



Unselbständiger Investmentfonds (FCP) nach  
französischem Recht

HALBJAHRESBERICHT

# **CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES**

zum 30. Juni 2023

Verwaltungsgesellschaft: CANDRIAM

Depotbank: CACEIS Bank

Abschlussprüfer: PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDIT

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG IN EUR

Elemente der Vermögensaufstellung	Betrag des Zwischenabschlusses *
a) Zulässige Wertpapiere im Sinne von Artikel L.214-20 Abschnitt I Punkt 1 des französischen Code Monétaire et Financier	108 579 828,86
b) Bankguthaben	31 237 845,70
c) Sonstige vom OGA gehaltene Vermögenswerte	251 927 679,34
d) Vermögenswerte im Bestand des OGA insgesamt (Zeilen a+b+c)	391 745 353,90
e) Passiva	-51 350 880,37
f) Nettoinventarwert (Zeilen d+e = Nettovermögen des OGA)	340 394 473,53

\* Die Beträge weisen Vorzeichen auf

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

Anteil	Art des Anteils	Nettovermögen je Anteil	Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil CLASSIQUE in EUR	C	11 573 570,53	840,82477	13 764,54
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil I in EUR	C	152 017 868,89	10 436,28984	14 566,27
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil I USD in USD	C	20 517 413,46	9 615,74687	2 133,73
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil N in EUR	C	879 706,94	4 893,16645	179,78
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil R in EUR	C	45 056 218,43	246 697,72223	182,63
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil U in EUR	C	10 954 671,02	52 232,81216	209,72
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil Z in EUR	C	101 106 375,89	66 286,30552	1 525,29

## ELEMENTE DES WERTPAPIERBESTANDS

Elemente des Wertpapierbestands	Prozentsatz Nettovermögen *	Prozentsatz Vermögenswerte insgesamt **
A) Zulässige Wertpapiere und die Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden, im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Code Monétaire et financier.  Und B) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem sonstigen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist und in einem Mitgliedsstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Unterzeichnerstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum liegt, gehandelt werden.	31,90	27,72
C) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer geregelten Wertpapierbörse eines Drittlandes amtlich notiert sind oder an einem sonstigen Markt eines Drittlandes gehandelt werden, die/der für das Publikum offen, anerkannt ist und ordnungsgemäß funktioniert, sofern diese Börse bzw. dieser Markt nicht auf einer von der Autorité des Marchés Financiers erstellten Liste der ausgeschlossenen Länder steht bzw. sofern die Wahl dieser Börse bzw. dieses Marktes in den gesetzlichen Vorschriften und/oder den Vertragsbedingungen oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist.	0,00	0,00
D) Zulässige Wertpapiere aus Neuemissionen im Sinne von Artikel R.214-11 Abschnitt I Punkt 4 des französischen Code Monétaire et Financier.	0,00	0,00
E) Sonstige Vermögenswerte.	9,55	8,29

\* Siehe f) in der Vermögensaufstellung

\*\* Siehe d) in der Vermögensaufstellung

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

<b>Wertpapiere</b>	<b>Währung</b>	<b>Als Betrag (EUR)</b>	<b>Prozentsatz Nettovermögen *</b>	<b>Prozentsatz Vermögenswerte insgesamt **</b>
Euro	EUR	108 579 828,86	31,90	27,72
INSGESAMT		108 579 828,86	31,90	27,72

\* *Siehe f) in der Vermögensaufstellung*

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

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

<b>Land</b>	<b>Prozentsatz Nettovermögen *</b>	<b>Prozentsatz Vermögenswerte insgesamt **</b>
FRANKREICH	9,79	8,50
SPANIEN	9,12	7,92
LUXEMBURG	9,11	7,92
ITALIEN	3,88	3,37
INSGESAMT	31,90	27,72

\* *Siehe f) in der Vermögensaufstellung*

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

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

Art der Vermögenswerte	Prozentsatz Nettovermögen *	Prozentsatz Vermögenswerte insgesamt **
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>		
OGAW und AIF mit allgemeiner Zielsetzung, die sich an nicht institutionelle Anleger richten, und vergleichbare Fonds aus sonstigen Ländern	9,55	8,29
Sonstige Fonds, die sich an nicht institutionelle Anleger richten, und vergleichbare Fonds aus sonstigen Mitgliedstaaten der EU	0,00	0,00
Institutionelle Fonds mit allgemeiner Zielsetzung und vergleichbare Fonds aus sonstigen Mitgliedstaaten der EU und börsennotierte Organismen für Verbriefungen	0,00	0,00
Sonstige institutionelle Investmentfonds und vergleichbare Fonds aus sonstigen Mitgliedstaaten der EU und nicht börsennotierte Organismen für Verbriefungen	0,00	0,00
Sonstige nicht-europäische Organismen	0,00	0,00
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>		
Sonstiges	0,00	0,00
<b>INSGESAMT</b>	<b>9,55</b>	<b>8,29</b>

\* Siehe f) in der Vermögensaufstellung

\*\* Siehe d) in der Vermögensaufstellung

## VERÄNDERUNGEN DES WERTPAPIERBESTANDS IM LAUFE DES ZEITRAUMS IN EUR

Elemente des Wertpapierbestands	Veränderungen (als Betrag)	
	Käufe	Verkäufe
<p>A) Zulässige Wertpapiere und die Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden, im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Code Monétaire et financier.</p> <p>Und B) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem sonstigen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist und in einem Mitgliedsstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Unterzeichnerstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum liegt, gehandelt werden.</p>	129 271 061,57	21 000 000,00
<p>C) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer geregelten Wertpapierbörse eines Drittlandes amtlich notiert sind oder an einem sonstigen Markt eines Drittlandes gehandelt werden, die/der für das Publikum offen, anerkannt ist und ordnungsgemäß funktioniert, sofern diese Börse bzw. dieser Markt nicht auf einer von der Autorité des Marchés Financiers erstellten Liste der ausgeschlossenen Länder steht bzw. sofern die Wahl dieser Börse bzw. dieses Marktes in den gesetzlichen Vorschriften und/oder den Vertragsbedingungen oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist.</p>	0,00	0,00
<p>D) Zulässige Wertpapiere aus Neuemissionen im Sinne von Artikel R.214-11 Abschnitt I Punkt 4 des französischen Code Monétaire et Financier.</p>	0,00	0,00
<p>E) Sonstige Vermögenswerte.</p>	17 996 152,60	15 977 062,60

## INFORMATION ÜBER VARIABLE VERWALTUNGSGEBÜHREN

	30/06/2023
<b>Anteile CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil CLASSIQUE</b>	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	80 503,57
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,69
Vereinnahme variable Verwaltungsgebühren	2 761,63
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,02
<b>Anteile CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil I</b>	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	1 017 931,07
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,61
Vereinnahme variable Verwaltungsgebühren	96 454,52
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,06
<b>Anteile CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil I USD</b>	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	178 581,56
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	1,75
Vereinnahme variable Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
<b>Anteile CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil N</b>	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	6 235,56
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,79
Vereinnahme variable Verwaltungsgebühren	4,59
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00
<b>Anteile CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil R</b>	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	313 277,92
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,73
Vereinnahme variable Verwaltungsgebühren	2 779,09
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,01
<b>Anteile CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil U</b>	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	81 284,69
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,75
Vereinnahme variable Verwaltungsgebühren	1 591,32
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,01
<b>Anteile CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil Z</b>	
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	860 316,79
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,92
Vereinnahme variable Verwaltungsgebühren	20 677,83
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,02

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

**TRANSPARENZ VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN UND DER WEITERVERWENDUNG VON FINANZINSTRUMENTEN – SFTR – IN DER RECHNUNGSWÄHRUNG DES OGA (EUR)**

**a) Entlehene Titel und Rohstoffe**

	Wertpapier- verleihe	Wertpapier- entleihe	In Pension gegebene Wertpapiere	In Pension genommene Wertpapiere	TRS
Betrag					
% des Nettovermögens*					

\*% ohne Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente

**b) Gebundenes Vermögen für jede Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und TRS, in absoluten Zahlen**

	Wertpapier- verleihe	Wertpapier- entleihe	In Pension gegebene Wertpapiere	In Pension genommene Wertpapiere	TRS
Betrag				144 431 372,41	
% des Nettovermögens				42,43%	

**c) Die 10 wichtigsten Emittenten von erhaltenen Sicherheiten (ohne Barmittel) für jede Art von Finanzierungsgeschäften**

	Wertpapier- verleihe	Wertpapier- entleihe	In Pension gegebene Wertpapiere	In Pension genommene Wertpapiere	TRS
EUROPÄISCHE UNION EUROPÄISCHE UNION				50 104 862,42	
FRANZÖSISCHE REGIERUNG FRANKREICH				41 649 280,94	
EUROPÄISCHE INVESTITIONSBANK EUROPÄISCHE UNION				31 912 536,40	
NIEDERLÄNDISCHE REGIERUNG NIEDERLANDE				20 385 750,00	

**d) Die 10 wichtigsten Gegenparteien, in absoluten Zahlen, Aktiva und Passiva ohne Aufrechnung**

	Wertpapier- verleihe	Wertpapier- entleihe	In Pension gegebene Wertpapiere	In Pension genommene Wertpapiere	TRS
CACEIS BANK FRANCE FRANCE				55 425 750,00	
NATIXIS				40 999 822,10	
BNP PARIBAS SECURITIES SERVICE				35 005 800,93	
SOCIETE GENERALE				12 999 999,38	

e) Art und Qualität der Sicherheiten (Sicherheitshinterlegung)

	Wertpapier- verleihe	Wertpapier- entleihe	In Pension gegebene Wertpapiere	In Pension genommene Wertpapiere	TRS
<b>Art</b>					
- Aktien					
- Anleihen				144 052 429,76	
- OGA					
- TCN					
- Barmittel					
<b>Rating</b>				AAA bis AA	
<b>Währung der Sicherheit</b>					
- Euro				144 052 429,76	

f) Abwicklung und Clearing von Kontrakten

	Wertpapier- verleihe	Wertpapier- entleihe	In Pension gegebene Wertpapiere	In Pension genommene Wertpapiere	TRS
Dreiseitig				X	
Zentrale Gegenpartei					
Bilateral	X			X	

g) Laufzeit der Sicherheit, aufgeschlüsselt nach Tranchen

	Wertpapier- verleihe	Wertpapier- entleihe	In Pension gegebene Wertpapiere	In Pension genommene Wertpapiere	TRS
Innerhalb 1 Tages					
1 Tag bis 1 Woche					
1 Woche bis 1 Monat					
1 Monat bis 3 Monate					
3 Monate bis 1 Jahr				36 459 552,52	
Mehr als 1 Jahr				107 592 877,24	
Offen					

h) Laufzeit der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und TRS, aufgeschlüsselt nach Tranchen

	Wertpapier- verleihe	Wertpapier- entleihe	In Pension gegebene Wertpapiere	In Pension genommene Wertpapiere	TRS
Innerhalb 1 Tages					
1 Tag bis 1 Woche				4 999 800,00	
1 Woche bis 1 Monat				113 442 572,41	
1 Monat bis 3 Monate				25 989 000,00	
3 Monate bis 1 Jahr					
Mehr als 1 Jahr					
Offen					

**i) Angaben zur Weiterverwendung von Sicherheiten**

	Wertpapier- verleihe	Wertpapier- entleihe	In Pension gegebene Wertpapiere	In Pension genommene Wertpapiere	TRS
Höchstbetrag (%)					
Eingesetzter Betrag (%)					
Erträge für den OGA infolge einer Wiederanlage von Barsicherheiten in Euro					

**j) Angaben zur Verwahrung von vom OGA erhaltenen Sicherheiten**

	Wertpapier- verleihe	Wertpapier- entleihe	In Pension gegebene Wertpapiere	In Pension genommene Wertpapiere	TRS
CACEIS Bank					
Wertpapiere				144 052 429,76	
Barmittel					

**k) Angaben zur Verwahrung von vom OGA bereitgestellten Sicherheiten**

	Wertpapier- verleihe	Wertpapier- entleihe	In Pension gegebene Wertpapiere	In Pension genommene Wertpapiere	TRS
Wertpapiere					
Barmittel					

**l) Aufgeschlüsselte Angaben zu Erträgen und Kosten**

	Wertpapier- verleihe	Wertpapier- entleihe	In Pension gegebene Wertpapiere	In Pension genommene Wertpapiere	TRS
<b>Erträge</b>					
- OGA				-21 268,10	
- Fondsmanager					
- Dritte					
<b>Kosten</b>					
- OGA					
- Fondsmanager					
- Dritte					

**e) Angaben zu Art und Qualität der Sicherheiten (Sicherheitshinterlegung)**

k. A. – Ausschließlich Barsicherheit.

**i) Angaben zur Weiterverwendung von Sicherheiten**

Die erhaltenen Barsicherheiten können vom OGA in echte Pensionsgeschäfte zum Kauf von Wertpapieren oder in für sein Vermögen in Frage kommenden Titel wieder angelegt werden, insbesondere in Beteiligungspapiere, Zinspapiere, Schuldpapiere oder Anteile von OGA. Die in Form von Wertpapieren erhaltenen Sicherheiten können verwahrt, verkauft oder als Sicherheit eingesetzt werden. Der Höchstbetrag zur Weiterverwendung beläuft sich auf 100 % der erhaltenen Barmittel und Wertpapiere.

**k) Angaben zur Verwahrung von vom OGA bereitgestellten Sicherheiten**

k. A. – Ausschließlich Barsicherheit.

**l) Aufgeschlüsselte Angaben zu Erträgen und Kosten**

k. A. – keine Wertpapierleih- und Pensionsgeschäfte.

**WERTPAPIERBESTAND ZUM 30.06.2023 IN EUR**

Bezeichnung der Wertpapiere	Währung	Stückzahl/ Nennwert	Zeitwert	% Netto- vermögen
<b>Anleihen und ähnliche Wertpapiere</b>				
<b>An einem geregelten Markt gehandelte Anleihen und ähnliche Wertpapiere</b>				
<b>SPANIEN</b>				
SPAIN GOVERNMENT BOND 0.35% 30-07-23	EUR	31 000 000	31 029 006,23	9,12
<b>SUMME SPANIEN</b>			<b>31 029 006,23</b>	<b>9,12</b>
<b>ITALIEN</b>				
ITAL C E6R+0.7% 15-07-23	EUR	13 000 000	13 215 251,11	3,88
<b>SUMME ITALIEN</b>			<b>13 215 251,11</b>	<b>3,88</b>
<b>SUMME An einem geregelten Markt gehandelte Anleihen und ähnliche Wertpapiere</b>			<b>44 244 257,34</b>	<b>13,00</b>
<b>SUMME Anleihen und ähnliche Wertpapiere</b>			<b>44 244 257,34</b>	<b>13,00</b>
<b>Schuldtitel</b>				
<b>An einem geregelten Markt gehandelte Schuldtitel und ähnliche Wertpapiere</b>				
<b>FRANKREICH</b>				
0473820FRENCH R ZCP 230823	EUR	9 000 000	8 956 223,97	2,63
FRANCE TREASURY BILL ZCP 130923	EUR	13 000 000	12 910 407,51	3,79
FRANCE TREASURY BILL ZCP 300823	EUR	5 500 000	5 469 643,48	1,61
FREN REP PRES ZCP 09-08-23	EUR	6 000 000	5 978 684,50	1,76
<b>SUMME FRANKREICH</b>			<b>33 314 959,46</b>	<b>9,79</b>
<b>LUXEMBURG</b>				
EUB ZCP 040823	EUR	31 117 000	31 020 612,06	9,11
<b>SUMME LUXEMBURG</b>			<b>31 020 612,06</b>	<b>9,11</b>
<b>SUMME An einem geregelten Markt gehandelte Schuldtitel und ähnliche Wertpapiere</b>			<b>64 335 571,52</b>	<b>18,90</b>
<b>SUMME Schuldtitel</b>			<b>64 335 571,52</b>	<b>18,90</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>OGAW und AIF mit allgemeiner Zielsetzung, die sich an nicht institutionelle Anleger richten, und vergleichbare Fonds aus sonstigen Ländern</b>				
<b>FRANKREICH</b>				
CANDRIAM MONETAIRE-V ACC EUR	EUR	264	26 569 781,04	7,80
<b>SUMME FRANKREICH</b>			<b>26 569 781,04</b>	<b>7,80</b>
<b>LUXEMBURG</b>				
Candriam L Multi-Asset Premia - C Anteile Z	EUR	3 543	5 924 285,73	1,74
<b>SUMME LUXEMBURG</b>			<b>5 924 285,73</b>	<b>1,74</b>
<b>SUMME OGAW und AIF mit allgemeiner Zielsetzung, die sich an nicht institutionelle Anleger richten, und vergleichbare Fonds aus sonstigen Ländern</b>			<b>32 494 066,77</b>	<b>9,54</b>
<b>SUMME Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			<b>32 494 066,77</b>	<b>9,54</b>
<b>In Pension genommene Wertpapiere</b>				
<b>BELGIEN</b>				
EUROPEAN UNION 0.75% 04-01-47	EUR	27 400 000	16 000 010,80	4,70
EUROPEAN UNION 2.75% 04-12-37	EUR	13 400 000	12 864 000,00	3,78
EUROPEAN UNION 3.375% 04/04/2038	EUR	19 700 000	20 000 011,30	5,88
<b>SUMME BELGIEN</b>			<b>48 864 022,10</b>	<b>14,36</b>
<b>FRANKREICH</b>				
FRANCE 3.25% 25/05/2045	EUR	9 800 000	10 078 481,11	2,96
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.0% 25-11-29	EUR	6 000 000	4 999 800,00	1,47
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.0% 25-02-27	EUR	10 500 000	9 486 750,00	2,79
OAT 4.25% 25/10/23	EUR	4 408 405	4 500 099,82	1,32
REPUBLIQUE FRANCAISE 2.5% 25/05/2030	EUR	12 982 862	12 999 999,38	3,82

**WERTPAPIERBESTAND ZUM 30.06.2023 IN EUR (Fortsetzung)**

Bezeichnung der Wertpapiere	Wahrung	Stuckzahl/ Nennwert	Zeitwert	% Netto- vermogen
<b>SUMME FRANKREICH</b>			<b>42 065 130,31</b>	<b>12,36</b>
<b>LUXEMBURG</b>				
BEI 4.125%07-150424 MTN	EUR	31 500 000	33 075 000,00	9,71
<b>SUMME LUXEMBURG</b>			<b>33 075 000,00</b>	<b>9,71</b>
<b>NIEDERLANDE</b>				
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.0% 15-01-26	EUR	22 000 000	20 427 220,00	6,00
<b>SUMME NIEDERLANDE</b>			<b>20 427 220,00</b>	<b>6,00</b>
<b>SUMME In Pension genommene Wertpapiere</b>			<b>144 431 372,41</b>	<b>42,43</b>
<b>Forderungen aus in Pension genommenen Wertpapieren</b>			<b>833 169,65</b>	<b>0,25</b>
<b>Finanzterminkontrakte</b>				
<b>Feste Termingeschafte</b>				
<b>Feste Termingeschafte auf einem geregelten oder gleichwertigen Markt</b>				
BP GBPUSD 0923	USD	-323	21 104,49	0,00
CAC 40 FUT 0723	EUR	275	319 290,00	0,09
CBOE VIX FUT 0723	USD	-765	1 170 270,39	0,35
CD CADUSD 0923	USD	151	-23 560,95	-0,01
CME AUD/USD 0923	USD	-217	13 643,45	0,00
CME BRL/USD 0823	USD	1 449	-162 626,03	-0,05
CME CHF/USD 0923	USD	-122	-11 325,62	0,00
CME INRUSD 0723	USD	190	-12 965,17	-0,01
CME JPY/USD 0923	USD	-193	406 164,07	0,12
CMFR ZARUSD 0923	USD	-624	194 099,45	0,06
DAX 30 IND FU 0923	EUR	49	66 400,00	0,02
EC EURUSD 0923	USD	110	-39 012,37	-0,01
E-MIN RUS 200 0923	USD	-32	-76 306,14	-0,02
EURO BTP 0923	EUR	61	-60 700,00	-0,02
EURO BUND 0923	EUR	-336	-104 930,00	-0,03
EURO STOXX 50 0923	EUR	656	578 610,00	0,17
FTSE 100 FUT 0923	GBP	236	105 109,83	0,03
FV CBOT UST 5 0923	USD	-415	457 743,76	0,14
HANG SENG FUT 0723	HKD	-51	70 458,61	0,02
ICE 3M SONIA 0924	GBP	-1 099	3 959 578,74	1,16
I EURIBOR 3 0924	EUR	-2 061	1 831 925,00	0,54
JAP GOVT 10 0923	JPY	144	107 554,36	0,03
KOREA 3YR 0923	KRW	-1 840	306 360,21	0,09
NE NZDUSD 0923	USD	-380	-9 692,94	0,00
NIKKEI 225 0923	JPY	153	258 774,15	0,08
NQ USA NASDAQ 0923	USD	-3	-14 738,77	0,00
OSE TOPIX FUT 0923	JPY	131	326 404,66	0,09
PE MXNUSD 0923	USD	1 792	291 420,71	0,08
RY EURJPY 0923	JPY	439	2 180 603,66	0,64
SOFRRATE 3M 0924	USD	-1 285	2 003 643,45	0,59
SP 500 MINI 0923	USD	35	116 074,70	0,04
SPI 200 FUT 0923	AUD	152	103 116,74	0,03

**WERTPAPIERBESTAND ZUM 30.06.2023 IN EUR (Fortsetzung)**

Bezeichnung der Wertpapiere	Währung	Stückzahl/ Nennwert	Zeitwert	% Netto- vermögen
US 10YR NOTE 0923	USD	-621	640 882,80	0,19
US TBOND 30 0923	USD	-214	33 484,19	0,01
XEUR FOAT EUR 0923	EUR	-254	-65 560,00	-0,02
YM DOW JONES 0923	USD	90	74 802,93	0,02
<b>SUMME Feste Termingeschäfte auf einem geregelten oder gleichwertigen Markt</b>			<b>15 056 102,36</b>	<b>4,42</b>
<b>SUMME Feste Termingeschäfte</b>			<b>15 056 102,36</b>	<b>4,42</b>
<b>SUMME Finanzterminkontrakte</b>			<b>15 056 102,36</b>	<b>4,42</b>
<b>Margenausgleich</b>				
MARGENAUSGLEICH CACEIS	HKD	-602 400	-70 458,61	-0,02
MARGENAUSGLEICH CACEIS	AUD	-169 008,33	-103 116,74	-0,03
MARGENAUSGLEICH CACEIS	KRW	-440 410 000	-306 360,21	-0,09
MARGENAUSGLEICH CACEIS	USD	-5 534 761,17	-5 073 108,31	-1,49
MARGENAUSGLEICH CACEIS	JPY	-453 089 875	-2 873 336,82	-0,85
MARGENAUSGLEICH CACEIS	EUR	-2 565 035	-2 565 035,00	-0,75
MARGENAUSGLEICH CACEIS	GBP	-3 488 112,47	-4 064 688,54	-1,19
<b>SUMME Margenausgleich</b>			<b>-15 056 104,23</b>	<b>-4,42</b>
<b>Forderungen</b>			<b>58 531 550,16</b>	<b>17,19</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>			<b>-29 642 842,43</b>	<b>-8,70</b>
<b>Finanzkonten</b>			<b>25 167 329,98</b>	<b>7,39</b>
<b>Nettovermögen</b>			<b>340 394 473,53</b>	<b>100,00</b>

Anteile CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil CLASSIQUE	EUR	840,82477	13 764,54
Anteile CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil I	EUR	10 436,28984	14 566,27
Anteile CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil I USD	USD	9 615,74687	2 133,73
Anteile CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil N	EUR	4 893,16645	179,78
Anteile CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil R	EUR	246 697,72223	182,63
Anteile CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil U	EUR	52 232,81216	209,72
Anteile CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Anteil Z	EUR	66 286,30552	1 525,29

## Informationen für Anleger in der Bundesrepublik Deutschland

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](http://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](http://www.candriam.com) veröffentlicht und an die Anteilinhaber an ihre im Anteilinhaberregister eingetragene Anschrift übersandt. In den folgenden Fällen wird eine Mitteilung per dauerhaftem Datenträger veröffentlicht: Die Aussetzung der Rücknahme der Anteile des Fonds; die Kündigung der Verwaltung des Fonds oder dessen Abwicklung; bei Änderungen von Anlagebedingungen, die mit den bisherigen Anlagegrundsätzen nicht vereinbar sind oder bei anlegerbenachteiligenden Änderungen von wesentlichen Anlegerrechten oder bei anlegerbenachteiligenden Änderungen, die die Vergütungen und Aufwendungserstattungen betreffen, die aus dem Investmentvermögen entnommen werden können (einschließlich der Hintergründe der Änderungen sowie der Rechte der Anleger); die Verschmelzung des Fonds oder eines Teilfonds sowie die Umwandlung des Fonds oder eines Teilfonds in einen Feederfonds.

## **Hinweise für Anleger in Österreich**

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

Kontakt- und Informationsstelle in Österreich gemäß den Bestimmungen nach EU-Richtlinie 2019/1160 Art. 92:

Erste Bank der oesterreichischen Sparkassen AG

Am Belvedere 1,

A-1100 Wien

E-Mail: [foreignfunds0540@erstebank.at](mailto:foreignfunds0540@erstebank.at)