



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 Portfolibewegungen 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
<b>Aktiva</b>				
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
<b>Aktiva insgesamt</b>		<b>142,777,624</b>	<b>198,491,262</b>	<b>12,657,647</b>
<b>Passiva</b>				
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
<b>Passiva insgesamt</b>		<b>299,351</b>	<b>533,692</b>	<b>25,266</b>
<b>Nettovermögen insgesamt</b>		<b>142,478,273</b>	<b>197,957,570</b>	<b>12,632,381</b>



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
<b>Aktiva</b>				
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
<b>Aktiva insgesamt</b>		<b>341,420,268</b>	<b>128,574,344</b>	<b>48,776,933</b>
<b>Passiva</b>				
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
<b>Passiva insgesamt</b>		<b>1,509,039</b>	<b>892,227</b>	<b>2,589,320</b>
<b>Nettovermögen insgesamt</b>		<b>339,911,229</b>	<b>127,682,117</b>	<b>46,187,613</b>



## Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2023

		<b>Kombiniert</b>
		<b>EUR</b>
<b>Aktiva</b>		
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
<b>Aktiva insgesamt</b>		<b>872,698,078</b>
<b>Passiva</b>		
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
<b>Passiva insgesamt</b>		<b>5,848,895</b>
<b>Nettovermögen insgesamt</b>		<b>866,849,183</b>





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
<b>Nettovermögen zu Beginn der Periode</b>		<b>154,798,931</b>	<b>196,285,898</b>	<b>11,843,730</b>
<b>Erträge</b>				
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
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>107,885</b>	<b>137,443</b>	<b>9,791</b>
<b>Aufwendungen</b>				
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
<b>Aufwendungen insgesamt</b>		<b>363,929</b>	<b>450,917</b>	<b>48,202</b>
<b>Nettoertrag/(-verlust) aus Wertpapieren</b>		<b>(256,044)</b>	<b>(313,474)</b>	<b>(38,411)</b>
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
<b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>		<b>(490,025)</b>	<b>(777,350)</b>	<b>20,300</b>
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
<b>Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>6,871,415</b>	<b>6,490,965</b>	<b>743,740</b>
<b>Entwicklung des Kapitals</b>				
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)
<b>Nettovermögen zum Ende der Periode</b>		<b>142,478,273</b>	<b>197,957,570</b>	<b>12,632,381</b>

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
<b>Nettovermögen zu Beginn der Periode</b>		<b>353,788,946</b>	<b>126,237,933</b>	<b>44,661,101</b>
<b>Erträge</b>				
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
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>3,819,295</b>	<b>1,406,447</b>	<b>1,014,761</b>
<b>Aufwendungen</b>				
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
<b>Aufwendungen insgesamt</b>		<b>522,604</b>	<b>368,708</b>	<b>1,527,064</b>
<b>Nettoertrag/(-verlust) aus Wertpapieren</b>		<b>3,296,691</b>	<b>1,037,739</b>	<b>(512,303)</b>
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)
<b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>		<b>135,481</b>	<b>(91,240)</b>	<b>457,868</b>
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
<b>Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>9,308,341</b>	<b>4,761,534</b>	<b>1,608,298</b>
<b>Entwicklung des Kapitals</b>				
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
<b>Nettovermögen zum Ende der Periode</b>		<b>339,911,229</b>	<b>127,682,117</b>	<b>46,187,613</b>

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.



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

		<b>Kombiniert</b>
		<b>EUR</b>
<b>Nettovermögen zu Beginn der Periode</b>		<b>887,616,539</b>
<b>Erträge</b>		
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
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>6,495,622</b>
<b>Aufwendungen</b>		
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
<b>Aufwendungen insgesamt</b>		<b>3,281,424</b>
<b>Nettoertrag/(-verlust) aus Wertpapieren</b>		<b>3,214,198</b>
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)
<b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>		<b>(744,966)</b>
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
<b>Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>29,784,293</b>
<b>Entwicklung des Kapitals</b>		
Zeichnung von Anteilen		35,134,429
Rücknahme von Anteilen		(83,325,019)
Ausgeschüttete Dividenden	9	(2,361,059)
<b>Nettovermögen zum Ende der Periode</b>		<b>866,849,183</b>



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
<b>Nettovermögen insgesamt</b>			<b>EUR</b>		<b>142,478,273</b>	<b>154,798,931</b>	<b>172,461,647</b>
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
<b>Nettovermögen insgesamt</b>			<b>EUR</b>		<b>197,957,570</b>	<b>196,285,898</b>	<b>225,152,204</b>
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
<b>Nettovermögen insgesamt</b>			<b>EUR</b>		<b>12,632,381</b>	<b>11,843,730</b>	<b>14,353,777</b>
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
<b>Nettovermögen insgesamt</b>			<b>EUR</b>		<b>339,911,229</b>	<b>353,788,946</b>	<b>480,780,013</b>
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	Wahrung	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
<b>Nettovermogen insgesamt</b>			<b>EUR</b>		<b>127,682,117</b>	<b>126,237,933</b>	<b>165,078,099</b>
C	LU1207305258	Thesaurierung	EUR	198,190.15	166.92	161.54	182.50
C	LU1236612658	Ausschuttung	EUR	1,000.69	131.48	130.97	151.92
C (q)	LU1207305332	Ausschuttung	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	Ausschuttung	EUR	1.00	1,410.69	1,375.05	1,581.58
R	LU1427871725	Thesaurierung	EUR	10.00	151.21	-	-
R2	LU1427872293	Ausschuttung	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	Ausschuttung	EUR	26,507.00	1,478.46	1,438.78	1,645.71

**Candriam L Multi-Asset Premia**

Name	ISIN	Anteilsart	Wahrung	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
<b>Nettovermogen insgesamt</b>			<b>EUR</b>		<b>46,187,613</b>	<b>44,661,101</b>	<b>53,330,908</b>
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
<b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden</b>				
<b>Strukturierte Produkte</b>				
<b>Irland</b>				
ISHARES PHYSICAL GOLD ETC	120,346	USD	4,117,245	2.89
			<b>4,117,245</b>	<b>2.89</b>
<b>Strukturierte Produkte, insgesamt</b>			<b>4,117,245</b>	<b>2.89</b>
<b>Aktien</b>				
<b>Frankreich</b>				
DANONE SA	4,909	EUR	275,591	0.19
			<b>275,591</b>	<b>0.19</b>
<b>Irland</b>				
KERRY GROUP -A-	2,992	EUR	267,425	0.19
			<b>267,425</b>	<b>0.19</b>
<b>Schweiz</b>				
BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	143	CHF	253,021	0.18
NESTLE SA REG SHS	4,898	CHF	539,957	0.38
			<b>792,978</b>	<b>0.56</b>
<b>Aktien gesamt</b>			<b>1,335,994</b>	<b>0.94</b>
<b>Variabel verzinsliche Anleihen</b>				
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>				
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
			<b>2,854,943</b>	<b>2.00</b>
<b>Variabel verzinsliche Anleihen gesamt</b>			<b>2,854,943</b>	<b>2.00</b>
<b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt</b>			<b>8,308,182</b>	<b>5.83</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Anteile/Einheiten an Anlagefonds</b>				
<b>Frankreich</b>				
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z C	1,509	EUR	2,302,288	1.62
			<b>2,302,288</b>	<b>1.62</b>
<b>Irland</b>				
MW GAVEKAL CHINA FI -A- CAP	8,033	USD	1,022,127	0.72
			<b>1,022,127</b>	<b>0.72</b>
<b>Luxemburg</b>				
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.

Etwasige 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
			<b>129,396,794</b>	<b>90.82</b>
<b>Aktien/Anteile in Anlagementfonds gesamt</b>			<b>132,721,209</b>	<b>93.15</b>
<b>Organismen fur gemeinsame Anlagen gesamt</b>			<b>132,721,209</b>	<b>93.15</b>
<b>Anlageportfolio gesamt</b>			<b>141,029,391</b>	<b>98.98</b>
Erwerbskosten			138,516,279	

Die Erlauerungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.  
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.



---

## Candriam L Balanced Asset Allocation

### 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
	<b>98.98</b>

**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
	<b>98.98</b>





## Candriam L Conservative Asset Allocation

## Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
<b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden</b>				
<b>Strukturierte Produkte</b>				
<b>Irland</b>				
ISHARES PHYSICAL GOLD ETC	169,426	USD	5,796,357	2.93
			<b>5,796,357</b>	<b>2.93</b>
<b>Strukturierte Produkte, insgesamt</b>			<b>5,796,357</b>	<b>2.93</b>
<b>Aktien</b>				
<b>Frankreich</b>				
DANONE SA	6,837	EUR	383,829	0.19
			<b>383,829</b>	<b>0.19</b>
<b>Irland</b>				
KERRY GROUP -A-	4,167	EUR	372,446	0.19
			<b>372,446</b>	<b>0.19</b>
<b>Schweiz</b>				
BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	200	CHF	353,875	0.18
NESTLE SA REG SHS	6,821	CHF	751,949	0.38
			<b>1,105,824</b>	<b>0.56</b>
<b>Aktien gesamt</b>			<b>1,862,099</b>	<b>0.94</b>
<b>Variabel verzinsliche Anleihen</b>				
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>				
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
			<b>3,949,794</b>	<b>2.00</b>
<b>Variabel verzinsliche Anleihen gesamt</b>			<b>3,949,794</b>	<b>2.00</b>
<b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt</b>			<b>11,608,250</b>	<b>5.86</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Anteile/Einheiten an Anlagefonds</b>				
<b>Frankreich</b>				
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z C	2,772	EUR	4,228,104	2.14
			<b>4,228,104</b>	<b>2.14</b>
<b>Irland</b>				
MW GAVEKAL CHINA FI -A- CAP	15,040	USD	1,913,706	0.97
			<b>1,913,706</b>	<b>0.97</b>
<b>Luxemburg</b>				
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.

Etwlige 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
			<b>178,033,928</b>	<b>89.94</b>
<b>Aktien/Anteile in Anlagementfonds gesamt</b>			<b>184,175,738</b>	<b>93.04</b>
<b>Organismen fur gemeinsame Anlagen gesamt</b>			<b>184,175,738</b>	<b>93.04</b>
<b>Anlageportfolio gesamt</b>			<b>195,783,988</b>	<b>98.90</b>
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
	<b>98.90</b>

**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
	<b>98.90</b>



## Candriam L Dynamic Asset Allocation

## Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
<b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden</b>				
<b>Strukturierte Produkte</b>				
<b>Irland</b>				
ISHARES PHYSICAL GOLD ETC	10,616	USD	363,192	2.88
			<b>363,192</b>	<b>2.88</b>
<b>Strukturierte Produkte, insgesamt</b>			<b>363,192</b>	<b>2.88</b>
<b>Aktien</b>				
<b>Frankreich</b>				
DANONE SA	433	EUR	24,309	0.19
			<b>24,309</b>	<b>0.19</b>
<b>Irland</b>				
KERRY GROUP -A-	264	EUR	23,596	0.19
			<b>23,596</b>	<b>0.19</b>
<b>Schweiz</b>				
BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	13	CHF	23,002	0.18
NESTLE SA REG SHS	432	CHF	47,624	0.38
			<b>70,626</b>	<b>0.56</b>
<b>Aktien gesamt</b>			<b>118,531</b>	<b>0.94</b>
<b>Variabel verzinsliche Anleihen</b>				
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>				
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
			<b>253,482</b>	<b>2.01</b>
<b>Variabel verzinsliche Anleihen gesamt</b>			<b>253,482</b>	<b>2.01</b>
<b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt</b>			<b>735,205</b>	<b>5.82</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Anteile/Einheiten an Anlagefonds</b>				
<b>Frankreich</b>				
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z C	63	EUR	96,093	0.76
			<b>96,093</b>	<b>0.76</b>
<b>Irland</b>				
MW GAVEKAL CHINA FI -A- CAP	372	USD	47,334	0.37
			<b>47,334</b>	<b>0.37</b>
<b>Luxemburg</b>				
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 Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

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



## 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
			<b>11,371,490</b>	<b>90.02</b>
<b>Aktien/Anteile in Anlagementfonds gesamt</b>			<b>11,514,917</b>	<b>91.15</b>
<b>Organismen fur gemeinsame Anlagen gesamt</b>			<b>11,514,917</b>	<b>91.15</b>
<b>Anlageportfolio gesamt</b>			<b>12,250,122</b>	<b>96.97</b>
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
	<b>96.97</b>

**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
	<b>96.97</b>



## Candriam L Multi-Asset Income

## Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
<b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden</b>				
<b>Strukturierte Produkte</b>				
<b>Irland</b>				
ISHARES PHYSICAL GOLD ETC	284,765	USD	9,742,304	2.87
			<b>9,742,304</b>	<b>2.87</b>
<b>Strukturierte Produkte, insgesamt</b>			<b>9,742,304</b>	<b>2.87</b>
<b>Aktien</b>				
<b>Belgien</b>				
ANHEUSER-BUSCH INBEV	3,227	EUR	167,255	0.05
KBC GROUPE SA	2,621	EUR	167,534	0.05
			<b>334,789</b>	<b>0.10</b>
<b>Kanada</b>				
ROYAL BANK OF CANADA	2,369	CAD	207,610	0.06
			<b>207,610</b>	<b>0.06</b>
<b>Dänemark</b>				
ORSTED	9,269	DKK	802,671	0.24
			<b>802,671</b>	<b>0.24</b>
<b>Frankreich</b>				
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
			<b>6,408,590</b>	<b>1.89</b>
<b>Deutschland</b>				
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
			<b>5,011,327</b>	<b>1.47</b>
<b>Irland</b>				
LINDE PLC	380	USD	132,810	0.04
			<b>132,810</b>	<b>0.04</b>
<b>Italien</b>				
ENEL SPA	142,423	EUR	878,465	0.26
			<b>878,465</b>	<b>0.26</b>
<b>Japan</b>				
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
			<b>619,992</b>	<b>0.18</b>
<b>Niederländische Antillen</b>				
SCHLUMBERGER LTD	4,556	USD	205,124	0.06
			<b>205,124</b>	<b>0.06</b>
<b>Niederlande</b>				
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
			<b>2,083,564</b>	<b>0.61</b>

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
<b>Spanien</b>				
IBERDROLA SA	88,186	EUR	1,053,823	0.31
			<b>1,053,823</b>	<b>0.31</b>
<b>Schweiz</b>				
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
			<b>3,730,893</b>	<b>1.10</b>
<b>Grobritannien</b>				
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
			<b>1,951,760</b>	<b>0.57</b>
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>				
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.

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





## 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
			<b>18,472,444</b>	<b>5.43</b>
<b>Aktien gesamt</b>			<b>41,893,862</b>	<b>12.32</b>
<b>Anleihen</b>				
<b>osterreich</b>				
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
			<b>2,530,906</b>	<b>0.74</b>
<b>Belgien</b>				
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
			<b>1,693,162</b>	<b>0.50</b>
<b>Kanada</b>				
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
			<b>3,174,351</b>	<b>0.93</b>
<b>Frankreich</b>				
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
			<b>47,666,704</b>	<b>14.02</b>
<b>Deutschland</b>				
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
			<b>28,491,341</b>	<b>8.38</b>
<b>Italien</b>				
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
			<b>28,248,572</b>	<b>8.31</b>

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

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



## Candriam L Multi-Asset Income

## Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
<b>Niederlande</b>				
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
			<b>3,791,257</b>	<b>1.12</b>
<b>Portugal</b>				
PORTUGAL 4.125 17-27 14/04A	1,465,000	EUR	1,526,918	0.45
			<b>1,526,918</b>	<b>0.45</b>
<b>Spanien</b>				
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
			<b>23,174,845</b>	<b>6.82</b>
<b>Grobritannien</b>				
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
			<b>3,749,140</b>	<b>1.10</b>
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>				
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
			<b>45,664,783</b>	<b>13.43</b>
<b>Anleihen gesamt</b>			<b>189,711,979</b>	<b>55.81</b>
<b>Wandelanleihen</b>				
<b>Frankreich</b>				
ELIS SA CV 2.25 22-29 22/09A22-29 22/09A	1,300,000	EUR	1,611,831	0.47
			<b>1,611,831</b>	<b>0.47</b>
<b>Spanien</b>				
CELLNEX TELECOM SA 0.50 19-28 05/07A	1,200,000	EUR	1,257,270	0.37
			<b>1,257,270</b>	<b>0.37</b>
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>				
JPMORGAN CHASE BANK 0.0 21-24 18/02U	2,700,000	EUR	2,862,054	0.84
			<b>2,862,054</b>	<b>0.84</b>

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

Etwrige 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
<b>Wandelanleihen gesamt</b>			<b>5,731,155</b>	<b>1.69</b>
<b>Variabel verzinsliche Anleihen</b>				
<b>Belgien</b>				
KBC GROUPE FL.R 22-27 23/11A	3,900,000	EUR	3,875,918	1.14
			<b>3,875,918</b>	<b>1.14</b>
<b>Frankreich</b>				
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
			<b>9,051,923</b>	<b>2.66</b>
<b>Deutschland</b>				
ALLIANZ SE FL.R 17-47 06/07A	2,300,000	EUR	2,142,140	0.63
			<b>2,142,140</b>	<b>0.63</b>
<b>Italien</b>				
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
			<b>7,663,312</b>	<b>2.25</b>
<b>Niederlande</b>				
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
			<b>5,807,485</b>	<b>1.71</b>
<b>Spanien</b>				
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
			<b>7,992,561</b>	<b>2.35</b>
<b>Grobritannien</b>				
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
			<b>3,241,780</b>	<b>0.95</b>
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>				
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
			<b>5,494,067</b>	<b>1.62</b>
<b>Variabel verzinsliche Anleihen gesamt</b>			<b>45,269,186</b>	<b>13.32</b>
<b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt</b>			<b>292,348,486</b>	<b>86.01</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Anteile/Einheiten an Anlagefonds</b>				
<b>Luxemburg</b>				
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
			<b>31,974,675</b>	<b>9.41</b>
<b>Aktien/Anteile in Anlagementfonds gesamt</b>			<b>31,974,675</b>	<b>9.41</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen gesamt</b>			<b>31,974,675</b>	<b>9.41</b>
<b>Anlageportfolio gesamt</b>			<b>324,323,161</b>	<b>95.41</b>
Erwerbskosten			336,760,745	

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.  
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens 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
	<b>95.41</b>

**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
	<b>95.41</b>

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



## Candriam L Multi-Asset Income &amp; Growth

## Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
<b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden</b>				
<b>Strukturierte Produkte</b>				
<b>Irland</b>				
ISHARES PHYSICAL GOLD ETC	106,213	USD	3,633,731	2.85
			<b>3,633,731</b>	<b>2.85</b>
<b>Strukturierte Produkte, insgesamt</b>			<b>3,633,731</b>	<b>2.85</b>
<b>Aktien</b>				
<b>Belgien</b>				
ANHEUSER-BUSCH INBEV	2,824	EUR	146,368	0.11
KBC GROUPE SA	3,870	EUR	247,370	0.19
			<b>393,738</b>	<b>0.31</b>
<b>Kanada</b>				
ROYAL BANK OF CANADA	1,943	CAD	170,277	0.13
			<b>170,277</b>	<b>0.13</b>
<b>Danemark</b>				
ORSTED	6,600	DKK	571,543	0.45
			<b>571,543</b>	<b>0.45</b>
<b>Frankreich</b>				
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
			<b>5,479,362</b>	<b>4.29</b>
<b>Deutschland</b>				
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
			<b>3,352,218</b>	<b>2.63</b>
<b>Irland</b>				
LINDE PLC	564	USD	197,118	0.15
			<b>197,118</b>	<b>0.15</b>
<b>Italien</b>				
ENEL SPA	97,261	EUR	599,906	0.47
			<b>599,906</b>	<b>0.47</b>
<b>Japan</b>				
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
			<b>672,809</b>	<b>0.53</b>
<b>Niederlandische Antillen</b>				
SCHLUMBERGER LTD	3,965	USD	178,516	0.14
			<b>178,516</b>	<b>0.14</b>
<b>Niederlande</b>				
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.

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



## Candriam L Multi-Asset Income &amp; 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
			<b>1,757,544</b>	<b>1.38</b>
<b>Spanien</b>				
IBERDROLA SA	67,642	EUR	808,322	0.63
			<b>808,322</b>	<b>0.63</b>
<b>Schweiz</b>				
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
			<b>2,632,559</b>	<b>2.06</b>
<b>Grobritannien</b>				
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
			<b>1,363,786</b>	<b>1.07</b>
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>				
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.

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



## Candriam L Multi-Asset Income &amp; 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
			<b>17,848,296</b>	<b>13.98</b>
<b>Aktien gesamt</b>			<b>36,025,994</b>	<b>28.22</b>
<b>Anleihen</b>				
<b>osterreich</b>				
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
			<b>632,304</b>	<b>0.50</b>
<b>Belgien</b>				
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
			<b>454,306</b>	<b>0.36</b>
<b>Kanada</b>				
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
			<b>815,478</b>	<b>0.64</b>
<b>Frankreich</b>				
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
			<b>13,622,124</b>	<b>10.67</b>
<b>Deutschland</b>				
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
			<b>9,553,746</b>	<b>7.48</b>
<b>Italien</b>				
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uterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

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



## Candriam L Multi-Asset Income &amp; 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
			<b>9,720,640</b>	<b>7.61</b>
<b>Niederlande</b>				
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
			<b>962,090</b>	<b>0.75</b>
<b>Portugal</b>				
PORTUGAL 4.125 17-27 14/04A	394,000	EUR	410,652	0.32
			<b>410,652</b>	<b>0.32</b>
<b>Spanien</b>				
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
			<b>8,512,123</b>	<b>6.67</b>
<b>Grobritannien</b>				
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
			<b>919,097</b>	<b>0.72</b>
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>				
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
			<b>12,029,695</b>	<b>9.42</b>
<b>Anleihen gesamt</b>			<b>57,632,255</b>	<b>45.14</b>
<b>Wandelanleihen</b>				
<b>Frankreich</b>				
ELIS SA CV 2.25 22-29 22/09A22-29 22/09A	300,000	EUR	371,961	0.29
			<b>371,961</b>	<b>0.29</b>
<b>Spanien</b>				
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 &amp; Growth

## Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
			<b>419,090</b>	<b>0.33</b>
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>				
JPMORGAN CHASE BANK 0.0 21-24 18/02U	300,000	EUR	318,006	0.25
			<b>318,006</b>	<b>0.25</b>
<b>Wandelanleihen gesamt</b>			<b>1,109,057</b>	<b>0.87</b>
<b>Variabel verzinsliche Anleihen</b>				
<b>Belgien</b>				
KBC GROUPE FL.R 22-27 23/11A	900,000	EUR	894,442	0.70
			<b>894,442</b>	<b>0.70</b>
<b>Frankreich</b>				
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
			<b>2,153,773</b>	<b>1.69</b>
<b>Deutschland</b>				
ALLIANZ SE FL.R 17-47 06/07A	700,000	EUR	651,956	0.51
			<b>651,956</b>	<b>0.51</b>
<b>Italien</b>				
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
			<b>1,946,859</b>	<b>1.52</b>
<b>Niederlande</b>				
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
			<b>1,910,340</b>	<b>1.50</b>
<b>Spanien</b>				
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
			<b>1,991,468</b>	<b>1.56</b>
<b>Grobritannien</b>				
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
			<b>979,194</b>	<b>0.77</b>
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>				
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
			<b>4,297,624</b>	<b>3.37</b>
<b>Variabel verzinsliche Anleihen gesamt</b>			<b>14,825,656</b>	<b>11.61</b>
<b>bertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Brse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt</b>			<b>113,226,693</b>	<b>88.68</b>
<b>Organismen fr gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Anteile/Einheiten an Anlagefonds</b>				
<b>Luxemburg</b>				
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
			<b>9,334,851</b>	<b>7.31</b>
<b>Aktien/Anteile in Anlagefondsgesamt</b>			<b>9,334,851</b>	<b>7.31</b>
<b>Organismen fr gemeinsame Anlagen gesamt</b>			<b>9,334,851</b>	<b>7.31</b>
<b>Anlageportfolio gesamt</b>			<b>122,561,544</b>	<b>95.99</b>
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 &amp; 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
	<b>95.99</b>

**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
	<b>95.99</b>

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



## Candriam L Multi-Asset Premia

## Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
<b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Bermuda</b>				
NORVERGIAN CRUISE LINE LTD	5,677	USD	113,280	0.25
			<b>113,280</b>	<b>0.25</b>
<b>Liberia</b>				
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	1,168	USD	111,062	0.24
			<b>111,062</b>	<b>0.24</b>
<b>Panama</b>				
CARNIVAL CORP	6,914	USD	119,331	0.26
			<b>119,331</b>	<b>0.26</b>
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>				
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
			<b>2,405,713</b>	<b>5.21</b>
<b>Aktien gesamt</b>			<b>2,749,386</b>	<b>5.95</b>
<b>Anleihen</b>				
<b>Belgien</b>				
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
			<b>4,780,391</b>	<b>10.35</b>
<b>Frankreich</b>				
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
			<b>2,861,359</b>	<b>6.20</b>
<b>Deutschland</b>				
GERMANY 0.00 20-25 10/10U	2,300,000	EUR	2,147,292	4.65
			<b>2,147,292</b>	<b>4.65</b>
<b>Italien</b>				
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
			<b>4,204,833</b>	<b>9.10</b>
<b>Spanien</b>				
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
			<b>6,170,243</b>	<b>13.36</b>
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>				
UNIT STAT TREA BIL ZCP 05-10-23	1,000,000	USD	879,598	1.90

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

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



## Candriam L Multi-Asset Premia

## Anlageportfolio zum 30. Juni 2023

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

**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
	<b>59.69</b>



## 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)
<b>Gekauft</b>					
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)
<b>Verkaufte Optionen</b>					
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
				<b>121,649</b>	<b>(107,478)</b>

#### Candriam L Conservative Asset Allocation

Anzahl	Bezeichnung	Währung	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Marktwert (in EUR)	Nicht realisiert (in EUR)
<b>Gekauft</b>					
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)
<b>Verkaufte Optionen</b>					
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
				<b>166,841</b>	<b>(146,658)</b>

#### Candriam L Dynamic Asset Allocation

Anzahl	Bezeichnung	Währung	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Marktwert (in EUR)	Nicht realisiert (in EUR)
<b>Gekauft</b>					
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)
<b>Verkaufte Optionen</b>					
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
				<b>12,314</b>	<b>(10,964)</b>

#### Candriam L Multi-Asset Income

Anzahl	Bezeichnung	Währung	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Marktwert (in EUR)	Nicht realisiert (in EUR)
<b>Gekauft</b>					
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)
				<b>404,813</b>	<b>(625,934)</b>

#### Candriam L Multi-Asset Income & Growth

Anzahl	Bezeichnung	Währung	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Marktwert (in EUR)	Nicht realisiert (in EUR)
<b>Gekauft</b>					
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)
				<b>202,961</b>	<b>(266,153)</b>

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
						<b>(66,836)</b>

#### 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
						<b>(76,338)</b>

#### 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
						<b>(8,658)</b>

#### 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)
						<b>(277,932)</b>



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

## Candriam L Multi-Asset Income &amp; 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)
						<b>(183,841)</b>

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)
<b>Futures auf Anleihen</b>					
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)
<b>Futures auf Index</b>					
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)
					<b>(116,506)</b>

**Candriam L Conservative Asset Allocation**

Anzahl (Kauf/(Verkauf))	Bezeichnung	Währung	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Gegenpartei	Nicht realisiert (in EUR)
<b>Futures auf Anleihen</b>					
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)
<b>Futures auf Index</b>					
(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)
					<b>(307,225)</b>

**Candriam L Dynamic Asset Allocation**

Anzahl (Kauf/(Verkauf))	Bezeichnung	Währung	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Gegenpartei	Nicht realisiert (in EUR)
<b>Futures auf Anleihen</b>					
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)
<b>Futures auf Index</b>					
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)
					<b>(2,357)</b>

**Candriam L Multi-Asset Income**

Anzahl (Kauf/(Verkauf))	Bezeichnung	Währung	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Gegenpartei	Nicht realisiert (in EUR)
<b>Futures auf Anleihen</b>					
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)
<b>Futures auf Anleihen</b>					
<b>Futures auf Index</b>					
(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)
					<b>(300,103)</b>

Candriam L Multi-Asset Income & Growth

Anzahl (Kauf/(Verkauf))	Bezeichnung	Währung	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Gegenpartei	Nicht realisiert (in EUR)
<b>Futures auf Anleihen</b>					
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)
<b>Futures auf Index</b>					
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)
					<b>(287,890)</b>

Candriam L Multi-Asset Premia

Anzahl (Kauf/(Verkauf))	Bezeichnung	Währung	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Gegenpartei	Nicht realisiert (in EUR)
<b>Futures auf Anleihen</b>					
(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
<b>Futures auf Index</b>					
(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)
<b>Futures auf Anleihen</b>					
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
<b>Futures auf Währungen</b>					
(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
					<b>1,151,076</b>

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	ITOCHU 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	ORACLE CORP XNAS US	SOCIETE GENERALE SA	264,159	16,547
7,100	Short	DKK	TOPDANMARK AS	SOCIETE GENERALE SA	319,626	11,252
2,046	Short	USD	CONSTELLATION EN	SOCIETE GENERALE SA	171,688	3,582
109,835	Long	GBP	KINGFISHER PLC XLON GB	SOCIETE GENERALE SA	296,554	(5,504)
24,753	Long	GBP	HISCOX I15	SOCIETE GENERALE SA	314,695	(3,173)
449	Long	USD	SERVICENOW INC X	SOCIETE GENERALE SA	231,278	(5,103)
28,600	Long	JPY	ORIX CORP	SOCIETE GENERALE SA	473,832	15,054
700	Short	JPY	KEYENCE CORP XTKS JP	SOCIETE GENERALE SA	301,197	13,850
3,550	Short	USD	UNITY SOFTWARE I	SOCIETE GENERALE SA	141,284	(5,694)
3,550	Short	USD	COINBASE GLOBAL	SOCIETE GENERALE SA	232,816	(56,292)
474	Long	CHF	LONZA GROUP NOM. XVTX CH	SOCIETE GENERALE SA	259,036	(15,152)
7,259	Short	USD	SENSATA TECH(S)	SOCIETE GENERALE SA	299,342	133
563	Short	USD	STRYKER CORP XNY	SOCIETE GENERALE SA	157,439	(4,871)
4,041	Short	USD	CAESARS ENTERTAI	SOCIETE GENERALE SA	188,790	(2,778)
83,527	Long	EUR	TELEFONICA NAMEN AKT XETR	DESOCIETE GENERALE SA	215,249	(668)
4,366	Short	USD	FORTUNE BRANDS H	SOCIETE GENERALE SA	287,932	(18,569)
1,540	Long	USD	QUINTILES IMS HOLDING INC	SOCIETE GENERALE SA	317,274	11,278
15,955	Short	GBP	GVC HOLDINGS PLC	SOCIETE GENERALE SA	236,494	(13,015)
14,608	Short	EUR	GRIFOLS SA -A-	SOCIETE GENERALE SA	171,498	(6,720)
3,564	Short	USD	CROWN HOLDINGS INC	SOCIETE GENERALE SA	283,781	(392)
64,448	Short	SEK	EMBRACER GRP	SOCIETE GENERALE SA	147,444	3,391
7,911	Long	SEK	ESSITY REGISTERE	SOCIETE GENERALE SA	192,736	4,095
2,558	Long	USD	ALPHABET INC XNAS US	SOCIETE GENERALE SA	280,653	(12,638)
5,507	Short	USD	APA - REGISTERED	SOCIETE GENERALE SA	172,479	2,524
4,517	Short	USD	BENTLEY SYSTEMS	SOCIETE GENERALE SA	224,525	(869)
8,862	Long	SEK	EQT AB	SOCIETE GENERALE SA	155,969	(11,506)
3,169	Long	USD	STARBUCKS CORP X 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	WORKDAY -A-	SOCIETE GENERALE SA	236,657	1,655
29,664	Short	GBP	BOVIS HOMES GROU	SOCIETE GENERALE SA	228,318	28,172
681	Long	USD	FIRST SOLAR INC XNAS US	SOCIETE GENERALE SA	118,654	(1,742)
33,770	Short	GBP	B M EUROPEAN VALUE RETAIL	SOCIETE GENERALE SA	219,191	(2,991)
9,256	Short	SEK	ADDTech - REGIST	SOCIETE GENERALE SA	184,425	1,257
9,560	Long	EUR	CELLNEX TELECOM	SOCIETE GENERALE SA	353,624	5,927
9,561	Short	USD	INTERNATIONAL PA	SOCIETE GENERALE SA	278,768	0
147	Long	USD	MERCADOLIBRE XNA	SOCIETE GENERALE SA	159,612	(5,278)
133	Short	USD	TEXAS PACIFIC LAND TRUS	SOCIETE GENERALE SA	160,490	5,559
187,779	Long	GBP	LEGAL GENERAL GR	SOCIETE GENERALE SA	497,374	(10,284)
7,315	Short	CAD	TRANSCANADA - RE	SOCIETE GENERALE SA	271,279	4,661
15,975	Short	CAD	ALTAGAS	SOCIETE GENERALE SA	263,355	111
24,415	Long	GBP	WISE PLC XLON GB	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	Wahrung	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 ROCHE HOLDING AG GENUSSS	SOCIETE GENERALE SA	175,536	(2,155)
1,155	Short	CHF	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
						<b>(177,637)</b>

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
							<b>146,318</b>

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
<b>Summe</b>					<b>7,497,821</b>



## 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](mailto: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](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 Federfonds.