



Informe semestral sin auditar  
**Candriam Money Market**

30 de junio de 2022

*01.01.2022 – 30.06.2022  
SICAV de derecho luxemburgués  
Registro Mercantil de Luxemburgo B-26803*



# Candriam Money Market

SICAV de derecho luxemburgués

Informe semestral sin auditar correspondiente al periodo  
del 1 de enero de 2022 al 30 de junio de 2022



## Índice

Administración de la SICAV	4
Detalles de la SICAV	5
Estado del activo neto a 30 de junio de 2022	6
Estado junio variación patrimonial del periodo cerrado a 30 de junio de 2022	8
Estadísticas	10
Cartera de inversiones a 30 de junio de 2022	11
Candriam Money Market Euro	11
Candriam Money Market Euro AAA	16
Candriam Money Market USD Sustainable	19
Notas a los Estados financieros - Inventario de instrumentos derivados	22
Otras notas a los estados financieros	23
Información adicional sin auditar	28



## Administración de la SICAV

### Consejo de Administración

#### **Presidente**

Jean-Yves MALDAGUE  
Managing Director, Candriam Luxembourg

#### **Consejeros**

Annemarie ARENS  
Independent Director

Thierry BLONDEAU  
Independent Director

Tanguy DE VILLENFAGNE  
Member of the Group Strategic Committee, Candriam Belgium

Damien ROL  
Deputy Global Head of Legal, Candriam France

Myriam VANNESTE  
Global Head of Product Management, Candriam Belgium

### Domicilio social

5, Allée Scheffer  
L-2520 Luxemburgo

### Depositario

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

### Sociedad Gestora

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

Las funciones de **Agente Administrativo**, **Agente de Domiciliaciones** y **Agente de Transmisiones** (incluidas las actividades del **Conservador de Registro**) se han delegado en:

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

La ejecución de la **gestión de carteras** se ha delegado en:

Candriam Belgium  
58, Avenue des Arts  
B-1000 Bruselas

### **Réviseur d'entreprises agréé**

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

### **Réviseur d'entreprises agréé de la Sociedad Gestora**

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



## Detalles de la SICAV

Candriam Money Market es una sociedad de inversión de capital variable (SICAV) constituida de conformidad con la legislación del Gran Ducado de Luxemburgo relativa a organismos de inversión colectiva y autorizada como fondo del mercado monetario por la CSSF con arreglo al Reglamento relativo a los fondos del mercado monetario.

La SICAV está supeditada a lo dispuesto en la parte I de la Ley de 17 de diciembre de 2010 relativa a organismos de inversión colectiva («OIC»), en su versión oportunamente modificada, y a la Ley de 10 de agosto de 1915 de sociedades mercantiles, en su versión oportunamente modificada.

El capital de la SICAV es en todo momento igual al total del activo neto de la SICAV.

La SICAV está inscrita en el Registro Mercantil y de Sociedades de Luxemburgo con el número B-26803.

La SICAV pone a disposición de los inversores varias carteras, formada cada una de ellas por un conjunto distinto de activos representados por diferentes clases de acciones (en adelante, «subfondos»).

La SICAV constituye por ende una sociedad de inversión de subfondos múltiples.

Las cuentas anuales de cada uno de los subfondos destinadas a los accionistas y los resultados consolidados están disponibles previa solicitud y de forma gratuita en el domicilio social de la SICAV y pueden ser enviados a los titulares de acciones nominativas a la dirección indicada en el registro de accionistas, sin cargo y previa solicitud.

Además, los informes semestrales no auditados están asimismo disponibles previa solicitud y de forma gratuita en el domicilio social de la SICAV y pueden ser enviadas a los titulares de acciones nominativas, sin cargo y previa solicitud.

El ejercicio de la SICAV se cierra el 31 de diciembre de cada año.

Las acciones solo estarán disponibles de forma nominativa.

La Junta General Anual de Accionistas de la SICAV se celebrará cada año en el domicilio social de la SICAV o en cualquier otro lugar de Luxemburgo que se especifique en la convocatoria.

Se celebrará en el plazo máximo de seis meses desde la fecha de cierre del ejercicio social.

En la convocatoria se indicará la hora y el lugar de la Junta General, as condiciones de admisión, el orden del día y los requisitos de cuórum y mayorías necesarios conforme a la legislación de Luxemburgo. En la convocatoria, se indicará la hora y el lugar de la junta general, las condiciones de admisión, el orden del día y los requisitos de cuórum y mayorías necesarios conforme a la legislación de Luxemburgo.

Además, la convocatoria se publicará en el *Mémorial, Recueil des Sociétés et Associations* del Gran Ducado de Luxemburgo y en un diario luxemburgués, el *Luxemburger Wort*, si así lo exige la legislación, así como en la prensa de los países en donde se comercialice la SICAV, si la legislación de dichos países lo exige.

El valor liquidativo por acción de cada subfondo, los precios de suscripción y recompra de las acciones de cada subfondo, así como los cambios realizados en la cartera pueden obtenerse en el domicilio social de la SICAV.

El folleto, documentos de información fundamentales para el inversor, los estatutos y las cuentas financieras de la SICAV se mantienen gratuitamente a disposición del público en el domicilio social de la SICAV.



## Estado del activo neto a 30 de junio de 2022

		Candriam Money Market Euro	Candriam Money Market Euro AAA	Candriam Money Market USD Sustainable
		EUR	EUR	USD
<b>Activo</b>				
Cartera de inversiones al valor de mercado	2a	1,430,104,296	281,993,341	104,808,885
Efectivo en bancos e intermediarios financieros		115,719,911	38,732,623	9,235,270
Importe por cobrar de suscripciones		4,223,970	0	6,013,116
Intereses y dividendos por cobrar, netos		2,891,847	544,401	198,602
Plusvalía latente neta de contratos de divisas a plazo	2d	0	0	400,779
<b>Total activo</b>		<b>1,552,940,024</b>	<b>321,270,365</b>	<b>120,656,652</b>
<b>Pasivo</b>				
Importe por pagar por inversiones adquiridas		85,800,589	15,006,502	0
Acreedores por reembolsos		2,440,388	0	8,096,659
Comisiones de gestión por pagar	4	187,170	6,561	18,395
Gastos operativos y administrativos por pagar	5	76,355	15,825	6,539
Impuesto de suscripción por pagar	6	123,055	0	7,265
<b>Total pasivo</b>		<b>88,627,557</b>	<b>15,028,888</b>	<b>8,128,858</b>
<b>Total del activo neto</b>		<b>1,464,312,467</b>	<b>306,241,477</b>	<b>112,527,794</b>



## Estado del activo neto a 30 de junio de 2022

		Combinado
		EUR
<b>Activo</b>		
Cartera de inversiones al valor de mercado	2a	1,812,350,050
Efectivo en bancos e intermediarios financieros		163,286,309
Importe por cobrar de suscripciones		9,975,671
Intereses y dividendos por cobrar, netos		3,626,216
Plusvalía latente neta de contratos de divisas a plazo	2d	383,355
<b>Total activo</b>		<b>1,989,621,601</b>
<b>Pasivo</b>		
Importe por pagar por inversiones adquiridas		100,807,091
Acreedores por reembolsos		10,185,052
Comisiones de gestión por pagar	4	211,326
Gastos operativos y administrativos por pagar	5	98,435
Impuesto de suscripción por pagar	6	130,004
<b>Total pasivo</b>		<b>111,431,908</b>
<b>Total del activo neto</b>		<b>1,878,189,693</b>



## Estado junio variación patrimonial del periodo cerrado a 30 de junio de 2022

		Candriam Money Market Euro	Candriam Money Market Euro AAA	Candriam Money Market USD Sustainable
		EUR	EUR	USD
<b>Activo neto al inicio del periodo</b>		<b>1,333,059,823</b>	<b>326,824,499</b>	<b>121,258,156</b>
<b>Ingresos</b>				
Dividendos netos		15,707	11,955	0
Intereses netos de bonos e instrumentos del mercado monetario	2f	2,602,130	615,309	421,702
Intereses bancarios		221	7	14,958
Otros ingresos		1,116	305	53
<b>Total ingresos</b>		<b>2,619,174</b>	<b>627,576</b>	<b>436,713</b>
<b>Gastos</b>				
Comisiones de gestión	4	1,080,244	37,511	109,984
Gastos operativos y administrativos	5	407,515	84,572	36,869
Comisiones del depositario	5	31,738	7,073	2,609
Impuesto de suscripción	6	175,511	0	9,218
Intereses bancarios		344,241	189,661	5,603
<b>Total gastos</b>		<b>2,039,249</b>	<b>318,817</b>	<b>164,283</b>
<b>Ingresos/(Pérdidas) netos(as) de las inversiones</b>		<b>579,925</b>	<b>308,759</b>	<b>272,430</b>
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de ventas de inversiones	2b	(6,445,252)	(1,152,137)	(425,345)
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de contratos de divisas a plazo	2d	115,034	85,345	3,190,100
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de divisas		(138,386)	(104,677)	(2,576,006)
<b>Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas</b>		<b>(5,888,679)</b>	<b>(862,710)</b>	<b>461,179</b>
Variación de la plusvalía/minusvalía latente neta de inversiones	2a	708,560	(117,592)	(628,258)
Variación de la plusvalía/minusvalía latente neta de contratos de divisas a plazo	2d	0	0	242,532
<b>Aumento/(Disminución) neto/a del activo neto resultante de operaciones</b>		<b>(5,180,119)</b>	<b>(980,302)</b>	<b>75,453</b>
<b>Evolución del capital</b>				
Suscripciones de acciones		1,186,640,044	724,234,196	179,602,978
Reembolsos de acciones		(1,050,207,281)	(743,836,916)	(188,408,793)
Conversión de divisas		0	0	0
<b>Activo neto al final del periodo</b>		<b>1,464,312,467</b>	<b>306,241,477</b>	<b>112,527,794</b>





## Estado junio variación patrimonial del periodo cerrado a 30 de junio de 2022

		Combinado
		EUR
<b>Activo neto al inicio del periodo</b>		<b>1,766,513,022</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos netos		27,662
Intereses netos de bonos e instrumentos del mercado monetario	2f	3,620,808
Intereses bancarios		14,536
Otros ingresos		1,472
<b>Total ingresos</b>		<b>3,664,478</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión	4	1,222,958
Gastos operativos y administrativos	5	527,353
Comisiones del depositario	5	41,307
Impuesto de suscripción	6	184,328
Intereses bancarios		539,261
<b>Total gastos</b>		<b>2,515,207</b>
<b>Ingresos/(Pérdidas) netos(as) de las inversiones</b>		<b>1,149,271</b>
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de ventas de inversiones	2b	(8,004,243)
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de contratos de divisas a plazo	2d	3,251,792
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de divisas		(2,707,079)
<b>Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas</b>		<b>(6,310,259)</b>
Variación de la plusvalía/minusvalía latente neta de inversiones	2a	(9,977)
Variación de la plusvalía/minusvalía latente neta de contratos de divisas a plazo	2d	231,988
<b>Aumento/(Disminución) neto/a del activo neto resultante de operaciones</b>		<b>(6,088,248)</b>
<b>Evolución del capital</b>		
Suscripciones de acciones		2,082,669,140
Reembolsos de acciones		(1,974,262,087)
Conversión de divisas		9,357,866
<b>Activo neto al final del periodo</b>		<b>1,878,189,693</b>



## Estadísticas

### Candriam Money Market Euro

Nombre	ISIN	Tipo de acciones	Divisa	Número de acciones en circulación	Valor liquidativo por acción a 30/06/2022	Valor liquidativo por acción a 31/12/2021	Valor liquidativo por acción a 31/12/2020
<b>Total del activo neto</b>			<b>EUR</b>		<b>1,464,312,467</b>	<b>1,333,059,823</b>	<b>1,401,398,342</b>
C	LU0093583077	Capitalización	EUR	710,795.80	507.93	510.67	515.88
C	LU0093583234	Distribución	EUR	67,783.72	353.07	355.12	359.02
I	LU0206982331	Capitalización	EUR	812,469.00	542.49	544.23	547.38
R	LU0936337848	Capitalización	EUR	1,345.51	97.87	98.20	98.78
R2	LU1389877876	Distribución	EUR	2,700.00	146.77	147.28	148.22
V	LU0323048693	Capitalización	EUR	347,170.99	1,004.36	1,007.36	1,012.69
Z	LU0391999124	Capitalización	EUR	286,732.09	1,009.24	1,012.04	1,016.97

### Candriam Money Market Euro AAA

Nombre	ISIN	Tipo de acciones	Divisa	Número de acciones en circulación	Valor liquidativo por acción a 30/06/2022	Valor liquidativo por acción a 31/12/2021	Valor liquidativo por acción a 31/12/2020
<b>Total del activo neto</b>			<b>EUR</b>		<b>306,241,477</b>	<b>326,824,499</b>	<b>252,223,573</b>
C	LU0354091653	Capitalización	EUR	572,945.44	101.88	102.22	102.92
C*	LU0354091737	Distribución	EUR	-	-	99.97	-
I	LU0354091901	Capitalización	EUR	22,944.13	1,042.33	1,045.55	1,052.32
I	LU0354127358	Distribución	EUR	267.88	1,022.40	1,025.56	1,032.20
R	LU0936338655	Capitalización	EUR	479.36	149.29	149.77	-
V	LU0354092115	Capitalización	EUR	120,726.44	1,044.91	1,048.09	1,054.77
V	LU0354092206	Distribución	EUR	1.00	1,030.09	1,032.72	1,038.39
Z	LU0391999470	Capitalización	EUR	92,772.50	1,050.53	1,053.57	1,059.97

### Candriam Money Market USD Sustainable

Nombre	ISIN	Tipo de acciones	Divisa	Número de acciones en circulación	Valor liquidativo por acción a 30/06/2022	Valor liquidativo por acción a 31/12/2021	Valor liquidativo por acción a 31/12/2020
<b>Total del activo neto</b>			<b>USD</b>		<b>112,527,794</b>	<b>121,258,156</b>	<b>175,112,698</b>
C	LU0049341216	Capitalización	USD	85,662.08	549.34	549.25	550.27
C	LU0094032728	Distribución	USD	19,464.58	365.91	365.99	367.01
I	LU0206982414	Capitalización	USD	61,382.68	572.33	571.71	571.77
I	LU0355214700	Distribución	USD	684.00	543.25	542.66	542.52
V	LU0323048347	Capitalización	USD	1.00	1,107.36	1,105.34	1,104.57
Z	LU0391999553	Capitalización	USD	20,513.83	1,113.61	1,111.68	1,110.18

\* La clase de acciones está inactiva desde el 03/03/2022.



Candriam Money Market Euro

Cartera de inversiones a 30 de junio de 2022

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en EUR)	% del activo neto
<b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado regulado</b>				
<b>Bonos</b>				
<b>Bélgica</b>				
BELFIUS BANQUE SA 0.75 17-22 12/09A	13,700,000	EUR	13,714,590	0.94
COFINIMMO SA ZCP 250722	12,000,000	EUR	12,007,239	0.82
FLUVIUS SYSTEM OPER ZCP 010722	11,000,000	EUR	11,001,390	0.75
FLUXYS FINANCE SA ZCP 180722	1,500,000	EUR	1,502,830	0.10
REGION WALLONNE ZCP 010722	16,000,000	EUR	16,005,802	1.09
REGION WALLONNE ZCP 010822	11,000,000	EUR	11,003,149	0.75
SOWAER ZCP 060722	4,000,000	EUR	4,000,017	0.27
SPGE ZCP 040722	8,000,000	EUR	8,002,901	0.55
SPGE ZCP 040822	15,000,000	EUR	14,999,354	1.02
UCB ZCP 06-07-22	5,000,000	EUR	5,001,209	0.34
			<b>97,238,481</b>	<b>6.64</b>
<b>Francia</b>				
ASFFP 5.625 07-22 04/07A	7,300,000	EUR	7,302,847	0.50
COVIVIO SA ZCP 110722	14,000,000	EUR	14,004,424	0.96
COVIVIO SA ZCP 200722	9,000,000	EUR	9,006,134	0.62
DANONE SA ZCP 010822	14,000,000	EUR	14,004,392	0.96
DASSAULT SYSTEM 0.00 19-22 16/09A	25,500,000	EUR	25,482,405	1.74
ENGIE 3.50 10-22 18/10A	3,137,000	EUR	3,166,660	0.22
ENGIE SA ZCP 040722	20,000,000	EUR	20,006,536	1.37
ENGIE SA ZCP 250722	10,000,000	EUR	10,010,041	0.68
METROPOLE DE LYON ZCP 040722	10,000,000	EUR	10,003,424	0.68
METROPOLE DE LYON ZCP 250722	10,000,000	EUR	10,003,867	0.68
MICHELIN (CGDE) ZCP 070722	13,000,000	EUR	13,000,456	0.89
NORD PAS DE CALAIS ZCP 070722	22,000,000	EUR	22,001,047	1.50
PSA BQUE FCE ZCP 120722	21,000,000	EUR	21,017,053	1.44
SCHNEIDER ELEC.SE ZCP 040722	20,000,000	EUR	20,018,626	1.37
VEOLIA ENVIRONN SA ZCP 010822	16,000,000	EUR	16,004,394	1.09
VEOLIA ENVIRONN SA ZCP 150722	13,000,000	EUR	13,004,341	0.89
			<b>228,036,647</b>	<b>15.57</b>
<b>Alemania</b>				
ADIDAS AG ZCP 290722	5,000,000	EUR	5,001,354	0.34
CONTINENTAL AG ZCP 270722	15,000,000	EUR	15,002,492	1.02
HEIDELBERGCEMENT AG ZCP 070922	8,000,000	EUR	8,005,255	0.55
HEIDELBERGCEMENT AG ZCP 120722	3,000,000	EUR	3,000,934	0.20
HEIDELBERGCEMENT AG ZCP 140722	9,000,000	EUR	9,004,445	0.61
HEIDELBERGCEMENT AG ZCP 180722	2,000,000	EUR	2,000,257	0.14
MERCEDES-BENZ FINE 0.00 19-22 21/08U	5,000,000	EUR	4,999,825	0.34
VOLKSWAGEN BANK 0.3750 19-22 05/07A	12,900,000	EUR	12,901,096	0.88
VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.25 19-22 01/08A	5,500,000	EUR	5,503,300	0.38
			<b>65,418,958</b>	<b>4.47</b>
<b>Irlanda</b>				
JOHNSON CONTROLS INT ZCP 060722	14,000,000	EUR	14,003,339	0.96
JOHNSON CONTROLS INT ZCP 140922	15,000,000	EUR	15,009,080	1.02
			<b>29,012,419</b>	<b>1.98</b>
<b>Italia</b>				
UNIONE DI BANCHE ITAL 1.00 19-22 22/07A	4,700,000	EUR	4,702,092	0.32
			<b>4,702,092</b>	<b>0.32</b>
<b>Luxemburgo</b>				
BHP BILLITON FINANCE 0.75 15-22 28/10A	15,594,000	EUR	15,599,302	1.07
BMW FINANCE NV 0.125 19-22 13/07A	16,587,000	EUR	16,584,429	1.13
DEUT TELEKOM INT FIN 4.25 10-22 13/07A	5,000,000	EUR	5,005,925	0.34
DH EUROPE FINANCE II ZCP 220722	16,000,000	EUR	16,001,560	1.09
DIGITAL DUTCH FINCO 0.125 20-22 15/10A	11,500,000	EUR	11,488,155	0.78

Las notas que acompañan a los estados financieros forman parte integrante de los mismos.  
Las diferencias en el porcentaje del Activo neto son el resultado del redondeo.



Candriam Money Market Euro

Cartera de inversiones a 30 de junio de 2022

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en EUR)	% del activo neto
FIDELITY NATIONAL INF 0.125 19-22 03/12A	4,267,000	EUR	4,264,674	0.29
IBERDROLA INTL BV 2.50 14-22 24/10A	2,400,000	EUR	2,416,020	0.16
<b>Denominación</b>	<b>Cantidad</b>	<b>Divisa</b>	<b>Valor de mercado (en EUR)</b>	<b>% del activo neto</b>
REPSOL EUROPE FINA ZCP 010722	10,000,000	EUR	10,003,223	0.68
SIMON INTL FINANCE 1.375 15-22 18/11A	7,860,000	EUR	7,872,065	0.54
SOCIETE GENERALE 4.25 12-22 13/07A	2,000,000	EUR	2,002,100	0.14
TOYOTA MOTOR CR 0.75 15-22 21/07A	12,170,000	EUR	12,173,347	0.83
WELLS FARGO 1.50 15-22 12/09A	27,900,000	EUR	27,972,540	1.91
			<b>131,383,340</b>	<b>8.97</b>
<b>Países Bajos</b>				
ABB FINANCE BV ZCP 050722	8,000,000	EUR	8,000,092	0.55
ABB FINANCE BV ZCP 130722	10,000,000	EUR	10,002,770	0.68
AKZO NOBEL NV ZCP 010822	15,000,000	EUR	15,008,680	1.02
AKZO NOBEL NV ZCP 080822	5,500,000	EUR	5,503,200	0.38
AKZO NOBEL NV ZCP 250722	27,000,000	EUR	27,015,923	1.84
ENEL FINANCE INT NV ZCP 010722	20,000,000	EUR	20,004,996	1.37
ENEL FINANCE INT NV ZCP 040722	5,000,000	EUR	5,002,706	0.34
IBERDROLA INT. BV ZCP 110722	500,000	EUR	501,201	0.03
IBERDROLA INT. BV ZCP 150722	20,000,000	EUR	20,008,367	1.37
IBERDROLA INT. BV ZCP 200722	14,000,000	EUR	14,004,962	0.96
IBERDROLA INT. BV ZCP 250722	7,000,000	EUR	7,002,693	0.48
KONINKLIJKE AHOLD D. ZCP 080822	15,000,000	EUR	15,001,637	1.02
KONINKLIJKE AHOLD D. ZCP 220722	11,000,000	EUR	11,002,063	0.75
KONINKLIJKE DSM N.V. ZCP 060922	18,000,000	EUR	18,012,852	1.23
WOLTERS KLUWER NV ZCP 070722	5,000,000	EUR	5,001,228	0.34
			<b>181,073,370</b>	<b>12.37</b>
<b>España</b>				
BCO BILBAO VIZCAYA 0.75 17-22 11/09A	2,200,000	EUR	2,203,113	0.15
FERROVIAL SA ZCP 070722	11,000,000	EUR	11,001,229	0.75
FERROVIAL SA ZCP 260722	8,000,000	EUR	8,001,807	0.55
SANTANDER CONS BK 0.75 17-22 17/10A	5,000,000	EUR	5,006,250	0.34
			<b>26,212,399</b>	<b>1.79</b>
<b>Suecia</b>				
SCANIA CV AB 0 20-22 23/11A	12,956,000	EUR	12,932,355	0.88
SCANIA CV AB ZCP 210722	10,000,000	EUR	10,008,051	0.68
			<b>22,940,406</b>	<b>1.57</b>
<b>Suiza</b>				
UBS GROUP FUNDING 1.75 15-22 16/11A	12,601,000	EUR	12,663,501	0.86
			<b>12,663,501</b>	<b>0.86</b>
<b>Reino Unido</b>				
COCA-COLA EUROPACIFI ZCP 010722	12,500,000	EUR	12,501,830	0.85
COCA-COLA EUROPACIFI ZCP 150822	4,500,000	EUR	4,502,732	0.31
COCA-COLA EUROPACIFI ZCP 220722	8,000,000	EUR	8,005,509	0.55
COCA-COLA EUROPACIFI ZCP 290722	14,000,000	EUR	14,009,500	0.96
NOMURA BANK INTL ZCP 020822	8,000,000	EUR	8,001,715	0.55
RECKITT BENCKISER TS ZCP 240822	24,000,000	EUR	24,023,801	1.64
			<b>71,045,087</b>	<b>4.85</b>
<b>Estados Unidos de América</b>				
AMERICAN HONDA 0.35 19-22 26/02A	24,074,000	EUR	24,080,380	1.64
DANAHER CORP ZCP 060722	6,000,000	EUR	6,003,271	0.41
DANAHER CORP ZCP 290722	19,000,000	EUR	19,002,022	1.30
FIDELITY NATL INFORM ZCP 200722	10,000,000	EUR	10,002,133	0.68
FIDELITY NATL INFORM ZCP 250722	4,000,000	EUR	4,001,850	0.27
FISERV INC ZCP 070722	16,000,000	EUR	16,008,793	1.09
FISERV INC ZCP 210722	6,000,000	EUR	6,003,260	0.41
FISERV INC ZCP 280722	9,000,000	EUR	9,001,294	0.61

Las notas que acompañan a los estados financieros forman parte integrante de los mismos.  
Las diferencias en el porcentaje del Activo neto son el resultado del redondeo.



Candriam Money Market Euro

Cartera de inversiones a 30 de junio de 2022

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en EUR)	% del activo neto
FISERV ZCP 11-08-22	12,500,000	EUR	12,506,814	0.85
GOLDMAN SACHS GROUP 1.375 15-22 26/07A	10,000,000	EUR	10,007,000	0.68
MANPOWER GROUP 1.875 15-22 11/09A	6,100,000	EUR	6,107,686	0.42
WELLS FARGO 2.625 12-22 16/08A	16,000,000	EUR	16,046,320	1.10
			<b>138,770,823</b>	<b>9.48</b>
<b>Total de bonos</b>			<b>1,008,497,523</b>	<b>68.87</b>
<b>Floating Rate Notes</b>				
<b>Australia</b>				
COMMONW BK AUSTRALIA FL.R 18-23 08/03Q	3,650,000	EUR	3,658,924	0.25
			<b>3,658,924</b>	<b>0.25</b>
<b>Bélgica</b>				
KBC GROUPE SA FL.R 17-22 24/11Q	13,100,000	EUR	13,114,606	0.90
			<b>13,114,606</b>	<b>0.90</b>
<b>Canadá</b>				
BANK OF NOVA SCOTIA FL.R 18-22 05/10Q	7,140,000	EUR	7,147,711	0.49
DAIMLER CANADA FINAN FL.R 20-22 11/09Q	13,000,000	EUR	13,011,050	0.89
			<b>20,158,761</b>	<b>1.38</b>
<b>Francia</b>				
SOCIETE GENERALE FL.R 18-23 06/03Q	5,100,000	EUR	5,107,828	0.35
			<b>5,107,828</b>	<b>0.35</b>
<b>Alemania</b>				
VOLKSWAGEN LEASING FL.R 20-22 16/11Q	13,600,000	EUR	13,607,072	0.93
VONOVIA FINANCE BV FL.R 18-22 22/12Q	24,600,000	EUR	24,614,514	1.68
			<b>38,221,586</b>	<b>2.61</b>
<b>Luxemburgo</b>				
AT&T INC FL.R 18-23 05/09Q	15,936,000	EUR	16,016,875	1.09
BNP PARIBAS FL.R 17-22 22/09Q	20,725,000	EUR	20,759,714	1.42
BNP PARIBAS FL.R 18-23 19/01Q	9,000,000	EUR	9,004,320	0.61
DEUTSCHE TELEKOM AG FL.R 18-22 01/12Q	2,000,000	EUR	2,000,390	0.14
GOLDMAN SACHS GROUP FL.R 15-22 26/07Q	4,225,000	EUR	4,227,049	0.29
ING GROUP NV FL.R 18-23 20/09Q	15,500,000	EUR	15,607,105	1.07
JOHN DEERE BANK FL.R 17-22 03/10Q	6,000,000	EUR	6,002,700	0.41
MITSUBISHI UFJ FIN FL.R 18-23 30/05Q	5,000,000	EUR	5,010,475	0.34
TAKEDA PHARMACEUTICAL FL.R 18-22 21/11Q	13,300,000	EUR	13,333,716	0.91
VOLKSWAGEN BANK GMBH FL.R 19-22 01/08Q	11,500,000	EUR	11,510,522	0.79
			<b>103,472,866</b>	<b>7.07</b>
<b>Países Bajos</b>				
ABB FINANCE FL.R 22-24 31/03Q	1,873,000	EUR	1,888,892	0.13
DIGITAL DUTCH FINCO FL.R 20-22 23/09Q	18,224,000	EUR	18,232,474	1.25
THERMO FISHER SCIENTIF FL.R 21-23 18/11Q	4,500,000	EUR	4,484,745	0.31
			<b>24,606,111</b>	<b>1.68</b>
<b>Noruega</b>				
DNB BANK ASA FL.R 19-22 25/01Q	5,500,000	EUR	5,502,585	0.38
			<b>5,502,585</b>	<b>0.38</b>
<b>España</b>				
BANCO BILBAO VIZCAYA FL.R 18-23 03/09Q	13,000,000	EUR	13,029,185	0.89
BANCO NTANDER F.LR 22-24 05/05Q	9,200,000	EUR	9,299,176	0.64
BBVA FL.R 21-23 03/12Q	10,000,000	EUR	10,098,550	0.69
			<b>32,426,911</b>	<b>2.21</b>
<b>Reino Unido</b>				
HSBC BANK PLC FL.R 20-22 14/09Q	20,000,000	EUR	20,057,100	1.37
HSBC HOLDINGS PLC FL.R 17-23 05/10Q	5,107,000	EUR	5,107,689	0.35
			<b>25,164,789</b>	<b>1.72</b>
<b>Estados Unidos de América</b>				
CITIGROUP INC FL.R 18-23 21/03Q	18,000,000	EUR	18,026,910	1.23
GOLDMAN SACHS GROUP FL.R 17-23 26/09Q	3,000,000	EUR	3,000,420	0.20
			<b>21,027,330</b>	<b>1.44</b>
<b>Total de floating rate notes</b>			<b>292,462,297</b>	<b>19.97</b>

Las notas que acompañan a los estados financieros forman parte integrante de los mismos.  
Las diferencias en el porcentaje del Activo neto son el resultado del redondeo.



## Candriam Money Market Euro

### Cartera de inversiones a 30 de junio de 2022

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en EUR)	% del activo neto
<b>Total de valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado regulado</b>			<b>1,300,959,820</b>	<b>88.84</b>
<b>Mercado del Tesoro</b>				
<b>Instrumentos del mercado monetario</b>				
<b>Bélgica</b>				
SOCIETE WALLONNE DU ZCP 141022	3,500,000	EUR	3,509,617	0.24
			<b>3,509,617</b>	<b>0.24</b>
<b>Total Instrumentos del mercado monetario</b>			<b>3,509,617</b>	<b>0.24</b>
<b>Total Mercado del Tesoro</b>			<b>3,509,617</b>	<b>0.24</b>
<b>Organismos de inversión colectiva</b>				
<b>Acciones/Participaciones de fondos de inversión</b>				
<b>Francia</b>				
CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV V EUR	608	EUR	60,154,205	4.11
			<b>60,154,205</b>	<b>4.11</b>
<b>Luxemburgo</b>				
CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO V EUR C	64,600	EUR	65,480,654	4.47
			<b>65,480,654</b>	<b>4.47</b>
<b>Total de Acciones/Participaciones de fondos de inversión</b>			<b>125,634,859</b>	<b>8.58</b>
<b>Total de Organismos de inversión colectiva</b>			<b>125,634,859</b>	<b>8.58</b>
<b>Total de la cartera de inversiones</b>			<b>1,430,104,296</b>	<b>97.66</b>
Coste de adquisición			1,433,666,582	

Las notas que acompañan a los estados financieros forman parte integrante de los mismos.  
Las diferencias en el porcentaje del Activo neto son el resultado del redondeo.



## Candriam Money Market Euro

### Distribución geográfica y económica de la cartera de inversiones a 30 de junio de 2022

#### Distribución geográfica (en % del activo neto)

Luxemburgo	20.51
Francia	20.03
Países Bajos	14.05
Estados Unidos de América	10.91
Bélgica	7.78
Alemania	7.08
Reino Unido	6.57
España	4.00
Irlanda	1.98
Suecia	1.57
Canadá	1.38
Suiza	0.86
Noruega	0.38
Italia	0.32
Australia	0.25
	<b>97.66</b>

#### Distribución económica (en % del activo neto)

Bancos y otras entidades financieras	42.70
Internet y servicios de Internet	5.96
Fondos de inversión	5.29
Suministros públicos	4.52
Productos químicos	4.48
Instituciones inclasificables	3.90
Bienes inmuebles	3.79
Alimentos y bebidas no alcohólicas	3.62
Bonos de Estados, Provincias y municipios	3.21
Ingeniería eléctrica	3.00
Varios bienes de consumo	2.40
Servicios varios	2.05
Transporte	1.80
Comercio minorista y grandes almacenes	1.78
Construcción de máquinas y aparatos	1.71
Vehículos de carretera	1.57
Materiales de construcción	1.50
Industria farmacéutica	1.25
Comunicación	1.09
Neumáticos y caucho	1.02
Industria gráfica y editorial	0.34
Textil y prendas de vestir	0.34
Otros	0.24
Petróleo	0.10
	<b>97.66</b>



Candriam Money Market Euro AAA

Cartera de inversiones a 30 de junio de 2022

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en EUR)	% del activo neto
<b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado regulado</b>				
<b>Bonos</b>				
<b>Australia</b>				
NATIONAL AUSTRALIA BK 2.75 12-22 08/08A	12,600,000	EUR	12,636,540	4.13
			<b>12,636,540</b>	<b>4.13</b>
<b>Bélgica</b>				
LVMH FIN BELGIQUE SA ZCP 270722	9,000,000	EUR	9,005,281	2.94
LVMH FIN BELGIQUE SA ZCP 290722	5,000,000	EUR	5,002,994	1.63
SOCIETE WALLONNE DU ZCP 140722	3,000,000	EUR	3,006,690	0.98
			<b>17,014,965</b>	<b>5.56</b>
<b>Francia</b>				
AIR LIQUIDE FINANCE ZCP 010722	9,500,000	EUR	9,502,373	3.10
DASSAULT SYSTEM 0.00 19-22 16/09A	8,300,000	EUR	8,294,066	2.71
GIRONDE (DEPART) ZCP 200722	15,000,000	EUR	15,006,526	4.90
NORD PAS DE CALAIS ZCP 070722	8,000,000	EUR	8,002,989	2.61
NORD PAS DE CALAIS ZCP 260722	8,000,000	EUR	8,003,808	2.61
PARIS (VILLE DE) ZCP 220722	10,000,000	EUR	10,004,795	3.27
PARIS (VILLE DE) ZCP 270722	5,000,000	EUR	5,001,938	1.63
			<b>63,816,495</b>	<b>20.84</b>
<b>Alemania</b>				
ADIDAS AG ZCP 080722	5,000,000	EUR	5,001,923	1.63
ADIDAS AG ZCP 290722	6,000,000	EUR	6,002,145	1.96
			<b>11,004,068</b>	<b>3.59</b>
<b>Luxemburgo</b>				
BMW FINANCE NV 0.125 19-22 13/07A	8,484,000	EUR	8,482,261	2.77
COOP RABOBANK 0.50 17-22 06/12A	5,500,000	EUR	5,506,545	1.80
LLOYDS BK CORP MKTS 0.25 19-22 04/10A	6,000,000	EUR	6,002,130	1.96
PROCTER GAMB REGS 2.00 12-22 16/08A	8,580,000	EUR	8,602,351	2.81
TOYOTA MOTOR CR 0.75 15-22 21/07A	8,551,000	EUR	8,555,789	2.79
			<b>37,149,076</b>	<b>12.13</b>
<b>Países Bajos</b>				
UNILEVER FINANCE NET ZCP 250722	10,000,000	EUR	10,004,727	3.27
			<b>10,004,727</b>	<b>3.27</b>
<b>España</b>				
SANTAN CONS FIN S.A. ZCP 200722	5,000,000	EUR	5,005,833	1.63
			<b>5,005,833</b>	<b>1.63</b>
<b>Suecia</b>				
NORDEA BANK AB 0.30 17-22 30/06A	10,000,000	EUR	10,001,550	3.27
SVENSKA HANDELSBANK ZCP 310822	8,000,000	EUR	8,006,071	2.61
			<b>18,007,621</b>	<b>5.88</b>
<b>Suiza</b>				
NESTLE SA ZCP 130722	3,000,000	EUR	3,001,625	0.98
			<b>3,001,625</b>	<b>0.98</b>
<b>Total de bonos</b>			<b>177,640,950</b>	<b>58.01</b>
<b>Floating Rate Notes</b>				
<b>Países Bajos</b>				
DEUTSCHE BAHN FIN FL.R 14-22 09/09Q	802,000	EUR	802,196	0.26
			<b>802,196</b>	<b>0.26</b>
<b>Noruega</b>				
DNB BANK ASA FL.R 19-22 25/01Q	14,500,000	EUR	14,507,758	4.74
			<b>14,507,758</b>	<b>4.74</b>
<b>Total de floating rate notes</b>			<b>15,309,954</b>	<b>5.00</b>
<b>Total de valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado regulado</b>			<b>192,950,904</b>	<b>63.01</b>

Las notas que acompañan a los estados financieros forman parte integrante de los mismos.  
Las diferencias en el porcentaje del Activo neto son el resultado del redondeo.





Candriam Money Market Euro AAA

Cartera de inversiones a 30 de junio de 2022

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en EUR)	% del activo neto
<b>Mercado del Tesoro</b>				
<b>Instrumentos del mercado monetario</b>				
<b>Austria</b>				
AUSTRIAN T-BILL ZCP 280722	13,000,000	EUR	13,006,474	4.25
			<b>13,006,474</b>	<b>4.25</b>
<b>Bélgica</b>				
BELGIUM TREAS BILL ZCP 140722	16,000,000	EUR	16,009,496	5.23
SOCIETE WALLONNE DU ZCP 141022	3,000,000	EUR	3,008,256	0.98
SOCIETE WALLONNE DU ZCP 200922	4,000,000	EUR	4,013,396	1.31
			<b>23,031,148</b>	<b>7.52</b>
<b>Francia</b>				
FRANCE TREASURY BILL ZCP 270722	10,000,000	EUR	10,008,282	3.27
			<b>10,008,282</b>	<b>3.27</b>
<b>Alemania</b>				
GERM TREA BILL ZCP 20-07-22	16,000,000	EUR	16,012,109	5.23
			<b>16,012,109</b>	<b>5.23</b>
<b>España</b>				
ROYAUME D SPAIN ZCP 08-07-22	13,000,000	EUR	13,004,847	4.25
			<b>13,004,847</b>	<b>4.25</b>
<b>Total Instrumentos del mercado monetario</b>			<b>75,062,860</b>	<b>24.51</b>
<b>Total Mercado del Tesoro</b>			<b>75,062,860</b>	<b>24.51</b>
<b>Organismos de inversión colectiva</b>				
<b>Acciones/Participaciones de fondos de inversión</b>				
<b>Luxemburgo</b>				
BNP PARIBAS INSTICASH EUR 1D SHORT TERM VNAV I EUR	102,201	EUR	13,979,577	4.56
			<b>13,979,577</b>	<b>4.56</b>
<b>Total de Acciones/Participaciones de fondos de inversión</b>			<b>13,979,577</b>	<b>4.56</b>
<b>Total de Organismos de inversión colectiva</b>			<b>13,979,577</b>	<b>4.56</b>
<b>Total de la cartera de inversiones</b>			<b>281,993,341</b>	<b>92.08</b>
Coste de adquisición			282,336,481	



## Candriam Money Market Euro AAA

### Distribución geográfica y económica de la cartera de inversiones a 30 de junio de 2022

#### Distribución geográfica (en % del activo neto)

Francia	24.11
Luxemburgo	16.70
Bélgica	13.08
Alemania	8.82
España	5.88
Suecia	5.88
Noruega	4.74
Austria	4.25
Australia	4.13
Países Bajos	3.53
Suiza	0.98
	<b>92.08</b>

#### Distribución económica (en % del activo neto)

Bancos y otras entidades financieras	34.95
Bonos de Estados, Provincias y municipios	34.63
Otros bienes de equipo	4.57
Fondos de inversión	4.56
Textil y prendas de vestir	3.59
Otros	3.27
Varios bienes de consumo	2.81
Internet y servicios de Internet	2.71
Alimentos y bebidas no alcohólicas	0.98
	<b>92.08</b>



Candriam Money Market USD Sustainable

Cartera de inversiones a 30 de junio de 2022

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en USD)	% del activo neto
<b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado regulado</b>				
<b>Bonos</b>				
<b>Bélgica</b>				
ENI FINANCE INTERNA ZCP 130722	5,000,000	USD	4,994,760	4.44
REGION WALLONNE ZCP 150722	3,000,000	EUR	3,137,463	2.79
			<b>8,132,223</b>	<b>7.23</b>
<b>Dinamarca</b>				
JYSKE BANK DNK ZCP 130722	5,000,000	USD	4,998,015	4.44
			<b>4,998,015</b>	<b>4.44</b>
<b>Francia</b>				
METROPOLE DE LYON ZCP 180722	3,000,000	USD	2,996,098	2.66
			<b>2,996,098</b>	<b>2.66</b>
<b>Alemania</b>				
ADIDAS AG ZCP 290722	5,000,000	EUR	5,228,665	4.65
			<b>5,228,665</b>	<b>4.65</b>
<b>Italia</b>				
INTESA SANPAOLO 3.125 17-22 14/07S	3,701,000	USD	3,701,981	3.29
			<b>3,701,981</b>	<b>3.29</b>
<b>Países Bajos</b>				
AKZO NOBEL NV ZCP 080822	1,500,000	EUR	1,569,087	1.39
IBERDROLA INT. BV ZCP 150722	4,000,000	EUR	4,183,595	3.72
WOLTERS KLUWER NV ZCP 070722	1,000,000	EUR	1,045,707	0.93
			<b>6,798,389</b>	<b>6.04</b>
<b>Estados Unidos de América</b>				
AMERICAN EXPRESS 2.500 17-22 01/07S	571,000	USD	571,006	0.51
FISERV INC ZCP 070722	3,000,000	EUR	3,138,074	2.79
FISERV INC ZCP 140722	2,000,000	EUR	2,092,004	1.86
IBM 2.625 15-22 05/08S	1,100,000	GBP	1,336,515	1.19
			<b>7,137,599</b>	<b>6.34</b>
<b>Total de bonos</b>			<b>38,992,970</b>	<b>34.65</b>
<b>Floating Rate Notes</b>				
<b>Australia</b>				
NATIONAL AUSTRALIA B FL.R 20-22 13/01Q	5,000,000	USD	4,994,875	4.44
			<b>4,994,875</b>	<b>4.44</b>
<b>Canadá</b>				
BANK OF MONTREAL FL.R 21-23 15/09S	3,157,000	USD	3,128,113	2.78
BANK OF NOVA SC FL.R 21-23 15/09Q	800,000	USD	791,242	0.70
BANK OF NOVA SCOTIA FL.R 20-23 16/09Q	4,500,000	USD	4,477,282	3.98
TORONTO DOMINION BANK FL.R 21-23 02/06Q	1,865,000	USD	1,856,212	1.65
TORONTO DOMINION BANK FL.R 21-23 06/01Q	3,274,000	USD	3,266,979	2.90
			<b>13,519,828</b>	<b>12.01</b>
<b>Francia</b>				
BPCE FL.R 18-23 12/09Q	4,200,000	USD	4,222,155	3.75
			<b>4,222,155</b>	<b>3.75</b>
<b>Luxemburgo</b>				
ABN AMRO BANK FL.R 17-22 19/07Q	5,600,000	USD	5,600,056	4.98
			<b>5,600,056</b>	<b>4.98</b>
<b>Estados Unidos de América</b>				
AMEX SOFRIND F.LR 22-24 03/05Q	1,100,000	USD	1,093,697	0.97
BFCM FL.R 17-22 20/07Q	1,700,000	USD	1,699,890	1.51
BFCM FL.R 18-23 20/07Q	1,000,000	USD	1,004,405	0.89
CITIGROUP FL.R 17-23 24/07Q	4,629,000	USD	4,625,491	4.11
MIZUHO FINANCIAL GRP FL.R 17-22 11/09Q	5,500,000	USD	5,499,615	4.89
ROYAL BANK OF CANADA FL.R 20-23 17/01Q	5,000,000	USD	4,990,250	4.43
THERMO FISHER SCIENTIF FL.R 21-23 18/04Q	5,100,000	USD	5,074,589	4.51
TOYOTA MOTOR CREDIT FL.R 21-22 14/12M	4,500,000	USD	4,495,327	3.99
			<b>28,483,264</b>	<b>25.31</b>

Las notas que acompañan a los estados financieros forman parte integrante de los mismos.  
Las diferencias en el porcentaje del Activo neto son el resultado del redondeo.



## Candriam Money Market USD Sustainable

### Cartera de inversiones a 30 de junio de 2022

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en USD)	% del activo neto
<b>Total de floating rate notes</b>			<b>56,820,178</b>	<b>50.49</b>
<b>Total de valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado regulado</b>			<b>95,813,148</b>	<b>85.15</b>
<b>Organismos de inversión colectiva</b>				
<b>Acciones/Participaciones de fondos de inversión</b>				
<b>Francia</b>				
CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV I EUR C	437	EUR	4,606,562	4.09
			<b>4,606,562</b>	<b>4.09</b>
<b>Luxemburgo</b>				
CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO Z EUR C	4,000	EUR	4,389,175	3.90
			<b>4,389,175</b>	<b>3.90</b>
<b>Total de Acciones/Participaciones de fondos de inversión</b>			<b>8,995,737</b>	<b>7.99</b>
<b>Total de Organismos de inversión colectiva</b>			<b>8,995,737</b>	<b>7.99</b>
<b>Total de la cartera de inversiones</b>			<b>104,808,885</b>	<b>93.14</b>
Coste de adquisición			105,919,395	



## Candriam Money Market USD Sustainable

### Distribución geográfica y económica de la cartera de inversiones a 30 de junio de 2022

#### Distribución geográfica (en % del activo neto)

Estados Unidos de América	31.66
Canadá	12.01
Francia	10.51
Luxemburgo	8.88
Bélgica	7.23
Países Bajos	6.04
Alemania	4.65
Australia	4.44
Dinamarca	4.44
Italia	3.29
	<b>93.14</b>

#### Distribución económica (en % del activo neto)

Bancos y otras entidades financieras	62.76
Bonos de Estados, Provincias y municipios	5.45
Internet y servicios de Internet	4.65
Textil y prendas de vestir	4.65
Electrónica y semiconductores	4.51
Fondos de inversión	3.90
Ingeniería eléctrica	3.72
Productos químicos	1.39
Suministros de oficina y ordenadores	1.19
Industria gráfica y editorial	0.93
	<b>93.14</b>



Notas a los Estados financieros - Inventario de instrumentos derivados

**Contratos de divisas a plazo**

A 30 de junio de 2022, los siguientes contratos de contratos de divisas a plazo estaban pendientes:

**Candriam Money Market USD Sustainable**

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Contraparte	Latente (en USD)
USD	3,173,297	EUR	3,001,800	07/07/2022	Nomura Financial Products Europe	34,467
USD	1,073,017	EUR	1,000,000	07/07/2022	Société Générale	27,364
USD	2,084,664	EUR	2,000,000	14/07/2022	UBS Europe SE	(7,571)
USD	3,149,703	EUR	3,000,000	15/07/2022	UBS Europe SE	11,125
USD	4,314,824	EUR	4,000,000	15/07/2022	BNP Paribas Paris	129,972
USD	1,610,806	EUR	1,500,000	08/08/2022	Société Générale	38,848
USD	8,992,456	EUR	8,610,000	13/07/2022	UBS Europe SE	(14,026)
USD	5,309,156	EUR	5,000,000	29/07/2022	Société Générale	73,180
USD	1,474,566	GBP	1,125,000	05/08/2022	UBS Europe SE	107,419
						<b>400,778</b>

Consulte la Nota 8 para las Garantías recibidas/emitidas en relación con los contratos de divisas a plazo.



## Otras notas a los estados financieros

### Nota 1 - Información general

Candriam Money Market (la «SICAV») se constituyó el 16 de noviembre de 1987 con la denominación «BIL GLOBAL FUND» como sociedad de inversión de capital variable (SICAV) con arreglo a la legislación del Gran Ducado de Luxemburgo por una duración indefinida. Su capital mínimo es de 1.250.000 euros. Sus estatutos se publicaron en el *Mémorial, Recueil des Sociétés et Associations* (el *Mémorial*) el 11 de diciembre de 1987. La SICAV está inscrita en el Registro Mercantil y de Sociedades de Luxemburgo con el número B-26803.

El 30 de mayo de 1990, la SICAV cambió su denominación por «BIL Money Market Fund», sus estatutos se modificaron y el capital pasó a denominarse en BEF. El 1 de febrero de 1999 la SICAV cambió su denominación por «Dexia Money Market». El 16 de mayo de 2014, la SICAV cambió su denominación por «Candriam Money Market».

El 27 de enero de 1999, los estatutos se modificaron y el capital pasó a denominarse en EUR y las modificaciones se publicaron en el *Mémorial*. Se depositó una versión refundida de los estatutos en el Registro Mercantil y de Sociedades de Luxemburgo. Se modificaron por última vez el 6 de julio de 2020; las modificaciones correspondientes se publicaron en el *Recueil Electronique des Sociétés et Associations*.

La SICAV está inscrita en el Registro Mercantil y de Sociedades de Luxemburgo con el número B-26803.

La SICAV y todos sus subfondos están considerados fondos del mercado monetario y han recibido la autorización de la CSSF con arreglo a las disposiciones del Reglamento sobre los FMM y, a tal efecto, están inscritos en la lista oficial de OIC como fondos del mercado monetario conforme a la Ley de 2010.

De conformidad con el Reglamento, la información siguiente está disponible al menos cada semana en el sitio web de la Sociedad Gestora, [www.candriam.com](http://www.candriam.com):

- i) el desglose por vencimiento de la cartera de valores de los subfondos;
- ii) el perfil de crédito de los subfondos;
- iii) el vencimiento medio ponderado y la vida media ponderada de los subfondos;
- iv) información detallada de las diez participaciones más importantes de cada subfondo;
- v) el valor total de los activos de los subfondos;
- vi) el rendimiento neto de los subfondos.

La Sociedad Gestora sigue muy de cerca la evolución de la situación para gestionarla en aras de los intereses de los accionistas.

Los inversores tienen a su disposición los siguientes subfondos:

<u>Subfondo</u>	<u>Divisa de referencia</u>
Candriam Money Market Euro	EUR
Candriam Money Market USD Sustainable	USD
Candriam Money Market Euro AAA	EUR

Las clases de acciones emitidas son las siguientes:

- La **clase Classique (clase C)** está disponible para personas físicas y jurídicas.
- La **clase I** está reservada exclusivamente para inversores institucionales.
- La **clase R** está reservada para intermediarios financieros (incluidos distribuidores y plataformas) que:
  - tienen disposiciones por separado con sus clientes para la prestación de servicios de inversión en relación con el subfondo; y
  - como resultado de sus leyes y normativas aplicables o en virtud de los acuerdos con sus clientes, no tienen derecho a aceptar y retener derechos, comisiones y otros beneficios monetarios de la Sociedad Gestora en relación con la prestación de los servicios de inversión arriba mencionados.
- La **clase R2** está reservada:
  - para distribuidores y/o intermediarios autorizados por la Sociedad Gestora que no reciben por las inversiones en esta clase ningún tipo de remuneración de una entidad del grupo Candriam, cuando las inversiones finales en las acciones se realizan en el marco de un mandato;
  - a los OIC aprobados por la Sociedad Gestora.
- La **clase S** está reservada exclusivamente para inversores institucionales autorizados de manera específica por la Sociedad Gestora y su suscripción inicial mínima es de 100.000.000 EUR. Este mínimo podrá ser modificado a discreción del Consejo de Administración, siempre y cuando se garantice un trato igualitario a los accionistas en cualquier día de valoración.
- La **clase V** está reservada exclusivamente para inversores institucionales; la suscripción inicial mínima es de 30.000.000 EUR. Este mínimo podrá ser modificado a discreción del Consejo de Administración, siempre y cuando se garantice un trato igualitario a los accionistas en el mismo día de valoración.
- La **clase Z** está reservada:
  - a inversores institucionales/profesionales autorizados por la Sociedad Gestora. Puesto que la actividad de gestión de carteras para esta clase se remunera directamente a través del contrato celebrado con el inversor, no se cobra ninguna comisión de gestión de carteras por los activos de esta clase;
  - para OIC autorizados por la Sociedad Gestora y gestionados por una entidad del grupo Candriam.



## Otras notas a los estados financieros

### Nota 1 - Información general (continuación)

Además, podrá aplicarse un proceso de cobertura de divisas a las clases de acciones:

- Clases de acciones cubiertas en la divisa de referencia:

son clases de acciones cubiertas que tratan de reducir el efecto de las fluctuaciones del tipo de cambio entre la divisa de referencia del subfondo y la divisa en la que está denominada la clase de acciones cubierta.

Con este tipo de cobertura se pretende que la rentabilidad de la clase de acciones cubierta sea razonablemente equiparable (tras ajustar la diferencia de los tipos de interés entre las dos divisas) a la rentabilidad de una clase de acciones denominada en la divisa de referencia del subfondo. Este tipo de cobertura se identifica añadiendo el sufijo «H» al nombre de la clase de acciones.

- Clases de acciones cubiertas por activos:

estas clases de acciones pretenden reducir el efecto de las fluctuaciones del tipo de cambio entre las divisas en las que se mantienen las inversiones de un subfondo y la divisa de la clase de acciones cubierta. Este tipo de cobertura se identifica añadiendo el sufijo AH al nombre de la clase de acciones.

### Nota 2 - Principales métodos contables

Los estados financieros de la SICAV son elaborados conforme a la normativa en vigor en Luxemburgo relativa a los organismos de inversión colectiva. Es posible que aparezcan pequeñas discrepancias en algunos totales o subtotales de los estados financieros debido a las reglas de redondeo.

Los valores liquidativos empleados a efectos de los estados financieros son a 30 de junio de 2022.

Subfondos Candriam Money Market Euro y Candriam Money Market USD Sustainable: el valor liquidativo de cada subfondo se calculó el 5 de julio de 2022 a partir de los últimos precios conocidos en el momento de la valoración.

Subfondo Candriam Money Market Euro AAA: el valor liquidativo del subfondo se calculó el 30 de junio de 2022 a partir de los últimos precios conocidos en el momento de la valoración.

#### a) Valoración de la cartera de cada subfondo

La valoración de cualquier admitido a negociación en una bolsa oficial o en cualquier otro mercado organizado, de funcionamiento regular, reconocido y abierto al público, se basará en la última cotización conocida en Luxemburgo el día de valoración y, si dicho valor se negocia en varios mercados, se basará en la última cotización conocida del mercado principal de este valor. Si la última cotización conocida no es representativa, la valoración se basará en el valor probable de realización que el Consejo de Administración estime con prudencia y buena fe. Los valores que no coticen o no se negocien en bolsa o en cualquier otro mercado regulado, de funcionamiento regular, reconocido y abierto al público, se valorarán en función del valor probable de realización estimado con prudencia y buena fe. Los Consejeros deberán valorar cualesquiera otros activos en función del valor probable de realización, que deberá estimarse de buena fe y con arreglo a los principios y los procedimientos generalmente admitidos.

#### b) Ganancias o pérdidas materializadas netas de ventas de inversiones

Los beneficios o las pérdidas realizados(as) sobre las ventas de las inversiones de cada subfondo se calculan a partir del coste medio de las inversiones vendidas.

#### c) Conversión de divisas

Los valores expresados en una moneda distinta a la de referencia de cada subfondo se convierten a dicha moneda al tipo de cambio vigente en la fecha de cierre.

Los ingresos y gastos en una moneda distinta a la de referencia de cada subfondo se convierten a dicha moneda a los tipos de cambios vigentes en la fecha de la transacción.

El coste de adquisición de valores en cada subfondo expresado en una moneda distinta a la de referencia del subfondo se convierte a dicha moneda a los tipos de cambio vigentes en el día de la compra.

Tipos de cambio utilizados a 30 de junio de 2022:

Para los subfondos Candriam Money Market Euro y Candriam Money Market USD Sustainable:

1 EUR =	1.348550 CAD	1 EUR =	7.436650 DKK	1 EUR =	142.029650 JPY	1 EUR =	1.045450 USD
1 EUR =	1.000900 CHF	1 EUR =	0.860800 GBP	1 EUR =	10.713150 SEK		

Para el subfondo Candriam Money Market Euro AAA:

1 EUR =	0.998350 CHF	1 EUR =	7.439800 DKK	1 EUR =	0.864500 GBP	1 EUR =	1.047850 USD
---------	--------------	---------	--------------	---------	--------------	---------	--------------

#### d) Valoración de los contratos de divisas a plazo

Los contratos de divisas a plazo se valoran a los tipos de cambio a plazo vigentes en la fecha de cierre y aplicables para el periodo restante hasta el vencimiento. La plusvalía/(minusvalía) latente de contratos de divisas a plazo se indica en el estado del activo neto en «Plusvalía/(minusvalía) latente neta de contratos de divisas a plazo».

Las ganancias/(pérdidas) materializadas y la variación de la plusvalía/(minusvalía) latente que resulte de estas se incluyen en el estado de variación patrimonial, en «Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de contratos de divisas a plazo» y «Variación de la plusvalía/minusvalía latente neta de contratos de divisas a plazo», respectivamente.

Para información detallada sobre los contratos de divisas a plazo pendientes, en su caso, consulte el apartado «Notas a los Estados financieros - Inventario de instrumentos derivados».





## Otras notas a los estados financieros

### Nota 2 - Principales políticas contables (continuación)

#### e) Gastos de operaciones

En el periodo cerrado a 30 de junio de 2022, la SICAV incurrió en costes de transacción y gastos de corretaje relacionados con la compra y venta de valores mobiliarios, instrumentos del mercado monetario, otros activos admisibles e instrumentos derivados. Dichos gastos se incluyen en el Estado de variación patrimonial, en «Costes de transacción».

#### f) Ingresos

Los ingresos por intereses se devengan de acuerdo con las condiciones de la inversión subyacente. Los ingresos se registran netos de las respectivas retenciones fiscales, en su caso. Los dividendos se reconocen en la fecha *ex dividendo*.

#### g) Abreviaturas utilizadas en la cartera de valores:

FL.R: Obligaciones de tipo variable  
ZCP: Cupón cero  
Q: Trimestral  
A: Anual  
S: Semestral

### Nota 3 - Comisión por la emisión de acciones de la SICAV

Las acciones de todos los subfondos se emitirán a un precio correspondiente al valor liquidativo por acción del respectivo subfondo, aumentado por una comisión de entrada del 0,50% como máximo que se abonará a los agentes de venta. Las acciones de todos los subfondos se recomprarán al valor liquidativo por acción. Los estatutos prevén que las acciones de cada clase no podrán emitirse a un precio inferior al valor de su activo neto por acción.

### Nota 4 - Comisiones de gestión

Candriam Luxembourg (en adelante, la «Sociedad Gestora»), sociedad limitada por acciones de derecho luxemburgués con domicilio social en SERENITY - Bloc B, 19-21, Route d'Arlon à L-8009 Strassen, se constituyó en Luxemburgo el 10 de julio de 1991 y ha sido designada Sociedad Gestora de la SICAV en virtud de contrato suscrito entre la SICAV y Candriam Luxembourg.

Candriam Luxembourg, sociedad limitada por acciones, recibió la autorización de la Sociedad Gestora en virtud del capítulo 15 de la Ley de 2010 y está autorizada a desarrollar las actividades de gestión colectiva de carteras, de gestión de carteras de valores y de asesoramiento de inversión. Sus estatutos fueron modificados por última vez el día 19 de mayo de 2016 y los cambios correspondientes fueron publicados en el *Mémorial C, Recueil des Sociétés et Associations*. Se depositó en el Registro Mercantil y de Sociedades de Luxemburgo una versión de los estatutos actualizados.

Candriam Luxembourg es filial de Candriam Group, entidad de New York Life Insurance Company Group. Es responsable de las actividades de gestión de carteras, de administración (agente administrativo, agente de transferencias y registrador) y de comercialización (distribución).

La función de gestión de carteras de todos los subfondos se encuentra delegada en: Candriam Belgium, 58, Avenue des Arts, B-1000 Bruselas.

Como remuneración por su actividad de gestión de la cartera, la Sociedad Gestora percibirá una comisión de gestión expresada como porcentaje anual del valor liquidativo medio de cada subfondo de la SICAV, según la información que aquí se recoge. Estas comisiones se abonan mensualmente.

En caso de los servicios que se prestan para parte de un mes, la Sociedad Gestora percibe comisiones *pro rata temporis*.

Los tipos en vigor a 30 de junio de 2022 son:

Subfondos	Clase de acciones	Tipo de acciones	ISIN	Comisión de gestión
Candriam Money Market Euro	C	Capitalización	LU0093583077	0.50%
	C	Distribución	LU0093583234	0.50%
	I	Capitalización	LU0206982331	0.10%
	R	Capitalización	LU0936337848	0.10%
	R2	Distribución	LU1389877876	0.13%
	V	Capitalización	LU0323048693	0.05%
	Z	Capitalización	LU0391999124	0.00%
Candriam Money Market Euro AAA	C	Capitalización	LU0354091653	0.05%
	C	Distribución	LU0354091737	0.05%
	I	Capitalización	LU0354091901	0.04%
	I	Distribución	LU0354127358	0.04%
	R	Capitalización	LU0936338655	0.04%
	V	Capitalización	LU0354092115	0.03%
	V	Distribución	LU0354092206	0.03%
	Z	Capitalización	LU0391999470	0.00%



## Otras notas a los estados financieros

### Nota 4 - Comisiones de gestión (continuación)

Candriam Money Market USD Sustainable	C	Capitalización	LU0049341216	0.30%
	C	Distribución	LU0094032728	0.30%
	I	Capitalización	LU0206982414	0.15%
	I	Distribución	LU0355214700	0.15%
	V	Capitalización	LU0323048347	0.06%
	Z	Capitalización	LU0391999553	0.00%

La siguiente tabla muestra los tipos anuales de la comisión de gestión máximos aplicados a 30 de junio de 2022 a los OICVM en que invierte Candriam Money Market.

Fondo objetivo	Tipo máximo
Candriam Monétaire SICAV V EUR C	0.15%
Candriam Sustainable Money Market Euro V EUR C	0.06%
BNP Paribas Instacash EUR 1D Short Term VNAV I EUR	0.00%
Candriam Monétaire SICAV I EUR C	0.20%
Candriam Sustainable Money Market Euro Z EUR C	0.00%

### Nota 5 - Gastos operativos y administrativos

La SICAV se hace cargo de los gastos operativos y administrativos corrientes para cubrir todos los gastos generales y variables, las tasas, los honorarios y otros gastos, según se definen a continuación («Gastos operativos y administrativos»).

Los Gastos operativos y administrativos comprenden, entre otros, los gastos siguientes:

a) los gastos en que incurra directamente la SICAV, incluidos, entre otros, las comisiones y los cargos del depositario, las comisiones y los gastos de los auditores independientes autorizados, los gastos de cobertura de las acciones, incluidos los facturados por la Sociedad Gestora, los honorarios abonados al Consejo de Administración y los gastos y los costes razonables en que incurra el Consejo de Administración o en que se incurra por sus miembros;

b) una «comisión de servicio», que se abona a la Sociedad Gestora y que incluye el importe pendiente de los Gastos operativos y administrativos una vez deducidos los gastos que se indican anteriormente en el apartado (a), a saber, entre otros, las comisiones y los gastos del agente domiciliario, el agente administrativo, el agente de transferencias y registrador y el agente de pagos principal, los costes asociados al registro y el mantenimiento de dicho registro en todas las jurisdicciones (como las comisiones cobradas por las autoridades de supervisión correspondientes, los gastos de traducción y la remuneración de los representantes en el extranjero y los agentes de pagos locales), los costes de publicación de las cotizaciones, los gastos postales y de comunicaciones, los gastos de elaboración, de impresión, de traducción y de distribución de los folletos, de los documentos de datos fundamentales para el inversor, de las notificaciones para los accionistas, de los informes financieros y de cualquier otro documento destinado a los accionistas, los honorarios y los gastos jurídicos, los cargos y los gastos relacionados con la suscripción de cualquier abono/licencia o cualquier otro uso de información o datos de pago, los gastos derivados del uso de una marca comercial registrada por la SICAV, los gastos y las comisiones que pagar a la Sociedad Gestora y/o sus delegados y/o cualquier otro agente designado por la SICAV misma y/o expertos independientes.

Los Gastos operativos y administrativos se expresan como porcentaje anual del valor liquidativo medio de cada clase de acciones.

Al final de un periodo dado, si los cargos y los gastos reales fueran superiores el porcentaje de los Gastos operativos y administrativos fijado para una clase de acciones, la Sociedad Gestora abonaría la diferencia. Y, a la inversa, si los cargos y los gastos reales fueran inferiores al porcentaje de los Gastos operativos y administrativos fijado para una clase de acciones, la Sociedad Gestora se quedaría con la diferencia.

La Sociedad Gestora tendrá derecho a dar instrucciones a la SICAV para que proceda a liquidar de forma total o parcial los gastos mencionados directamente a partir de sus activos.

En ese caso, la cantidad de los Gastos operativos y administrativos se reducirá según corresponda.

Se pagarán mensualmente.

Los máximo tipos en vigor a 30 de junio de 2022 son:

Subfondos	Clase de acciones	Tipo de acciones	ISIN	Fondo máximo
Candriam Money Market Euro	C	Capitalización	LU0093583077	0.30%
	C	Distribución	LU0093583234	0.30%
	I	Capitalización	LU0206982331	0.17%
	R	Capitalización	LU0936337848	0.30%
	R2	Distribución	LU1389877876	0.30%
	V	Capitalización	LU0323048693	0.17%
	Z	Capitalización	LU0391999124	0.17%
Candriam Money Market Euro AAA	C	Capitalización	LU0354091653	0.30%
	C	Distribución	LU0354091737	0.30%
	I	Capitalización	LU0354091901	0.17%
	I	Distribución	LU0354127358	0.17%
	R	Capitalización	LU0936338655	0.30%
	V	Capitalización	LU0354092115	0.17%
	V	Distribución	LU0354092206	0.17%
Z	Capitalización	LU0391999470	0.17%	



## Otras notas a los estados financieros

### Nota 5 - Gastos operativos y administrativos (continuación)

Candriam Money Market USD Sustainable	C	Capitalización	LU0049341216	0.25%
	C	Distribución	LU0094032728	0.25%
	I	Capitalización	LU0206982414	0.16%
	I	Distribución	LU0355214700	0.16%
	V	Capitalización	LU0323048347	0.16%
	Z	Capitalización	LU0391999553	0.16%

### Nota 6 - Impuesto de suscripción

La SICAV se rige por la legislación fiscal de Luxemburgo. En virtud de la legislación y de la normativa en vigor en la actualidad, la SICAV está sujeta en Luxemburgo a un impuesto anual del 0,01%, pagadero trimestralmente y calculado a partir del valor liquidativo de la SICAV al final de cada trimestre. Este tipo quedará reducido al 0% en el caso de las clases reservadas para inversores institucionales.

No se deberá ningún impuesto de suscripción (*taxe d'abonnement*) sobre los activos que la SICAV mantenga en participaciones de otros OICVM ya sometidos a dicho impuesto en Luxemburgo.

El Gobierno belga ha promulgado una ley que contempla la tributación una vez al año del valor liquidativo de los fondos de inversión extranjeros registrados en Bélgica. Este impuesto anual se calcula sobre los importes netos invertidos en Bélgica por los intermediarios financieros belgas. En ausencia de declaración suficiente relativa a estas cantidades, la administración tributaria podrá calcular el impuesto sobre la totalidad de los activos de estos subfondos. La ley belga del 17 de junio de 2013, que comprende disposiciones fiscales y financieras y disposiciones relativas al desarrollo sostenible, fijó el tipo del impuesto anual para los organismos de inversión colectiva en el 0,0925% con efecto a partir del 1 de enero de 2014.

Como medida cautelar, la SICAV presentó una reclamación ante la autoridad fiscal belga y el Tribunal de Primera Instancia de Bruselas para que se le devolviera el impuesto. Actualmente no es posible prejuzgar el resultado del litigio ni el eventual reembolso a favor de la SICAV. En un caso similar, el Estado belga recurrió ante el Tribunal de Casación las sentencias del Tribunal de Apelación a favor del demandante. La sociedad gestora fue informada de que el Tribunal de Casación falló en contra del demandante el 25 de marzo de 2022. El Tribunal de Casación (sala francófona) considera que el Tribunal de Apelación de Bruselas calificó erróneamente el impuesto de suscripción belga como impuesto sobre el patrimonio amparado por el convenio de doble imposición entre Bélgica y Luxemburgo (dicho convenio atribuye el derecho a gravar las SICAV luxemburguesas únicamente a Luxemburgo y no a Bélgica, lo que justificaba la demanda de reembolso del impuesto de suscripción belga).

El asunto se devuelve al Tribunal de Apelación de Lieja, que quedará vinculado por la decisión adoptada por el Tribunal de Casación.

Otra decisión del Tribunal de Casación (sala neerlandesa) de 21 de abril de 2022 no rebate que el impuesto de suscripción belga sea un impuesto sobre el patrimonio, pero considera que el convenio de doble imposición entre Bélgica y Luxemburgo (a diferencia del firmado con los Países Bajos) no incluye en su ámbito de aplicación un impuesto sobre el patrimonio recaudado en Bélgica.

Por consiguiente, las perspectivas de devolución son limitadas y, en cualquier caso, no serán posibles a corto plazo.

### Nota 7 - Depósitos a plazo

#### Candriam Money Market Euro AAA

Contraparte	Fecha de	Importe (en EUR)
KBC BANK NV BRUXELLES	30/06/2022	9,500,000

### Nota 8 - Garantía

En relación con los instrumentos derivados OTC, se ha recibido efectivo como garantía de BNP Paribas y UBS Europe SE:

Subfondos	Divisa	Garantía en efectivo pagada	Garantía en efectivo mantenida
Candriam Money Market USD Sustainable	USD	0	140,000

### Nota 9 - Cambios en la composición de la cartera

En el domicilio social de la SICAV está disponible de forma gratuita un listado de las transacciones (compras y ventas) en las carteras de inversiones.

### Nota 10 - Hechos posteriores al cierre

Con efecto a partir del 1 de julio de 2022 (la «Fecha efectiva»), Candriam Luxembourg ha absorbido sus filiales Candriam Belgium y Candriam France mediante una fusión por absorción luxemburguesa con arreglo al artículo 1021-1 (y siguientes) de la Ley de sociedades mercantiles de Luxemburgo de 10 de agosto de 1915, en su versión modificada. A partir de la Fecha efectiva, Candriam Luxembourg ha pasado a denominarse Candriam.



## Información adicional

### **Exposición global de riesgo**

De conformidad con la Circular 11/512 de la CSSF, el Consejo de Administración de la Sociedad debe determinar el método de gestión de riesgos de la Sociedad, ya sea mediante el enfoque de los compromisos o el enfoque del VaR.

El Consejo de Administración de la Sociedad ha optado por adoptar el planteamiento de compromiso como método para determinar el riesgo global para todos los subfondos de la Sociedad.

### **Voto mediante representación**

#### **Políticas de implicación y voto, ejercicio de los derechos de voto**

La Sociedad Gestora no ejerce derechos de voto de los fondos considerados.

Para todas las cuestiones relacionadas con la implicación, nos remitimos a la política de implicación y los informes relacionados, disponibles todos ellos en el sitio web de Candriam:

[www.candriam.com/en/professional/market-insights/sri-publications](http://www.candriam.com/en/professional/market-insights/sri-publications).