| 51 | DJ STOXX 600 /202309 | EUR | 1,955,136 | J.P. Morgan SE | (19,761) |
| (7) | S&P 500 EMINI I 0923 | USD | 1,427,711 | J.P. Morgan SE | (18,670) |
| 24 | EM RUSS 2000 /202309 | USD | 2,077,434 | J.P. Morgan SE | 9,425 |
| 121 | DJ.STOXX600. /202309 | EUR | 1,992,326 | J.P. Morgan SE | (28,826) |
| 119 | ZTS MSCI EME /202309 | USD | 17,192,937 | J.P. Morgan SE | (83,333) |
| | | | | | (307,225) |

Candriam L Dynamic Asset Allocation

| Anzahl (Kauf/(Verkauf)) | Bezeichnung | Währung | Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert) | Gegenpartei | Nicht realisiert (in EUR) |
|-----------------------------|-----------------------|---------|--|----------------|------------------------------|
| Futures auf Anleihen | | | | | |
| 3 | EURO BUND 0923 | EUR | 283,878 | J.P. Morgan SE | (3,720) |
| 1 | LONG GILT FU /202309 | GBP | 75,440 | J.P. Morgan SE | (264) |
| Futures auf Index | | | | | |
| 2 | S&P 500 EMINI I 0923 | USD | 407,918 | J.P. Morgan SE | 9,235 |
| 3 | DJ STOXX 600 /202309 | EUR | 115,008 | J.P. Morgan SE | (1,162) |
| 8 | DJ.STOXX600. /202309 | EUR | 131,724 | J.P. Morgan SE | (1,906) |
| (3) | DJ EURO STOXX /202309 | EUR | 131,973 | J.P. Morgan SE | (1,605) |
| 1 | NASDAQ 100 E /202309 | USD | 278,262 | J.P. Morgan SE | 6,476 |
| 1 | EM RUSS 2000 /202309 | USD | 86,560 | J.P. Morgan SE | 393 |
| 14 | ZTS MSCI EME /202309 | USD | 2,022,698 | J.P. Morgan SE | (9,804) |
| | | | | | (2,357) |

Candriam L Multi-Asset Income

| Anzahl (Kauf/(Verkauf)) | Bezeichnung | Währung | Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert) | Gegenpartei | Nicht realisiert (in EUR) |
|-----------------------------|----------------------|---------|--|----------------|------------------------------|
| Futures auf Anleihen | | | | | |
| 34 | LONG GILT FU /202309 | GBP | 2,564,947 | J.P. Morgan SE | (8,974) |
| 296 | EURO BUND 0923 | EUR | 28,009,296 | J.P. Morgan SE | (367,040) |
| 138 | US 10YR NOTE 0923 | USD | 12,451,306 | J.P. Morgan SE | (157,349) |



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Futures (Fortsetzung)

Candriam L Multi-Asset Income (Fortsetzung)

| Anzahl (Kauf/(Verkauf)) | Bezeichnung | Währung | Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert) | Gegenpartei | Nicht realisiert (in EUR) |
|-----------------------------|-----------------------|---------|--|----------------|------------------------------|
| Futures auf Anleihen | | | | | |
| Futures auf Index | | | | | |
| (18) | S&P 500 EMINI I 0923 | USD | 3,671,258 | J.P. Morgan SE | (83,112) |
| 13 | NASDAQ 100 E /202309 | USD | 3,617,410 | J.P. Morgan SE | 84,193 |
| 53 | DJ EURO STOXX /202309 | EUR | 2,331,518 | J.P. Morgan SE | 28,223 |
| 27 | TOPIX (OSE) /202309 | JPY | 3,918,644 | J.P. Morgan SE | 277,384 |
| 78 | FTSE 100 IND /202309 | GBP | 6,845,649 | J.P. Morgan SE | (34,849) |
| 93 | DJ.STOXX600 /202309 | EUR | 1,816,569 | J.P. Morgan SE | 25,846 |
| 92 | ZTS MSCI EME /202309 | USD | 13,292,018 | J.P. Morgan SE | (64,425) |
| | | | | | (300,103) |

Candriam L Multi-Asset Income & Growth

| Anzahl (Kauf/(Verkauf)) | Bezeichnung | Währung | Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert) | Gegenpartei | Nicht realisiert (in EUR) |
|-----------------------------|-----------------------|---------|--|----------------|------------------------------|
| Futures auf Anleihen | | | | | |
| 13 | LONG GILT FU /202309 | GBP | 980,715 | J.P. Morgan SE | (3,431) |
| 51 | US 10YR NOTE 0923 | USD | 4,601,570 | J.P. Morgan SE | (58,149) |
| 110 | EURO BUND 0923 | EUR | 10,408,860 | J.P. Morgan SE | (136,400) |
| Futures auf Index | | | | | |
| 9 | NASDAQ 100 E /202309 | USD | 2,504,361 | J.P. Morgan SE | 58,287 |
| 15 | TOPIX (OSE) /202309 | JPY | 2,177,025 | J.P. Morgan SE | 154,103 |
| 10 | EMINI HEALTH /202309 | USD | 1,230,788 | J.P. Morgan SE | 19,271 |
| (27) | S&P 500 EMINI I 0923 | USD | 5,506,886 | J.P. Morgan SE | (124,668) |
| (17) | CAC40 10 EUR /202309 | EUR | 1,258,010 | J.P. Morgan SE | (18,297) |
| (74) | DJ EURO STOXX /202309 | EUR | 3,255,327 | J.P. Morgan SE | (39,590) |
| 68 | DJ.STOXX600 /202309 | EUR | 1,328,244 | J.P. Morgan SE | 18,898 |
| 29 | FTSE 100 IND /202309 | GBP | 2,545,177 | J.P. Morgan SE | (12,957) |
| 207 | ZTS MSCI EME /202309 | USD | 29,907,041 | J.P. Morgan SE | (144,957) |
| | | | | | (287,890) |

Candriam L Multi-Asset Premia

| Anzahl (Kauf/(Verkauf)) | Bezeichnung | Währung | Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert) | Gegenpartei | Nicht realisiert (in EUR) |
|-----------------------------|-----------------------|---------|--|----------------|------------------------------|
| Futures auf Anleihen | | | | | |
| (20) | EURO BUND 0923 | EUR | 1,892,520 | J.P. Morgan SE | (920) |
| (8) | US TREASURY /202309 | USD | 787,294 | J.P. Morgan SE | 1,003 |
| (4) | EURO-OAT-FUT /202309 | EUR | 402,410 | J.P. Morgan SE | 510 |
| (4) | US 2 YEARS N /202309 | USD | 729,491 | J.P. Morgan SE | 4,448 |
| (13) | JPN 10 YEARS /202309 | JPY | 8,179,921 | J.P. Morgan SE | (38,938) |
| (40) | US 10YR NOTE 0923 | USD | 3,609,074 | J.P. Morgan SE | 37,122 |
| (25) | EURO SCHATZ /202309 | EUR | 2,481,725 | J.P. Morgan SE | 16,250 |
| (5) | US 5YR 202309 | USD | 451,277 | J.P. Morgan SE | 4,338 |
| (12) | US ULTRA BD /202309 | USD | 991,464 | J.P. Morgan SE | (8,467) |
| 30 | EURO BTP FUT /202309 | EUR | 3,103,920 | J.P. Morgan SE | (24,050) |
| (74) | KOREA 3YR BO /202309 | KRW | 5,339,631 | J.P. Morgan SE | 13,154 |
| Futures auf Index | | | | | |
| (2) | S&P 500 EMINI I 0923 | USD | 407,918 | J.P. Morgan SE | (6,549) |
| (2) | HANG SENG IN /202307 | HKD | 221,253 | J.P. Morgan SE | 2,749 |
| 3 | DAX INDEX GE /202309 | EUR | 1,211,093 | J.P. Morgan SE | (2,675) |
| 6 | DJIA MINI FU /202309 | USD | 946,130 | J.P. Morgan SE | 4,624 |
| 6 | NIKKEI 225 (/202309 | JPY | 631,420 | J.P. Morgan SE | 11,361 |
| 6 | SPI 200 INDE /202309 | AUD | 659,240 | J.P. Morgan SE | 1,322 |
| 9 | TOPIX (OSE) /202309 | JPY | 1,306,215 | J.P. Morgan SE | 23,179 |
| 75 | DJ EURO STOXX /202309 | EUR | 3,299,318 | J.P. Morgan SE | 40,230 |
| (3) | NASDAQ 100 E /202309 | USD | 834,787 | J.P. Morgan SE | (13,342) |
| 190 | DJ ESTOXX50D 1225 | EUR | 2,254,350 | J.P. Morgan SE | 371,900 |
| (1) | EM RUSS 2000 /202309 | USD | 86,560 | J.P. Morgan SE | 596 |
| 235 | DJ EURO STOXX /202612 | EUR | 2,788,275 | J.P. Morgan SE | 437,880 |

Futures (Fortsetzung)



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Candriam L Multi-Asset Premia (Fortsetzung)

| Anzahl (Kauf/(Verkauf)) | Bezeichnung | Währung | Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert) | Gegenpartei | Nicht realisiert (in EUR) |
|------------------------------|----------------------|---------|--|----------------|------------------------------|
| Futures auf Anleihen | | | | | |
| 250 | FTSE DVD IDX 1224 | GBP | 855,620 | J.P. Morgan SE | 58,848 |
| 135 | FTSE DVD IDX /202512 | GBP | 429,470 | J.P. Morgan SE | 787 |
| 16 | FTSE 100 IND /202309 | GBP | 1,404,236 | J.P. Morgan SE | (9,684) |
| 16 | CAC40 10 EUR /202307 | EUR | 1,184,010 | J.P. Morgan SE | 19,165 |
| (57) | CBOE VIX FUT /202307 | USD | 710,018 | J.P. Morgan SE | 83,816 |
| Futures auf Währungen | | | | | |
| (16) | USD/NZD (CME /202309 | USD | 898,258 | J.P. Morgan SE | (275) |
| (9) | USD/AUD (CME /202309 | USD | 549,734 | J.P. Morgan SE | 1,256 |
| (8) | JPN YEN CURR /202309 | USD | 635,197 | J.P. Morgan SE | 16,562 |
| 6 | USD/CAD (CME /202309 | USD | 415,325 | J.P. Morgan SE | (1,842) |
| 8 | INR/USD- CME /202307 | USD | 446,819 | J.P. Morgan SE | (550) |
| 75 | USD/MXN (CME /202309 | USD | 2,007,333 | J.P. Morgan SE | 7,631 |
| (13) | USD/GBP (CME /202309 | USD | 946,030 | J.P. Morgan SE | 1,125 |
| (5) | USD/CHF (CME /202309 | USD | 639,608 | J.P. Morgan SE | (201) |
| 160 | BRAZIL REAL /202308 | USD | 3,063,611 | J.P. Morgan SE | 5,500 |
| 30 | EUR/USD (CME /202309 | USD | 3,749,656 | J.P. Morgan SE | (475) |
| (34) | USD/ZAR (CME /202309 | USD | 8,267,828 | J.P. Morgan SE | 8,857 |
| 17 | EUR/JPY (CM /202309 | JPY | 2,121,662 | J.P. Morgan SE | 84,831 |
| | | | | | 1,151,076 |

Siehe Anhangangabe 10 über Barmittel bei Brokern im Zusammenhang mit Futures.



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Differenzkontrakte

Zum 30. Juni 2023 waren die folgenden CFD-Kontrakte ausstehend:

Candriam L Multi-Asset Premia

| Anzahl | Long- / Short-Position | Währung | Basiswert | Gegenpartei | Nennwert (in EUR) (in absolutem Wert) | Nicht realisiert (in EUR) |
|---------|------------------------|---------|---|---------------------|--|---------------------------|
| 5,500 | Short | JPY | SUZUKI MOTOR COR | SOCIETE GENERALE SA | 181,406 | (3,523) |
| 17,500 | Long | JPY | SBI HOLDING XTKS | SOCIETE GENERALE SA | 307,245 | (7,380) |
| 8,000 | Short | JPY | NEXON CO LTD XTK | SOCIETE GENERALE SA | 139,364 | 8,954 |
| 61,500 | Long | JPY | NISSAN MOTOR CO | SOCIETE GENERALE SA | 229,405 | 17,746 |
| 1,900 | Long | JPY | FUJITSU LTD XTKS JP | SOCIETE GENERALE SA | 224,054 | (5,904) |
| 11,700 | Long | JPY | KYOWA HAKKO KIRIN CO LTD | SOCIETE GENERALE SA | 197,662 | (2,857) |
| 1,700 | Short | JPY | SHIMANO INC | SOCIETE GENERALE SA | 258,308 | (7,816) |
| 18,000 | Long | JPY | AEON CO LTD | SOCIETE GENERALE SA | 335,828 | 16,666 |
| 130 | Long | EUR | HERMES INTERNATIONAL SA XPAR FR | SOCIETE GENERALE SA | 258,700 | 5,174 |
| 1,158 | Long | USD | AXON ENTERPRISE - REGISTERED | SOCIETE GENERALE SA | 207,103 | (7,398) |
| 359 | Long | USD | HUBSPOT INC | SOCIETE GENERALE SA | 175,087 | 3,972 |
| 365 | Long | EUR | RATIONAL NAMEN | SOCIETE GENERALE SA | 241,995 | 10,950 |
| 6,441 | Short | EUR | AMUNDI SA | SOCIETE GENERALE SA | 348,136 | 1,610 |
| 800 | Long | JPY | KOMATSU LTD | SOCIETE GENERALE SA | 19,690 | 81 |
| 956 | Short | USD | BECTON DICKINSON | SOCIETE GENERALE SA | 231,341 | (6,879) |
| 726 | Long | USD | ZEBRA TECHNOLOGIES -A- | SOCIETE GENERALE SA | 196,858 | 7,506 |
| 25,000 | Long | JPY | ASTELLAS PHARMA XTKS JP | SOCIETE GENERALE SA | 340,705 | (17,360) |
| 170,000 | Short | HKD | HONG KONG CHINA GAS SWIRE PACIFIC LTD SIE A XHKG HK | SOCIETE GENERALE SA | 134,613 | 1,988 |
| 30,000 | Long | HKD | SWIRE PACIFIC LTD SIE A XHKG HK | SOCIETE GENERALE SA | 210,709 | 22,281 |
| 110,000 | Short | HKD | SITC INTERNATION | SOCIETE GENERALE SA | 183,983 | (2,059) |
| 3,442 | Short | AUD | RIO TINTO | SOCIETE GENERALE SA | 240,856 | 6,426 |
| 7,830 | Short | EUR | TECHNIP ENER --- | SOCIETE GENERALE SA | 165,291 | (14,994) |
| 2,293 | Long | DKK | PANDORA XCSE DK | SOCIETE GENERALE SA | 187,605 | 11,394 |
| 26,891 | Short | AUD | ORICA LIMITED XASX AU | SOCIETE GENERALE SA | 243,315 | 7,547 |
| 3,317 | Long | EUR | WENDEL SA | SOCIETE GENERALE SA | 311,798 | (17,746) |
| 4,900 | Long | JPY | SHINOBI CO LTD | SOCIETE GENERALE SA | 188,620 | (1,896) |
| 8,511 | Short | EUR | SAMPO OYJ -A- | SOCIETE GENERALE SA | 349,972 | 13,873 |
| 2,500 | Short | JPY | OBIC XTKS JP | SOCIETE GENERALE SA | 365,279 | 9,750 |
| 11,642 | Short | AUD | NEWCREST MINING LTD XASX AU | SOCIETE GENERALE SA | 187,664 | (3,765) |
| 1,265 | Short | EUR | FE NEW XFRA DE | SOCIETE GENERALE SA | 378,868 | (23,909) |
| 13,096 | Short | AUD | FORTESCUE METALS | SOCIETE GENERALE SA | 177,223 | 2,397 |
| 15,393 | Short | AUD | AMPOL - REGISTER | SOCIETE GENERALE SA | 281,188 | 9,392 |
| 12,500 | Short | JPY | DAI-ICHI LIFE INSURANCE CO LT | SOCIETE GENERALE SA | 217,043 | (8,165) |
| 20,699 | Long | AUD | SEEK LTD XASX AU | SOCIETE GENERALE SA | 274,303 | 2,021 |
| 769 | Long | AUD | COCHLEAR XASX AU | SOCIETE GENERALE SA | 107,477 | (3,646) |
| 3,976 | Long | EUR | WIENERBERGER AG | SOCIETE GENERALE SA | 111,487 | (1,908) |
| 14,179 | Short | EUR | FORTUM CORP | SOCIETE GENERALE SA | 173,905 | 11,485 |
| 29,800 | Long | JPY | PANASONIC CORP X COSMOS | SOCIETE GENERALE SA | 331,378 | 14,174 |
| 2,400 | Short | JPY | PHARMACEUTICAL CORP | SOCIETE GENERALE SA | 221,755 | (11,263) |
| 15,671 | Long | EUR | ELIS SA XPAR FR | SOCIETE GENERALE SA | 278,944 | 6,739 |
| 6,700 | Short | JPY | ASAHI GROUP HD X | SOCIETE GENERALE SA | 236,834 | 7,563 |
| 6,500 | Long | JPY | TDK CORP XTKS JP | SOCIETE GENERALE SA | 229,476 | (5,194) |
| 5,325 | Long | EUR | ORION CORPORATIO | SOCIETE GENERALE SA | 202,457 | (7,721) |
| 5,100 | Short | JPY | MURATA MANUFACTU | SOCIETE GENERALE SA | 266,372 | 9,185 |
| 3,115 | Long | EUR | BEIERSDORF AG | SOCIETE GENERALE SA | 377,694 | 4,517 |
| 1,654 | Long | EUR | SOPRA STERIA GROUP XPAR FR | SOCIETE GENERALE SA | 302,351 | 3,308 |
| 48,701 | Long | AUD | SUNCORP GROUP | SOCIETE GENERALE SA | 400,840 | 8,914 |
| 12,100 | Short | JPY | FUKUOKA FINANCIA | SOCIETE GENERALE SA | 228,130 | (17,687) |
| 27,899 | Short | EUR | ORANGE | SOCIETE GENERALE SA | 298,575 | (9,597) |
| 6,100 | Long | JPY | EAST JAPAN RAILW | SOCIETE GENERALE SA | 308,970 | 6,615 |
| 6,100 | Long | JPY | ASICS CORP KOBE | SOCIETE GENERALE SA | 171,022 | 2,979 |
| 206,848 | Long | AUD | TELSTRA CORP | SOCIETE GENERALE SA | 542,676 | (5,048) |
| 2,382 | Long | EUR | CARL ZEISS MEDITEC AG | SOCIETE GENERALE SA | 235,913 | (28,965) |
| 26,100 | Long | JPY | NIKON CORP XTKS | SOCIETE GENERALE SA | 307,448 | 17,710 |
| 38,818 | Long | EUR | AIB GRP - REGISTERED CHNK CH | SOCIETE GENERALE SA | 149,449 | (2,096) |
| 11,320 | Short | DKK | DANSKE BANK | SOCIETE GENERALE SA | 252,368 | (5,929) |



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Differenzkontrakte (Fortsetzung)

Candriam L Multi-Asset Premia (Fortsetzung)

| Anzahl | Long- / Short-Position | Wahrung | Basiswert | Gegenpartei | Nennwert (in EUR) (in absolutem Wert) | Nicht realisiert (in EUR) |
|---------|------------------------|----------|-----------------------------------|---------------------|---|------------------------------|
| 2,729 | Short | EUR | DIASORIN | SOCIETE GENERALE SA | 260,347 | 6,440 |
| 17,300 | Short | JPY | POLA ORBIS HOLDI | SOCIETE GENERALE SA | 229,844 | 3,346 |
| 3,092 | Long | EUR | OESTERR.ELEKTR.WIRT.AG - WBAH AT | SOCIETE GENERALE SA | 227,107 | (2,164) |
| 116,758 | Short | EUR | AIR FRANCE - KLM SA | SOCIETE GENERALE SA | 201,174 | 3,911 |
| 20,200 | Short | JPY | RYOHIN KEIKAKU CO LTD | SOCIETE GENERALE SA | 182,224 | (3,523) |
| 22,398 | Long | AUD | GOODMAN GROUP - STAPLED SECURITY | SOCIETE GENERALE SA | 274,270 | 2,323 |
| 5,039 | Long | EUR | WORLDLINE SA XPA | SOCIETE GENERALE SA | 168,807 | (7,861) |
| 23,060 | Short | AUD | REECE LTD | SOCIETE GENERALE SA | 261,272 | 3,517 |
| 6,800 | Long | JPY | CAPCOM CO LTD | SOCIETE GENERALE SA | 245,587 | 7,029 |
| 1,512 | Short | DKK | DSV XCSE DK | SOCIETE GENERALE SA | 290,990 | (14,621) |
| 4,300 | Short | JPY | KONAMI HLDS SHS | SOCIETE GENERALE SA | 205,091 | 6,026 |
| 37,600 | Short | JPY | CHIBA BANK XTKS | SOCIETE GENERALE SA | 208,378 | (2,575) |
| 9,252 | Long | AUD | BRAMBLES XASX AU | SOCIETE GENERALE SA | 81,343 | 3,048 |
| 4,600 | Long | JPY | KYOCERA CORP XTK | SOCIETE GENERALE SA | 227,276 | (5,280) |
| 3,100 | Long | JPY | CENTRAL JAPAN RAILWAY CO | SOCIETE GENERALE SA | 355,044 | 6,782 |
| 1,500 | Short | JPY | DISCO CO LTD | SOCIETE GENERALE SA | 215,077 | 476 |
| 1,500 | Short | JPY | TOKYO ELECTRON LTD XTKS JP | SOCIETE GENERALE SA | 195,576 | (2,473) |
| 16,100 | Short | JPY | NGK SPARK PLUG C | SOCIETE GENERALE SA | 294,356 | (11,384) |
| 21,199 | Short | EUR | FINMECCANICA SPA | SOCIETE GENERALE SA | 220,364 | (2,014) |
| 50,300 | Long | JPY | OBAYASHI CORP XT | SOCIETE GENERALE SA | 396,817 | 19,618 |
| 34,510 | Long | AUD | QBE INSURANCE GROUP XASX AU | SOCIETE GENERALE SA | 329,940 | 11,370 |
| 6,079 | Short | EUR | SIEMENS HEALTHINEERS | SOCIETE GENERALE SA | 315,257 | 4,012 |
| 40,800 | Long | JPY | RICOH CO LTD XTK | SOCIETE GENERALE SA | 316,309 | (10,091) |
| 3,494 | Short | AUD | WISE TECH GLOBAL | SOCIETE GENERALE SA | 170,138 | (1,428) |
| 8,658 | Short | EUR | GROUPE BRUXELLES | SOCIETE GENERALE SA | 624,761 | 10,909 |
| 13,600 | Short | JPY | ITOCHEU TECHNO-SOLUTIONS CORP CTC | SOCIETE GENERALE SA | 313,592 | 949 |
| 4,834 | Short | EUR | AB INBEV | SOCIETE GENERALE SA | 250,546 | 6,043 |
| 5,070 | Long | EUR | NESTE | SOCIETE GENERALE SA | 178,768 | (26,719) |
| 6,100 | Short | JPY | SOFTBANK GROUP | SOCIETE GENERALE SA | 262,007 | (10,870) |
| 10,200 | Short | JPY | OTSUKA CORP | SOCIETE GENERALE SA | 361,394 | 6,663 |
| 10,200 | Short | JPY | SHIMADZU CORPORATION | SOCIETE GENERALE SA | 286,424 | 8,862 |
| 15,600 | Short | JPY | JAPAN AIRLINES CO LTD | SOCIETE GENERALE SA | 308,661 | (25,969) |
| 7,200 | Long | JPY | AJINOMOTO CO INC XTKS JP | SOCIETE GENERALE SA | 261,357 | (457) |
| 3,000 | Short | JPY | ORACLE CORP JAPA | SOCIETE GENERALE SA | 203,377 | 11,510 |
| 33,663 | Short | EUR | CREDIT AGRICOLE SA | SOCIETE GENERALE SA | 365,984 | (943) |
| 17,400 | Long | JPY | SEIKO EPSON CORP | SOCIETE GENERALE SA | 247,062 | 3,531 |
| 12,608 | Long | EUR | VALEO SA | SOCIETE GENERALE SA | 247,495 | (18,282) |
| 6,400 | Short | JPY | TREND MICRO INC | SOCIETE GENERALE SA | 281,874 | 17,736 |
| 7,954 | Short | DKK | GN GREAT NORDIC | SOCIETE GENERALE SA | 181,813 | 5,128 |
| 44,525 | Short | AUD | ENDEAVOUR GROUP | SOCIETE GENERALE SA | 171,417 | (11,410) |
| 847 | Long | EUR | L OREAL SA XPAR FR | SOCIETE GENERALE SA | 361,754 | 14,653 |
| 5,900 | Long | JPY | DAIICHI SANKYO C | SOCIETE GENERALE SA | 170,242 | (9,354) |
| 1,328 | Short | EUR | SANOFI | SOCIETE GENERALE SA | 130,410 | (5,232) |
| 6,500 | Short | JPY | JAPAN AIRPORT TE | SOCIETE GENERALE SA | 267,935 | (3,710) |
| 51,350 | Short | AUD | SANTOS LTD XASX | SOCIETE GENERALE SA | 235,602 | (6,893) |
| 15,900 | Short | JPY | ANA HD | SOCIETE GENERALE SA | 345,451 | (23,393) |
| 1,000 | Short | JPY | NIPPON SHINYKU C | SOCIETE GENERALE SA | 37,251 | 3,196 |
| 162 | Long | JPY | JP REAL ESTATE INVESTMENT | SOCIETE GENERALE SA | 562,986 | 7,191 |
| 5,754 | Short | DKK | WILLIAM DEMANT HOLDINGS A/S | SOCIETE GENERALE SA | 222,944 | (3,941) |
| 35,964 | Short | EUR | MEDIOBANCA SPA | SOCIETE GENERALE SA | 394,165 | 8,272 |
| 23,100 | Short | JPY | JP POST INSRAN CO | SOCIETE GENERALE SA | 317,375 | (5,786) |
| 42,000 | Long | JPY | SHOEI CO LTD | SOCIETE GENERALE SA | 327,876 | (1,598) |
| 3,364 | Long | EUR | HUGO BOSS AG XETR DE | SOCIETE GENERALE SA | 240,661 | 8,074 |
| 134,757 | Short | EUR | HERA SPA | SOCIETE GENERALE SA | 366,809 | 18,596 |
| 30,300 | Long | JPY | LION CORP | SOCIETE GENERALE SA | 257,964 | (6,821) |
| 2,546 | Short | DKK | ROYAL UNIBREW A/S | SOCIETE GENERALE SA | 208,578 | 9,095 |
| 8,500 | Long | JPY | WEST JAPAN RAILWAY COMPANY | SOCIETE GENERALE SA | 322,885 | 970 |
| 73,416 | Long | EUR | NOKIA OYJ XHEL FI | SOCIETE GENERALE SA | 281,587 | (5,029) |



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Differenzkontrakte (Fortsetzung)

Candriam L Multi-Asset Premia (Fortsetzung)

| Anzahl | Long- / Short- Position | Wahrung | Basiswert | Gegenpartei | Nennwert (in EUR) (in absolutem Wert) | Nicht realisiert (in EUR) |
|---------|----------------------------|----------|--|---------------------|---|------------------------------|
| 20,100 | Short | JPY | LIDA GROUP HOLDINGS CO LTD | SOCIETE GENERALE SA | 309,235 | (2,039) |
| 37,700 | Short | JPY | mitsubishi ufj financial group | SOCIETE GENERALE SA | 254,620 | (17,955) |
| 17,800 | Long | JPY | SUMCO CORP XTKS | SOCIETE GENERALE SA | 228,923 | (3,782) |
| 4,692 | Long | EUR | SCOUT24 | SOCIETE GENERALE SA | 272,511 | (1,877) |
| 17,900 | Long | JPY | JFE HOLDINGS INC | SOCIETE GENERALE SA | 232,707 | 2,327 |
| 442 | Short | EUR | KONE -B- | SOCIETE GENERALE SA | 21,141 | 840 |
| 30,800 | Long | JPY | NISSHIN FLOUR MI | SOCIETE GENERALE SA | 347,577 | (14,259) |
| 5,716 | Long | EUR | BECHTLE | SOCIETE GENERALE SA | 207,605 | (13,090) |
| 31,900 | Long | JPY | SEKISUI CHEMICAL CO LTD | SOCIETE GENERALE SA | 419,163 | 2,731 |
| 14,729 | Short | AUD | ARISTOCRAT LEISU | SOCIETE GENERALE SA | 347,421 | (4,583) |
| 19,800 | Short | USD | SINGAPORE AIRLI | SOCIETE GENERALE SA | 95,882 | 10,213 |
| 19,800 | Short | JPY | SHOWA DENKO KK | SOCIETE GENERALE SA | 292,063 | (6,906) |
| 12,600 | Long | JPY | SUMITOMO FORESTRY CO LTD | SOCIETE GENERALE SA | 278,308 | 5,913 |
| 2,900 | Short | JPY | TSURUHA HOLDINGS INC XTKS JP | SOCIETE GENERALE SA | 196,873 | (5,241) |
| 701 | Long | USD | BIO RAD LABORATORIES -A- | SOCIETE GENERALE SA | 243,596 | 39 |
| 4,135 | Short | USD | CHARLES SCHWAB CORP/THE PAYPAL HOLDINGS INC WI XNAS US | SOCIETE GENERALE SA | 214,823 | (4,434) |
| 2,692 | Long | USD | ORACLE CORP XNAS US | SOCIETE GENERALE SA | 164,654 | 2,171 |
| 2,420 | Short | USD | TOPDANMARK AS | SOCIETE GENERALE SA | 264,159 | 16,547 |
| 7,100 | Short | DKK | CONSTELLATION EN | SOCIETE GENERALE SA | 319,626 | 11,252 |
| 2,046 | Short | USD | KINGFISHER PLC XLON GB | SOCIETE GENERALE SA | 171,688 | 3,582 |
| 109,835 | Long | GBP | HISCOX I15 | SOCIETE GENERALE SA | 296,554 | (5,504) |
| 24,753 | Long | GBP | SERVICENOW INC X | SOCIETE GENERALE SA | 314,695 | (3,173) |
| 449 | Long | USD | ORIX CORP | SOCIETE GENERALE SA | 231,278 | (5,103) |
| 28,600 | Long | JPY | KEYENCE CORP XTKS JP | SOCIETE GENERALE SA | 473,832 | 15,054 |
| 700 | Short | JPY | UNITY SOFTWARE I | SOCIETE GENERALE SA | 301,197 | 13,850 |
| 3,550 | Short | USD | COINBASE GLOBAL | SOCIETE GENERALE SA | 141,284 | (5,694) |
| 3,550 | Short | USD | LONZA GROUP NOM. XVTX CH | SOCIETE GENERALE SA | 232,816 | (56,292) |
| 474 | Long | CHF | SENSATA TECH(S) | SOCIETE GENERALE SA | 259,036 | (15,152) |
| 7,259 | Short | USD | STRYKER CORP XNY | SOCIETE GENERALE SA | 299,342 | 133 |
| 563 | Short | USD | CAESARS ENTERTAI | SOCIETE GENERALE SA | 157,439 | (4,871) |
| 4,041 | Short | USD | TELEFONICA NAMEN AKT XETR | SOCIETE GENERALE SA | 188,790 | (2,778) |
| 83,527 | Long | EUR | FORTUNE BRANDS H | SOCIETE GENERALE SA | 215,249 | (668) |
| 4,366 | Short | USD | QUINTILES IMS HOLDING INC | SOCIETE GENERALE SA | 287,932 | (18,569) |
| 1,540 | Long | USD | GVC HOLDINGS PLC | SOCIETE GENERALE SA | 317,274 | 11,278 |
| 15,955 | Short | GBP | GRIFOLS SA -A- | SOCIETE GENERALE SA | 236,494 | (13,015) |
| 14,608 | Short | EUR | CROWN HOLDINGS INC | SOCIETE GENERALE SA | 171,498 | (6,720) |
| 3,564 | Short | USD | EMBRACER GRP | SOCIETE GENERALE SA | 283,781 | (392) |
| 64,448 | Short | SEK | ESSITY REGISTERE | SOCIETE GENERALE SA | 147,444 | 3,391 |
| 7,911 | Long | SEK | ALPHABET INC XNAS US | SOCIETE GENERALE SA | 192,736 | 4,095 |
| 2,558 | Long | USD | APA - REGISTERED | SOCIETE GENERALE SA | 280,653 | (12,638) |
| 5,507 | Short | USD | BENTLEY SYSTEMS | SOCIETE GENERALE SA | 172,479 | 2,524 |
| 4,517 | Short | USD | EQT AB | SOCIETE GENERALE SA | 224,525 | (869) |
| 8,862 | Long | SEK | STARBUCKS CORP X | SOCIETE GENERALE SA | 155,969 | (11,506) |
| 3,169 | Long | USD | WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC | SOCIETE GENERALE SA | 287,737 | (6,739) |
| 663 | Long | USD | WORKDAY -A- | SOCIETE GENERALE SA | 232,427 | 13,777 |
| 1,143 | Long | USD | BOVIS HOMES GROU | SOCIETE GENERALE SA | 236,657 | 1,655 |
| 29,664 | Short | GBP | FIRST SOLAR INC XNAS US | SOCIETE GENERALE SA | 228,318 | 28,172 |
| 681 | Long | USD | B M EUROPEAN VALUE RETAIL | SOCIETE GENERALE SA | 118,654 | (1,742) |
| 33,770 | Short | GBP | ADDTech - REGIST | SOCIETE GENERALE SA | 219,191 | (2,991) |
| 9,256 | Short | SEK | CELLNEX TELECOM | SOCIETE GENERALE SA | 184,425 | 1,257 |
| 9,560 | Long | EUR | INTERNATIONAL PA | SOCIETE GENERALE SA | 353,624 | 5,927 |
| 9,561 | Short | USD | MERCADOLIBRE XNA | SOCIETE GENERALE SA | 278,768 | 0 |
| 147 | Long | USD | TEXAS PACIFIC LAND TRUS | SOCIETE GENERALE SA | 159,612 | (5,278) |
| 133 | Short | USD | LEGAL GENERAL GR | SOCIETE GENERALE SA | 160,490 | 5,559 |
| 187,779 | Long | GBP | TRANSCANADA - RE | SOCIETE GENERALE SA | 497,374 | (10,284) |
| 7,315 | Short | CAD | ALTAGAS | SOCIETE GENERALE SA | 271,279 | 4,661 |
| 15,975 | Short | CAD | WISE PLC XLON GB | SOCIETE GENERALE SA | 263,355 | 111 |
| 24,415 | Long | GBP | | SOCIETE GENERALE SA | 186,978 | 10,811 |



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Differenzkontrakte (Fortsetzung)

Candriam L Multi-Asset Premia (Fortsetzung)

| Anzahl | Long- / Short-Position | Wahrung | Basiswert | Gegenpartei | Nennwert (in EUR) (in absolutem Wert) | Nicht realisiert (in EUR) |
|---------|------------------------|----------|---|---------------------|---|------------------------------|
| 4,711 | Long | CHF | NOVARTIS AG REG SHS XVTX CH | SOCIETE GENERALE SA | 434,394 | (1,786) |
| 2,123 | Long | CAD | CANADIAN IMPERIAL BANK O XTSE CA | SOCIETE GENERALE SA | 83,173 | (2,147) |
| 518 | Long | USD | SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC | SOCIETE GENERALE SA | 127,743 | (3,993) |
| 1,775 | Short | USD | DOLLAR GENERAL X | SOCIETE GENERALE SA | 276,223 | (9,924) |
| 28,050 | Short | USD | DISH NETWORK -A- AUTOMATIC DATA PROCESSIN XNAS US | SOCIETE GENERALE SA | 169,431 | (8,999) |
| 1,354 | Long | USD | INVESCO LTD XNYS US | SOCIETE GENERALE SA | 272,773 | (1,464) |
| 17,993 | Short | USD | INDIVIOR PLC | SOCIETE GENERALE SA | 277,234 | 1,484 |
| 8,784 | Short | GBP | BARCLAYS PLC XLON GB | SOCIETE GENERALE SA | 186,602 | (5,220) |
| 164,954 | Short | GBP | DEXCOM INC XNAS | SOCIETE GENERALE SA | 294,828 | 807 |
| 1,287 | Long | USD | KONGSBERG GRUPPEN | SOCIETE GENERALE SA | 151,597 | (2,914) |
| 5,565 | Short | NOK | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC | SOCIETE GENERALE SA | 232,436 | (8,380) |
| 2,350 | Long | USD | SYNOPSIS | SOCIETE GENERALE SA | 271,295 | (6,117) |
| 118 | Long | USD | SECTRA --- REGI | SOCIETE GENERALE SA | 47,093 | (1,185) |
| 2,455 | Short | SEK | ALCON --- REGIST | SOCIETE GENERALE SA | 37,687 | 2,229 |
| 4,516 | Long | CHF | SKANSKA -B- FREE | SOCIETE GENERALE SA | 342,847 | 11,474 |
| 18,842 | Short | SEK | AIR CANADA - VOTING AND VARIABLE | SOCIETE GENERALE SA | 241,676 | (4,557) |
| 10,788 | Short | CAD | CLARIANT NAMEN A | SOCIETE GENERALE SA | 186,737 | (9,864) |
| 21,346 | Long | CHF | FAIR ISAAC CORP | SOCIETE GENERALE SA | 282,558 | (2,624) |
| 290 | Long | USD | OPEN HOUSE CO LTD | SOCIETE GENERALE SA | 215,097 | 1,887 |
| 1,400 | Short | JPY | VODAFONE GR GBP | SOCIETE GENERALE SA | 45,874 | 2,521 |
| 234,749 | Long | GBP | DOLLAR TREE INC | SOCIETE GENERALE SA | 202,347 | 301 |
| 1,653 | Short | USD | NOVOCURE --- REG | SOCIETE GENERALE SA | 217,420 | (7,667) |
| 3,733 | Short | USD | RIO TINTO PLC XLON GB | SOCIETE GENERALE SA | 141,998 | 8,212 |
| 4,544 | Short | GBP | BAKKAFROST XOSL | SOCIETE GENERALE SA | 263,988 | 18,930 |
| 2,953 | Long | NOK | MICRON TECHNOLOGY XNAS US | SOCIETE GENERALE SA | 162,196 | (11,748) |
| 3,072 | Long | USD | VERISIGN INC XNAS US | SOCIETE GENERALE SA | 177,703 | (16,078) |
| 1,442 | Long | USD | WEST FRASER TIMBER CO XTSE CA | SOCIETE GENERALE SA | 298,670 | 1,665 |
| 1,124 | Long | CAD | LINCOLN NATIONAL CORP | SOCIETE GENERALE SA | 88,607 | 7,217 |
| 9,009 | Long | USD | DENTSPLY SIRONA | SOCIETE GENERALE SA | 212,715 | 10,900 |
| 7,292 | Short | USD | MOLSON COORS BREWING CO XNYS US | SOCIETE GENERALE SA | 267,485 | (10,895) |
| 5,394 | Short | USD | ATLISSIAN CORPOR | SOCIETE GENERALE SA | 325,519 | 3,758 |
| 996 | Short | USD | SAAB AB -SHS-B- UNKNOWN EQ | SOCIETE GENERALE SA | 153,198 | 13,128 |
| 3,277 | Short | SEK | COCA COLA EUROPEAN PARTN XNYS US | SOCIETE GENERALE SA | 162,178 | (389) |
| 4,976 | Short | USD | ONEOK INC (NEW) | SOCIETE GENERALE SA | 293,862 | 5,428 |
| 4,221 | Short | USD | CHIPOTLE MEXICAN GRILL - XNYS US | SOCIETE GENERALE SA | 238,790 | (2,360) |
| 121 | Long | USD | APPLE INC XNAS US | SOCIETE GENERALE SA | 237,231 | 9,687 |
| 1,845 | Long | USD | ITALGAS REG | SOCIETE GENERALE SA | 328,024 | 13,461 |
| 91,542 | Short | EUR | J SAINSBURY PLC | SOCIETE GENERALE SA | 496,615 | 4,119 |
| 94,868 | Long | GBP | SAP AG XETR DE | SOCIETE GENERALE SA | 297,378 | (3,759) |
| 2,926 | Long | EUR | SQUARE -A- | SOCIETE GENERALE SA | 366,160 | 1,053 |
| 3,168 | Long | USD | DET NORSKE OLJES | SOCIETE GENERALE SA | 193,303 | 1,103 |
| 4,326 | Short | NOK | ROYAL PHILIPS ELECTRONIC | SOCIETE GENERALE SA | 93,193 | 2,961 |
| 10,748 | Short | EUR | IDEXX LABS CORP | SOCIETE GENERALE SA | 212,896 | (12,511) |
| 742 | Long | USD | ALLFUNDS GROUP P | SOCIETE GENERALE SA | 341,572 | 14,153 |
| 25,446 | Short | EUR | CADENCE DESIGN SYSTEMS INC | SOCIETE GENERALE SA | 142,243 | 19,593 |
| 1,218 | Long | USD | ENPHASE ENERGY X | SOCIETE GENERALE SA | 261,820 | (3,628) |
| 645 | Long | USD | SONOVA HOLDING N | SOCIETE GENERALE SA | 99,014 | (7,703) |
| 793 | Long | CHF | CARNIVAL CORP XN | SOCIETE GENERALE SA | 193,528 | 731 |
| 12,300 | Short | USD | SYNCHRONY FINANCIAL | SOCIETE GENERALE SA | 212,291 | (30,553) |
| 7,119 | Long | USD | ROYAL BANK OF CANADA XTSE CA | SOCIETE GENERALE SA | 221,335 | 3,132 |
| 5,313 | Long | CAD | ENTEGRIS INC | SOCIETE GENERALE SA | 465,610 | 2,539 |
| 1,555 | Short | USD | DKSH HOLDING SA | SOCIETE GENERALE SA | 157,952 | (1,696) |
| 3,409 | Short | CHF | PARKLAND FUEL - | SOCIETE GENERALE SA | 232,436 | 8,208 |
| 13,778 | Short | CAD | | SOCIETE GENERALE SA | 314,937 | 10,307 |



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Differenzkontrakte (Fortsetzung)

Candriam L Multi-Asset Premia (Fortsetzung)

| Anzahl | Long- / Short-Position | Währung | Basiswert | Gegenpartei | Nennwert (in EUR) (in absolutem Wert) | Nicht realisiert (in EUR) |
|--------|------------------------|---------|----------------------------------|---------------------|---|------------------------------|
| 196 | Short | USD | CVS HEALTH | SOCIETE GENERALE SA | 12,419 | 66 |
| 314 | Long | USD | METTLER TOLEDO I | SOCIETE GENERALE SA | 377,502 | (7,095) |
| 1,673 | Long | USD | SPLUNK XNAS US | SOCIETE GENERALE SA | 162,684 | (6,732) |
| 22,842 | Short | EUR | ENAGAS | SOCIETE GENERALE SA | 411,156 | 3,426 |
| 2,197 | Short | USD | EXTRA SPACE STORAGE INC | SOCIETE GENERALE SA | 299,747 | (6,182) |
| 27,836 | Short | SEK | SECURITAS -B- FREE | SOCIETE GENERALE SA | 208,955 | (8,645) |
| 3,089 | Short | USD | T ROWE PRICE GRO | SOCIETE GENERALE SA | 317,168 | 7,560 |
| 974 | Long | CAD | BANK OF MONTREAL XTSE CA | SOCIETE GENERALE SA | 80,716 | 695 |
| 808 | Long | USD | UNITED THERAPEUTICS CORP | SOCIETE GENERALE SA | 163,489 | (6,547) |
| 4,862 | Long | GBP | INTERCONTINENT H | SOCIETE GENERALE SA | 307,873 | (5,779) |
| 9,433 | Long | USD | FIFTH THIRD BANCORP | SOCIETE GENERALE SA | 226,617 | (4,755) |
| 5,009 | Long | USD | INCYTE CORP | SOCIETE GENERALE SA | 285,802 | (1,515) |
| 297 | Short | USD | BROADCOM - REGIS | SOCIETE GENERALE SA | 236,138 | 4,356 |
| 19,853 | Long | GBP | INFORMA PLC (US) | SOCIETE GENERALE SA | 167,958 | (555) |
| 712 | Long | USD | ALBERMARLE CORPO | SOCIETE GENERALE SA | 145,591 | (5,103) |
| 8,985 | Short | USD | NORVERGIAN CRUISE LINE LTD | SOCIETE GENERALE SA | 179,288 | (18,365) |
| 99,644 | Long | EUR | KONINKLIJKE KPN NV | SOCIETE GENERALE SA | 325,736 | 17,139 |
| 2,081 | Long | USD | LAMB WESTON HOLDINGS REG WI | SOCIETE GENERALE SA | 219,258 | 401 |
| 5,364 | Long | USD | COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS - | SOCIETE GENERALE SA | 320,955 | 2,655 |
| 2,153 | Short | USD | WHIRLPOOL CORP X | SOCIETE GENERALE SA | 293,625 | (1,026) |
| 3,300 | Long | JPY | IBIDEN XTKS JP | SOCIETE GENERALE SA | 169,512 | 649 |
| 4,005 | Short | USD | UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC | SOCIETE GENERALE SA | 201,425 | (4,736) |
| 2,218 | Short | USD | BLACKSTONE GROUP | SOCIETE GENERALE SA | 189,008 | (651) |
| 2,719 | Short | USD | IBM CORP XNYS US | SOCIETE GENERALE SA | 333,482 | 11,439 |
| 56,721 | Short | USD | GRAB HOLDINGS LI | SOCIETE GENERALE SA | 178,325 | 520 |
| 1,210 | Long | USD | AUTODESK INC XNAS US | SOCIETE GENERALE SA | 226,928 | (18,655) |
| 66,353 | Short | EUR | CAIXABANK XMCE ES | SOCIETE GENERALE SA | 251,279 | (5,972) |
| 201 | Long | USD | WATERS | SOCIETE GENERALE SA | 49,106 | (286) |
| 15,200 | Short | JPY | TECMO KOEI HOLDINGS | SOCIETE GENERALE SA | 239,585 | (10,700) |
| 47,960 | Long | EUR | INMOBILIARIA COLONIAL SA | SOCIETE GENERALE SA | 265,938 | (5,276) |
| 2,028 | Short | USD | HYATT -A- XNYS U | SOCIETE GENERALE SA | 212,986 | (3,457) |
| 8,488 | Long | USD | BANK OF NEW YORK MELLON CORP | SOCIETE GENERALE SA | 346,366 | (2,723) |
| 7,969 | Short | EUR | OCI REG.SHS | SOCIETE GENERALE SA | 175,079 | 2,231 |
| 43,859 | Long | GBP | RIGHTMOVE -REGISTERED SHS | SOCIETE GENERALE SA | 267,401 | (4,089) |
| 7,562 | Short | NOK | YARA INTERNATIONAL ASA | SOCIETE GENERALE SA | 245,198 | (6,858) |
| 5,735 | Long | USD | XOSL NO | SOCIETE GENERALE SA | 105,185 | (4,626) |
| 2,899 | Long | USD | ANNALY CAPITAL M | SOCIETE GENERALE SA | 105,597 | (7,414) |
| 18,409 | Short | GBP | FUTU HOLDINGS - | SOCIETE GENERALE SA | 219,990 | 33,572 |
| 9,044 | Short | CAD | PERSIMMON PLC XL | SOCIETE GENERALE SA | 308,462 | (63) |
| 2,425 | Long | CAD | ENBRIDGE INC XTSE CA | SOCIETE GENERALE SA | 143,817 | (3,057) |
| 552 | Long | USD | SHOPIFY -A- SUBORD VOTING | SOCIETE GENERALE SA | 56,004 | 567 |
| 3,020 | Long | USD | SKYWORKS SOLUTIO | SOCIETE GENERALE SA | 248,769 | (6,090) |
| 14,757 | Long | GBP | AKAMAI TECHNOLOG | SOCIETE GENERALE SA | 342,378 | 15,907 |
| 1,469 | Short | USD | ASSOCIATED BRITI | SOCIETE GENERALE SA | 132,466 | (256) |
| 3,124 | Short | USD | DATADOG INC | SOCIETE GENERALE SA | 292,156 | 1,374 |
| 1,089 | Short | USD | QORVO INC XNAS U | SOCIETE GENERALE SA | 479,919 | (19,624) |
| 1,656 | Short | USD | ROPER TECHNOLOGIES | SOCIETE GENERALE SA | 157,464 | (11,885) |
| 17,683 | Long | USD | ROYAL CARIBBEAN CRUISES XNYS US | SOCIETE GENERALE SA | 272,782 | (4,538) |
| 30,685 | Short | USD | HOST HOTELS RESO | SOCIETE GENERALE SA | 280,693 | (1,125) |
| 6,683 | Short | USD | VIATRIS INC - RE | SOCIETE GENERALE SA | 371,210 | (2,450) |
| 339 | Short | USD | SS C TECHNOLOGIERS HOLDINGS | SOCIETE GENERALE SA | 127,705 | (7,951) |
| 2,978 | Short | USD | MONGODB INC XNAS | SOCIETE GENERALE SA | 397,431 | (8,243) |
| 2,978 | Short | USD | ZIMMER HOLDINGS INC XNYS US | SOCIETE GENERALE SA | 107,738 | 2,866 |
| 39,800 | Short | JPY | CHEWY INC XNYS U | SOCIETE GENERALE SA | 388,692 | (4,038) |
| 544 | Long | CHF | SOFTBANK XTKS JP | SOCIETE GENERALE SA | 191,282 | (8,583) |
| 1,511 | Long | EUR | TECAN GROUP NAM.AKT | SOCIETE GENERALE SA | 83,286 | 6,830 |
| 8,211 | Long | USD | PUMA AG | SOCIETE GENERALE SA | 346,503 | (18,966) |
| | | | CITIGROUP XNYS US | SOCIETE GENERALE SA | | |



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Differenzkontrakte (Fortsetzung)

Candriam L Multi-Asset Premia (Fortsetzung)

| Anzahl | Long- / Short-Position | Wahrung | Basiswert | Gegenpartei | Nennwert (in EUR) (in absolutem Wert) | Nicht realisiert (in EUR) |
|---------|------------------------|----------|--|---------------------|---|------------------------------|
| 3,346 | Short | USD | MGM RESORTS INTL | SOCIETE GENERALE SA | 134,699 | (613) |
| 1,239 | Long | USD | ACCENTURE - SHS | SOCIETE GENERALE SA | 350,441 | (17,251) |
| 2,369 | Long | DKK | NOVO NORDISK XCSE DK | SOCIETE GENERALE SA | 349,785 | (1,591) |
| 56,600 | Long | JPY | NSK LTD XTKS JP | SOCIETE GENERALE SA | 329,289 | 7,035 |
| 6,873 | Short | USD | PG AND E CORP | SOCIETE GENERALE SA | 108,859 | (189) |
| 123,378 | Long | EUR | BANCO SABADELL REG.SHS | SOCIETE GENERALE SA | 130,040 | 6,477 |
| 8,250 | Short | USD | WILLIAMS COS INC | SOCIETE GENERALE SA | 246,744 | (15,577) |
| 7,761 | Short | GBP | WEIR GROUP PLC XLON GB | SOCIETE GENERALE SA | 158,810 | 6,059 |
| 870 | Long | USD | LPL FINANCIAL HOLDINGS INC | SOCIETE GENERALE SA | 173,386 | 2,759 |
| 2,876 | Short | USD | BUNGE LTD | SOCIETE GENERALE SA | 248,717 | (395) |
| 1,896 | Short | EUR | BESI -REGISTERED | SOCIETE GENERALE SA | 188,273 | 1,801 |
| 649 | Long | USD | PAYCOM SOFTWARE INC | SOCIETE GENERALE SA | 191,095 | (1,612) |
| 9,920 | Short | SEK | GETINGE -B- UNKNOWN E UNKNOWN EQ | SOCIETE GENERALE SA | 159,058 | 53,076 |
| 4,700 | Long | JPY | NEC CORP | SOCIETE GENERALE SA | 207,597 | (1,908) |
| 51,756 | Long | EUR | EDP-ENERGIAS REG.SHS BANCO SANTANDER SA REG S | SOCIETE GENERALE SA | 231,660 | (8,488) |
| 73,215 | Short | EUR | XMCE ES | SOCIETE GENERALE SA | 247,833 | (13,984) |
| 4,975 | Short | USD | DOW --- REGISTER | SOCIETE GENERALE SA | 242,868 | 1,003 |
| 11,968 | Long | GBP | HIKMA PHARMACEUT | SOCIETE GENERALE SA | 263,654 | (4,811) |
| 2,139 | Long | USD | HILTON WORLD REG | SOCIETE GENERALE SA | 285,363 | 9,568 |
| 1,416 | Short | USD | GENERAC HOLDINGS INC | SOCIETE GENERALE SA | 193,555 | (35,173) |
| 6,337 | Short | USD | BAXTER INTERNATIONAL INC | SOCIETE GENERALE SA | 264,632 | (6,389) |
| 832 | Long | USD | EVEREST REINSURANCE GROUP | SOCIETE GENERALE SA | 260,704 | (1,823) |
| 1,332 | Long | USD | VEEVA SYSTEMS -A | SOCIETE GENERALE SA | 241,408 | (4,383) |
| 96 | Short | CHF | EMS-CHEM HOLDINGS- NAMEN ACT. | SOCIETE GENERALE SA | 66,587 | 2,508 |
| 2,015 | Long | USD | TWILIO INC XNYS | SOCIETE GENERALE SA | 117,502 | (8,219) |
| 3,022 | Long | USD | AGILENT TECHNOLOGIES | SOCIETE GENERALE SA | 333,085 | (2,715) |
| 10,689 | Short | USD | LIBERTY MEDIA -C- SIRIUS XM | SOCIETE GENERALE SA | 320,670 | (18,994) |
| 4,446 | Short | NOK | SALMAR XOSL NO | SOCIETE GENERALE SA | 164,664 | 6,809 |
| 13,223 | Short | GBP | ENERGEAN - REGISTERED SHS | SOCIETE GENERALE SA | 157,785 | 14,022 |
| 140,182 | Long | SEK | TELIASONERA AB UNKNOWN EQ | SOCIETE GENERALE SA | 281,334 | (5,948) |
| 2,874 | Short | USD | MICROCHIP TECHNOLOGY | SOCIETE GENERALE SA | 236,005 | (11,117) |
| 2,086 | Short | USD | ABBVIE INC WI XN | SOCIETE GENERALE SA | 257,605 | 2,218 |
| 5,818 | Long | EUR | AMADEUS IT HOLDINGS -A- XMCE ES | SOCIETE GENERALE SA | 405,515 | 0 |
| 4,288 | Short | USD | BTH & BDY WRKS | SOCIETE GENERALE SA | 147,388 | 8,725 |
| 4,307 | Short | USD | MEDTRONIC HLD XN | SOCIETE GENERALE SA | 347,797 | 592 |
| 18,954 | Short | GBP | SMITH AND NEPHEW PLC XLON GB | SOCIETE GENERALE SA | 280,064 | (3,755) |
| 32,026 | Long | SEK | ELEKTA INSTRUMENT -B- UNKNOWN EQ | SOCIETE GENERALE SA | 226,493 | (1,794) |
| 1,204 | Short | USD | HESS CORP | SOCIETE GENERALE SA | 150,031 | (155) |
| 10,598 | Short | USD | KINDER MORGAN | SOCIETE GENERALE SA | 167,275 | (2,040) |
| 43,141 | Long | GBP | BP PLC XLON GB | SOCIETE GENERALE SA | 230,422 | (679) |
| 10,700 | Long | JPY | HONDA MOTOR CO L | SOCIETE GENERALE SA | 294,561 | (11,535) |
| 10,458 | Long | USD | DISCOVERY INC X | SOCIETE GENERALE SA | 120,205 | (5,656) |
| 959 | Short | USD | DOMINO PIZZA INC | SOCIETE GENERALE SA | 296,218 | (10,135) |
| 880 | Long | USD | DANAHER CORP XNY | SOCIETE GENERALE SA | 193,584 | (2,831) |
| 3,221 | Long | USD | FORTINET XNAS US | SOCIETE GENERALE SA | 223,167 | 5,905 |
| 1,686 | Long | USD | VISA INC -A- XNY | SOCIETE GENERALE SA | 366,995 | 17,478 |
| 2,330 | Short | USD | SEA -A- ADR REPR | SOCIETE GENERALE SA | 123,953 | 10,315 |
| 3,871 | Long | USD | CERIDIAN --- REGISTERED SHS | SOCIETE GENERALE SA | 237,618 | (2,945) |
| 62 | Long | USD | MICROSOFT CORP XNAS US | SOCIETE GENERALE SA | 19,352 | (430) |
| 13,752 | Long | EUR | ABN AMRO GROUP DEP RECEIPT | SOCIETE GENERALE SA | 195,691 | 3,438 |
| 4,521 | Long | USD | COMERICA INC | SOCIETE GENERALE SA | 175,536 | (2,155) |
| 1,155 | Short | CHF | ROCHE HOLDING AG GENUSSS XVTX CH | SOCIETE GENERALE SA | 323,644 | 2,367 |
| 2,314 | Short | USD | WAL-MART STORES | SOCIETE GENERALE SA | 333,377 | 1,167 |
| 4,093 | Long | USD | LIBERTY MEDIA -C- MEDIA GROUP | SOCIETE GENERALE SA | 282,421 | (17,558) |
| 676 | Long | DKK | GENMAB AS XCSE DK | SOCIETE GENERALE SA | 234,232 | (4,085) |
| 6,198 | Short | GBP | ANGLO AMERICAN PLC XLON GB | SOCIETE GENERALE SA | 161,279 | 25,062 |



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Differenzkontrakte (Fortsetzung)

Candriam L Multi-Asset Premia (Fortsetzung)

| Anzahl | Long- / Short- Position | Wahrung | Basiswert | Gegenpartei | Nennwert (in EUR) (in absolutem Wert) | Nicht realisiert (in EUR) |
|---------|----------------------------|----------|-------------------------------------|---------------------|---|------------------------------|
| 407 | Long | USD | CINTAS | SOCIETE GENERALE SA | 185,437 | 1,753 |
| 14,916 | Short | SEK | EPIROC- REGISTERED SHS A | SOCIETE GENERALE SA | 258,088 | (1,013) |
| 682,944 | Short | EUR | TELECOM ITALIA SPA | SOCIETE GENERALE SA | 176,063 | (273) |
| 22,055 | Long | EUR | ENI SPA | SOCIETE GENERALE SA | 290,729 | 2,911 |
| 6,702 | Short | USD | CFD EBOS GROUP 1 | SOCIETE GENERALE SA | 138,308 | (3,183) |
| 36,200 | Short | USD | CFD VENTURE CORP | SOCIETE GENERALE SA | 360,652 | 27,629 |
| 146,800 | Short | USD | CFD SINGAPORE TE | SOCIETE GENERALE SA | 365,881 | 2,487 |
| 56,900 | Short | HKD | BUDWEISER BREWIN | SOCIETE GENERALE SA | 134,435 | 10,648 |
| 162,000 | Short | HKD | HKT LTD - STAPLED SECURITY | SOCIETE GENERALE SA | 172,617 | 1,705 |
| 17,100 | Long | HKD | HANG SENG BANK L | SOCIETE GENERALE SA | 223,008 | (3,200) |
| 16,000 | Short | HKD | GALAXY ENTERTAINMENT GRO XHKG HK | SOCIETE GENERALE SA | 93,009 | 3,930 |
| 93,206 | Long | USD | AUCKLAND INTERN1 | SOCIETE GENERALE SA | 447,502 | 6,388 |
| 9,400 | Long | HKD | SWIRE PROPERTIES LTD | SOCIETE GENERALE SA | 21,175 | (506) |
| 99,000 | Short | HKD | XINYI GLASS HOLDINGS LTD XHKG HK | SOCIETE GENERALE SA | 141,268 | 7,179 |
| 4,415 | Long | CAD | THOMSON REUTERS COR | SOCIETE GENERALE SA | 546,974 | 8,595 |
| | | | | | | (177,637) |

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 2023 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 V1 MKT | BNP Paribas Paris | 3,000,000 | 20/12/2027 | EUR | Sell | 0.05 | 146,318 |
| | | | | | | | 146,318 |

Einzelheiten zu Sicherheiten finden Sie in Anhangangabe 11 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 Mindestzeichnung 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 2023 berechnet wurden.

Der Nettoinventarwert der Teilfonds wurde zum 3. Juli 2023 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 2023 verwendete Wechselkurse:

| | | | | | | | |
|---------|--------------|---------|-----------------|---------|---------------|---------|--------------|
| 1 EUR = | 1.639000 AUD | 1 EUR = | 0.858150 GBP | 1 EUR = | 11.688500 NOK | 1 EUR = | 1.091000 USD |
| 1 EUR = | 1.443700 CAD | 1 EUR = | 8.549700 HKD | 1 EUR = | 1.780800 NZD | | |
| 1 EUR = | 0.976050 CHF | 1 EUR = | 157.687700 JPY | 1 EUR = | 11.784250 SEK | | |
| 1 EUR = | 7.445950 DKK | 1 EUR = | 1437.556150 KRW | 1 EUR = | 1.476500 SGD | | |

Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 2 – Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

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 2023 nicht herausgerechnet. Zum 30. Juni 2023 belief sich der Gesamtbetrag der SICAV-internen Anlagen auf EUR 14.314.181,00. Daher würde sich das kombinierte Nettovermögen zum Abschlussstichtag auf 852.535.002,00 EUR belaufen, wenn diese SICAV-internen Anlagen herausgerechnet würden.

| Teilfonds | SICAV-interne Anlagen | Betrag (in EUR) |
|--|-----------------------|-----------------|
| Candriam L Balanced Asset Allocation | 4,681,661 | 4,681,661 |
| Candriam L Conservative Asset Allocation | 9,430,654 | 9,430,654 |
| Candriam L Dynamic Asset Allocation | 201,866 | 201,866 |
| | | 14,314,181,00 |

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 2023 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 2023 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% |
| | Z | Thesaurierung | LU0982875071 | 0.00% |
| Candriam L Conservative Asset Allocation | 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% |
| | Z | Thesaurierung | LU0982875584 | 0.00% |
| Candriam L Dynamic Asset Allocation | C | Thesaurierung | LU0982876806 | 1.30% |
| | C | Ausschüttung | LU0982876988 | 1.30% |
| | I | Thesaurierung | LU0982877101 | 0.50% |
| | R | Thesaurierung | LU1427870677 | 0.70% |
| | R2 | Ausschüttung | LU1427870834 | 0.32% |
| | V | Thesaurierung | LU0982877283 | 0.35% |
| | Z | Thesaurierung | LU0982877366 | 0.00% |
| | Candriam L Multi-Asset Income | C | Thesaurierung | LU0982876392 |
| 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 |
| 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% |



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 3 – Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

Die nachfolgende Tabelle gibt Auskunft über die jährliche maximale Verwaltungsgebühr derjenigen OGAW, in welche die verschiedenen Teilfonds von Candriam L zum 30. Juni 2023 investiert sind:

| Zielfonds | Höchstsatz |
|--|------------|
| CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z EUR C Z CAPITALISATION | 0.25% |
| MW GAVEKAL CHINA FI -A- CAP | 0.50% |
| LUMYNA MW TOPS MN UCITS CL B | 0.00% |
| CANDRIAM BONDS EMERGING MARKETS CORPORATE Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM EQUITIES L BIOTECHNOLOGY Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM BONDS TOTAL RETURN Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM BONDS EURO GOVERNMENT Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM BONDS EURO DIVERSIFIED Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM BONDS EURO SHORT TERM Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM BONDS GLOBAL HIGH YIELD Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM EQUITIES L EUROPE INNOVATION Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM BONDS CONVERTIBLE DEFENSIVE Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CLEOME INDEX EUROPE EQUITIES Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CLEOME INDEX USA EQUITIES Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME & GROWTH Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO CORPORATE Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY EUROPE Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EMERGING MARKETS Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY EMERGING MARKETS Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM EQUITIES L ROBOTICS & INNOVATIVE TECHNOLOGY Z CAPITALISATION | 0.00% |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE CORPORATE EURO BOND UCITS ETF DISTRIBUTION | 0.20% |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE EUROPE EQUITY UCITS ETF CAPITALISATION | 0.15% |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE JAPAN EQUITY UCITS ETF CAPITALISATION | 0.20% |
| CANDRIAM BONDS CAPITAL SECURITIES Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET PREMIA Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQUITY MARKET NEUTRAL | 0.00% |
| CANDRIAM BONDS FLOATING RATE NOTES Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM EQUITIES L ONCOLOGY IMPACT Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY CLIMATE ACTION Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM BONDS CREDIT ALPHA Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY CIRCULAR ECONOMY Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM EQUITIES L RISK ARBITRAGE OPPORTUNITIES Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY US Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY QUANT EUROPE Z CAPITALISATION | 0.00% |
| CANDRIAM BONDS EMERGING MARKETS TOTAL RETURN Z CAPITALISATION | 0.00% |

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.



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 4 – Betriebs- und Verwaltungskosten (Fortsetzung)

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 2023 gelten die folgenden Höchstsätze:

| Teilfonds | Anteilsklasse | Anteilsart | ISIN | Höchstsatz |
|---|---------------|---------------|--------------|------------|
| Candriam L. Balanced Asset Allocation | C | Thesaurierung | LU0982874694 | 0.10% |
| | C | Ausschüttung | LU0982874777 | 0.10% |
| | I | Thesaurierung | LU0982874850 | 0.05% |
| | I | Ausschüttung | LU1207304871 | 0.05% |
| | R2 | Thesaurierung | LU1427870321 | 0.10% |
| | R2 | Ausschüttung | LU1427870594 | 0.10% |
| | V | Thesaurierung | LU0982874934 | 0.05% |
| Candriam L. Conservative Asset Allocation | Z | Thesaurierung | LU0982875071 | 0.05% |
| | C | Thesaurierung | LU0982875154 | 0.10% |
| | I | Thesaurierung | LU0982875311 | 0.05% |
| | I | Ausschüttung | LU1207304798 | 0.05% |
| | R2 | Thesaurierung | LU1427870164 | 0.10% |
| | R2 | Ausschüttung | LU1427870248 | 0.10% |
| | V | Thesaurierung | LU0982875402 | 0.05% |
| Candriam L. Dynamic Asset Allocation | Z | Thesaurierung | LU0982875584 | 0.05% |
| | C | Thesaurierung | LU0982876806 | 0.10% |
| | C | Ausschüttung | LU0982876988 | 0.10% |
| | I | Thesaurierung | LU0982877101 | 0.05% |
| | R | Thesaurierung | LU1427870677 | 0.10% |
| | R2 | Ausschüttung | LU1427870834 | 0.10% |
| | V | Thesaurierung | LU0982877283 | 0.05% |
| Candriam L. Multi-Asset Income | Z | Thesaurierung | LU0982877366 | 0.05% |
| | C | Thesaurierung | LU0982876392 | 0.10% |
| | C | Ausschüttung | LU0982876475 | 0.10% |
| | C (q) | Ausschüttung | LU1236612575 | 0.10% |
| | I | Thesaurierung | LU0982876558 | 0.05% |
| | R | Thesaurierung | LU1427871139 | 0.10% |
| | R2 | Thesaurierung | LU1427871303 | 0.10% |
| | R2 | Ausschüttung | LU1427871485 | 0.10% |
| | V | Thesaurierung | LU0982876632 | 0.05% |
| | V (q) | Ausschüttung | LU1207305092 | 0.05% |
| Candriam L. Multi-Asset Income & Growth | Z | Thesaurierung | LU0982876715 | 0.05% |
| | Z (q) | Ausschüttung | LU1207305175 | 0.05% |
| | C | Thesaurierung | LU1207305258 | 0.10% |
| | C | Ausschüttung | LU1236612658 | 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% |
| Candriam L. Multi-Asset Premia | Z | Thesaurierung | LU1207305845 | 0.05% |
| | Z (q) | Ausschüttung | LU1207305928 | 0.05% |
| | C | Thesaurierung | LU1797471627 | 0.35% |
| | I | Thesaurierung | LU1797471890 | 0.35% |
| | PI | Thesaurierung | LU1797472195 | 0.00% |
| | R | Thesaurierung | LU1797472278 | 0.35% |
| | S | Thesaurierung | LU1797472351 | 0.28% |
| Z | Thesaurierung | LU1797472435 | 0.28% | |



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 5 – Performancegebühren

Bis zum 01. Mai 2022 erhielt die Verwaltungsgesellschaft für den Teilfonds Candriam L Multi-Asset Premia, mit Ausnahme der Klasse S, eine erfolgsabhängige Vergütung, die einer High-Water-Mark und einer Hurdle-Rate unterlag und auf das Nettovermögen des Teilfonds erhoben wurde.

Diese Performancegebühr entsprach 20 % (10 % für die Klasse PI) der Outperformance des Teilfonds, wie unten definiert:

- High-Water-Mark: Dieser erste Referenzwert basierte auf dem höchsten Nettoinventarwert des Teilfonds, der zum Erwerb einer Performancegebühr für die Verwaltungsgesellschaft geführt hat. Wurde keine Performancegebühr erworben, wurde der ursprüngliche Wert des Teilfonds beibehalten.
- Hurdle Rate: Dieser zweite Referenzwert wurde bei jeder Bewertung des Teilfonds bestimmt, indem eine theoretische Anlage aller während des Zeitraums eingegangenen Zeichnungen oder Rücknahmen zum Eonia- oder FED-Funds-Satz für die Klasse I-H in USD angenommen wurde.

War dieser Satz negativ, wurde zur Bestimmung der Hurdle ein Satz von 0 % angewandt.

- Out-/Underperformance: Wenn bei der Bewertung des Teilfonds die im Umlauf befindlichen Aktien – definiert als das Nettobuchvermögen nach erfolgsabhängigen Rücknahmegebühren, aber ohne Rückstellung für erfolgsabhängige Gebühren, die den noch im Umlauf befindlichen Aktien entsprechen – mehr wert waren als die beiden Referenzwerte (High Water Mark und Hurdle Rate), wurde eine Outperformance festgestellt (im umgekehrten Fall eine Underperformance).

Die Rückstellung für die Performancegebühr der im Umlauf befindlichen Anteile wird vor der Berechnung des Nettoinventarwerts auf 20 % (10 % für die Klasse PI) des Betrags dieser neuen Outperformance durch Zuweisung oder Auflösung der Rückstellung angepasst. Die Rückstellung für die erfolgsabhängige Gebühr auf die im Umlauf befindlichen Anteile ist nur in Höhe des am Ende des Geschäftsjahres vorhandenen Betrags an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlen. Der Bezugszeitraum war das Geschäftsjahr.

Im Falle einer Rücknahme wurden die zuletzt berechnete Vermögensreferenz und die Summe aller am Vortag eingegangenen Zeichnungen im Voraus proportional zur Anzahl der zurückgenommenen Anteile reduziert. Ebenso wurde ein Teil der möglichen Rückstellung für die Leistungsvergütung auf ausstehende Gutschriften, die bei der letzten Bewertung in den Büchern verbucht wurden, im Verhältnis zur Anzahl der eingelösten Anteile endgültig einem bestimmten persönlichen Konto zugewiesen. Dieser Anteil an der erfolgsabhängigen Gebühr wurde vom Verwalter ab dem Zeitpunkt der Rücknahme einbehalten.

Seit dem 02. Mai 2022 erhält die Verwaltungsgesellschaft für einige Anteilsklassen von Candriam L Multi-Asset Income, Candriam L Multi-Asset Income & Growth und Candriam L Multi-Asset Premia, eine erfolgsabhängige Vergütung, 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 |
| V | Thesaurierung | EUR | 20.00% | 0 | 0 |
| V (q) | Ausschüttung | EUR | 20.00% | 0 | 0 |

In der Periode zum 30. Juni 2023 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 |
| I (q) | Ausschüttung | EUR | 20.00% | 0 | 0 |
| V | Thesaurierung | EUR | 20.00% | 0 | 0 |

In der Periode zum 30. Juni 2023 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% | 0 | 0.0002 |
| I | Thesaurierung | EUR | 20.00% | 28 | 0.0028 |
| PI | Thesaurierung | EUR | 20.00% | 42599 | 0.0039 |
| R | Thesaurierung | EUR | 20.00% | 3 | 0.0026 |
| Z | Thesaurierung | EUR | 20.00% | 181943 | 0.0053 |

Die in der Periode zum 30. Juni 2023 in Rechnung gestellte Performancegebühr belief sich auf EUR 224.573.



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 2023 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 2023 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 – Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Zum 30. Juni 2023 waren die folgenden umgekehrten Pensionsgeschäfte ausstehend:

Candriam L Multi-Asset Premia

| Währung | Nennwert | Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Gegenpartei | Forderung aus umgekehrten Pensionsgeschäften (in EUR) |
|--------------|-----------|------------------|--------------------------|--------------------------|---|
| EUR | 500,000 | 25/04/26 | FRANCE 3.50 10-26 25/04A | CACEIS Bank, Lux. Branch | 513,500 |
| EUR | 513,663 | 25/05/31 | FRANCE 1.50 15-31 25/05A | CACEIS Bank, Lux. Branch | 485,925 |
| EUR | 6,651,884 | 25/02/27 | FRANCE 0.00 21-27 25/02A | CACEIS Bank, Lux. Branch | 6,009,977 |
| EUR | 612,745 | 25/05/32 | FRANCE 0 22-32 25/05A | CACEIS Bank, Lux. Branch | 488,419 |
| Summe | | | | | 7,497,821 |



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 9 – Dividenden

Die SICAV hat in der Periode zum 30. Juni 2023 die folgenden Dividenden ausgeschüttet:

| Teilfonds | Anteilsklasse | Währung | Ausschüttung | Ex-Tag |
|--|---------------|---------|--------------|------------|
| Candriam L Balanced Asset Allocation | C | EUR | 2.06 | 28/04/2023 |
| Candriam L Balanced Asset Allocation | I | EUR | 19.32 | 28/04/2023 |
| Candriam L Balanced Asset Allocation | R2 | EUR | 1.93 | 28/04/2023 |
| Candriam L Conservative Asset Allocation | I | EUR | 11.28 | 28/04/2023 |
| Candriam L Conservative Asset Allocation | R2 | EUR | 1.08 | 28/04/2023 |
| Candriam L Dynamic Asset Allocation | C | EUR | 3.49 | 28/04/2023 |
| Candriam L Dynamic Asset Allocation | R2 | EUR | 3.04 | 28/04/2023 |
| Candriam L Multi-Asset Income | C | EUR | 1.50 | 28/04/2023 |
| Candriam L Multi-Asset Income | C (q) | EUR | 0.34 | 16/01/2023 |
| Candriam L Multi-Asset Income | C (q) | EUR | 0.34 | 17/04/2023 |
| Candriam L Multi-Asset Income | R2 | EUR | 1.56 | 28/04/2023 |
| Candriam L Multi-Asset Income | V (q) | EUR | 3.49 | 16/01/2023 |
| Candriam L Multi-Asset Income | V (q) | EUR | 3.53 | 17/04/2023 |
| Candriam L Multi-Asset Income | Z (q) | EUR | 3.62 | 16/01/2023 |
| Candriam L Multi-Asset Income | Z (q) | EUR | 3.66 | 17/04/2023 |
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth | C | EUR | 3.79 | 28/04/2023 |
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth | C (q) | EUR | 0.84 | 16/01/2023 |
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth | C (q) | EUR | 0.86 | 17/04/2023 |
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth | I (q) | EUR | 8.48 | 16/01/2023 |
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth | I (q) | EUR | 8.67 | 17/04/2023 |
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth | R2 | EUR | 4.16 | 28/04/2023 |
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth | Z (q) | EUR | 8.86 | 16/01/2023 |
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth | Z (q) | EUR | 9.07 | 17/04/2023 |

Anhangangabe 10 – 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 2023 enthaltene Teil der Guthaben bei Banken und Brokern stellt sich wie folgt dar:

| Teilfonds | Währung | Barmittel bei Brokern |
|---|---------|-----------------------|
| Candriam GF US High Yield Corporate Bonds | EUR | 1,174,166 |
| Candriam L Conservative Asset Allocation | EUR | 1,763,816 |
| Candriam L Dynamic Asset Allocation | EUR | 105,583 |
| Candriam L Multi-Asset Income | EUR | 2,556,569 |
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth | EUR | 1,807,632 |
| Candriam L Multi-Asset Premia | EUR | 1,377,375 |

Anhangangabe 11 – Sicherheiten

Im Zusammenhang mit den OTC-Derivaten wurden Barsicherheiten von Société Générale SA erhalten:

| Teilfonds | Währung | Verbuchte Barsicherheiten | Gehaltene Barsicherheiten |
|--|---------|---------------------------|---------------------------|
| Candriam L Multi-Asset Income | EUR | (320,000) | 240,000 |
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth | EUR | (300,000) | 0 |
| Candriam L Multi-Asset Premia | EUR | (3,870,000) | 0 |

Anhangangabe 12 – Änderungen der Portfoliozusammensetzung

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

Anhangangabe 13 – Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Es gibt keine Ereignisse nach dem Bilanzstichtag.



Zusätzliche ungeprüfte Angaben

Globale Risikoexposition

Risikomanagement – Berechnung des Gesamtrisikos

Wie im CSSF-Rundschreiben 11/512 vorgeschrieben, muss der Verwaltungsrat der Gesellschaft das Risikomanagementverfahren der Gesellschaft festlegen und dabei entweder den Commitment-Ansatz oder den VaR-Ansatz verwenden.

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft hat sich entschieden, zur Bestimmung des Gesamtrisikos den Commitment-Ansatz für alle Teilfonds heranzuziehen, ausgenommen für den Teilfonds Candriam Equities L Risk Arbitrage Opportunities.



Zusätzliche ungeprüfte Angaben

Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften zur Wiederverwendung und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012

a) Globale Daten

In Bezug auf umgekehrte Pensionsgeschäfte stellt sich der Gesamtmarktwert der ausgeliehenen Wertpapiere zum 30. Juni 2023 wie folgt dar:

- **Umgekehrte Pensionsgeschäfte**

| Teilfonds | Währung | Marktwert (in absoluten Werten) | % des gesamten Nettoinventarwerts |
|-------------------------------|---------|---------------------------------|-----------------------------------|
| Candriam L Multi-Asset Premia | EUR | 7,497,821 | 16.79 |

b) Konzentrationsdaten

- **Umgekehrte Pensionsgeschäfte**

Die 10 größten Gegenparteien für alle umgekehrten Pensionsgeschäfte waren zum 30. Juni 2023:

Candriam L Multi-Asset Premia

| Gegenpartei | Konzentrationsdaten von offenen Geschäften |
|--------------------------|--|
| Caceis Bank, Lux. Branch | 7,497,821 |

Die 10 größten Aussteller von Sicherheiten, die bei umgekehrten Pensionsgeschäften empfangen wurden, waren zum 30. Juni 2023:

Candriam L Multi-Asset Premia

| Gegenpartei | Gesamtbetrag an Sicherheiten |
|--------------------------|------------------------------|
| Caceis Bank, Lux. Branch | 7,384,532 |

Es gibt keine Wiederverwendung von Sicherheiten im Zusammenhang mit Total Return Swaps.

c) Verwahrung der erhaltenen Sicherheiten

- **Umgekehrte Pensionsgeschäfte**

CACEIS Bank, Luxembourg Branch ist die einzige Verwahrstelle für umgekehrte Pensionsgeschäfte.

Alle Transaktionen sind bilaterale Transaktionen.

Im Rahmen von umgekehrten Pensionsgeschäften erhaltene Sicherheiten können nicht verkauft, reinvestiert oder verpfändet werden.

d) Aggregierte Transaktionsdaten

Die Fälligkeit der Sicherheiten im Zusammenhang mit umgekehrten Pensionsgeschäften ist wie folgt

| Teilfonds | Währung | 1 Monat bis 3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Mehr als 1 Jahr | Offene Fälligkeit | Gesamtbetrag an Sicherheiten |
|-------------------------------|---------|----------------------|---------------------|-----------------|-------------------|------------------------------|
| Candriam L Multi-Asset Premia | EUR | 0 | 0 | 7,497,820 | 0 | 7,497,820 |



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

Einrichtungen gemäß Art. 92 Abs. 1 der Richtlinie 2009/65/EG in der Fassung der Richtlinie (EU) 2019/1160

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

- Bei dieser Einrichtung können Anträge auf die Zeichnung, die Rücknahme und den Umtausch von Anteilen eingereicht werden.
- Sämtliche für einen Anteilinhaber bestimmte Zahlungen, einschließlich der Rücknahmeerlöse und etwaiger Ausschüttungen, können auf seinen Wunsch hin über diese Einrichtung geleitet werden.
- 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.
- 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 Federfonds.