



Informe semestral sin auditar
Candriam Money Market

30 de junio de 2024



Candriam Money Market

SICAV de derecho luxemburgués

Informe semestral sin auditar correspondiente al periodo
del 1 de enero de 2024 al 30 de junio de 2024



Índice

Administración de la SICAV	4
Detalles de la SICAV	5
Estado del activo neto a 30 de junio de 2024	6
Estado de variación patrimonial del periodo cerrado a 30 de junio de 2024	8
Estadísticas	10
Cartera de inversiones a 30 de junio de 2024	11
Candriam Money Market Euro	11
Candriam Money Market Euro AAA	15
Candriam Money Market USD Sustainable	18
Notas a los estados financieros - Inventario de instrumentos derivados	21
Otras notas a los estados financieros	22
Información adicional sin auditar	28



Administración de la SICAV

Consejo de Administración

Presidente

Jean-Yves MALDAGUE
Managing Director
Candriam

Consejeros

Annemarie ARENS
Independent Director

Thierry BLONDEAU
Independent Director

Tanguy DE VILLENFAGNE
Advisor to the Group Strategic Committee
Candriam

Damien ROL
Deputy Global Head of Legal
Candriam

Myriam VANNESTE
Global Head of Product Management
Candriam

Domicilio social

5, Allée Scheffer
L-2520 Luxemburgo

Depositario

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

Sociedad Gestora

Candriam
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 las actividades de **Gestión de carteras** la realiza Candriam y/o una o varias de sus sucursales:

Candriam - Belgian Branch
58, Avenue des Arts
B-1000 Bruselas

Candriam Succursale française
40, rue Washington
F-75408 Paris Cedex 08

Candriam – UK Establishment
Aldersgate Street 200, Londres EC1A 4 HD

Réviseur d'entreprises agréé

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.

Los avisos de convocatoria de las juntas generales se enviarán a todos los titulares de acciones registradas, a la dirección que conste en el registro de accionistas, por lo menos ocho días antes de la junta general. 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 quórum 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, los documentos de datos fundamentales para los productos de inversión minorista empaquetados y productos de inversión basados en seguros (PRIIP KID), 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 2024

		Candriam Money Market Euro	Candriam Money Market Euro AAA	Candriam Money Market USD Sustainable
		EUR	EUR	USD
Activo				
Cartera de inversiones al valor de mercado	2a	1,351,700,682	946,833,123	146,410,839
Efectivo en bancos e intermediarios financieros		122,416,380	67,736,607	11,934,895
Importe por cobrar de inversiones vendidas		0	8,875,958	0
Importe por cobrar de suscripciones		20,636,808	0	59,639
Intereses y dividendos por cobrar, netos		12,739,475	10,300,640	1,545,819
Plusvalía latente neta de contratos de divisas a plazo	2e	989,407	743,273	48,448
Total activo		1,508,482,752	1,034,489,601	159,999,640
Pasivo				
Importe por pagar por inversiones adquiridas		14,950,786	34,989,503	10,277,623
Acreedores por reembolsos		3,949,444	0	20,000
Comisiones de gestión por pagar	3	297,112	116,810	26,897
Gastos operativos y administrativos por pagar	4	77,799	50,644	7,739
Impuesto de suscripción por pagar	5	107,411	0	9,334
Total pasivo		19,382,552	35,156,957	10,341,593
Total del activo neto		1,489,100,200	999,332,644	149,658,047



Estado del activo neto a 30 de junio de 2024

		Combinado
		EUR
Activo		
Cartera de inversiones al valor de mercado	2a	2,435,142,939
Efectivo en bancos e intermediarios financieros		201,288,882
Importe por cobrar de inversiones vendidas		8,875,958
Importe por cobrar de suscripciones		20,692,454
Intereses y dividendos por cobrar, netos		24,482,447
Plusvalía latente neta de contratos de divisas a plazo	2e	1,777,885
Total activo		2,692,260,565
Pasivo		
Importe por pagar por inversiones adquiridas		59,529,860
Acreedores por reembolsos		3,968,105
Comisiones de gestión por pagar	3	439,018
Gastos operativos y administrativos por pagar	4	135,664
Impuesto de suscripción por pagar	5	116,120
Total pasivo		64,188,767
Total del activo neto		2,628,071,798



Estado de variación patrimonial del periodo cerrado a 30 de junio de 2024

		Candriam Money Market Euro	Candriam Money Market Euro AAA	Candriam Money Market USD Sustainable
		EUR	EUR	USD
Activo neto al inicio del periodo		1,476,445,613	1,267,667,803	144,481,404
Ingresos				
Intereses netos de bonos e instrumentos del mercado monetario	2g	25,317,868	18,408,319	2,695,956
Intereses bancarios	2g	2,483,895	3,887,963	370,736
Otros ingresos		1,345	8,944	99
Total ingresos		27,803,108	22,305,226	3,066,791
Gastos				
Comisiones de gestión	3	1,806,888	662,184	163,279
Gastos operativos y administrativos	4	465,474	310,430	45,379
Comisiones del depositario	4	33,487	26,401	3,529
Impuesto de suscripción	5	112,946	0	13,501
Intereses bancarios		24,103	9,518	3,197
Otros gastos		3,264	0	0
Total gastos		2,446,162	1,008,533	228,885
Ingresos/(Pérdidas) netos(as) de las inversiones		25,356,946	21,296,693	2,837,906
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de ventas de inversiones	2b	1,777,731	1,477,538	850,229
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de contratos de divisas a plazo	2e	3,430,605	1,094,610	706,798
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de divisas		(2,229,405)	(1,271,603)	(362,011)
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas		28,335,877	22,597,238	4,032,922
Variación de la plusvalía/minusvalía latente neta de inversiones	2a	(1,117,622)	(244,085)	(637,724)
Variación de la plusvalía/minusvalía latente neta de contratos de divisas a plazo	2e	2,193,608	484,749	654,408
Aumento/(Disminución) neto/a del activo neto resultante de operaciones		29,411,863	22,837,902	4,049,606
Evolución del capital				
Suscripciones de acciones		1,480,937,683	3,002,166,112	115,687,223
Reembolsos de acciones		(1,494,970,929)	(3,292,947,263)	(113,771,593)
Dividendos pagados	6	(2,724,030)	(391,910)	(788,593)
Conversión de divisas		0	0	0
Activo neto al final del periodo		1,489,100,200	999,332,644	149,658,047



Estado de variación patrimonial del periodo cerrado a 30 de junio de 2024

		Combinado
		EUR
Activo neto al inicio del periodo		2,874,907,246
Ingresos		
Intereses netos de bonos e instrumentos del mercado monetario	2g	46,241,658
Intereses bancarios	2g	6,717,774
Otros ingresos		10,381
Total ingresos		52,969,813
Gastos		
Comisiones de gestión	3	2,621,420
Gastos operativos y administrativos	4	818,245
Comisiones del depositario	4	63,181
Impuesto de suscripción	5	125,543
Intereses bancarios		36,604
Otros gastos		3,264
Total gastos		3,668,257
Ingresos/(Pérdidas) netos(as) de las inversiones		49,301,556
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de ventas de inversiones	2b	4,048,578
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de contratos de divisas a plazo	2e	5,184,695
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de divisas		(3,838,784)
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas		54,696,045
Variación de la plusvalía/minusvalía latente neta de inversiones	2a	(1,956,738)
Variación de la plusvalía/minusvalía latente neta de contratos de divisas a plazo	2e	3,288,955
Aumento/(Disminución) neto/a del activo neto resultante de operaciones		56,028,262
Evolución del capital		
Suscripciones de acciones		4,591,046,154
Reembolsos de acciones		(4,894,073,166)
Dividendos pagados	6	(3,851,739)
Conversión de divisas		4,015,038
Activo neto al final del periodo		2,628,071,798



Estadísticas

Candriam Money Market Euro

Nombre	ISIN	Tipo de acciones	Divisa	Número de acciones en circulación	Valor liquidativo por acción a 30/06/2024	Valor liquidativo por acción a 31/12/2023	Valor liquidativo por acción a 31/12/2022
Total del activo neto			EUR		1,489,100,200	1,476,445,613	1,731,332,326
C	LU0093583077	Capitalización	EUR	1,011,459.81	532.55	523.06	508.21
C	LU0093583234	Distribución	EUR	152,403.37	362.54	363.10	353.18
I	LU0206982331	Capitalización	EUR	494,027.94	572.94	561.80	543.99
R	LU0936337848	Capitalización	EUR	89,603.71	103.32	101.32	98.13
R2	LU1389877876	Distribución	EUR	564,364.46	152.16	152.02	147.14
V	LU0323048693	Capitalización	EUR	446,990.39	1,063.46	1,042.05	1,007.46
Z	LU0391999124	Capitalización	EUR	38,945.87	1,069.71	1,047.87	1,012.59

Candriam Money Market Euro AAA

Nombre	ISIN	Tipo de acciones	Divisa	Número de acciones en circulación	Valor liquidativo por acción a 30/06/2024	Valor liquidativo por acción a 31/12/2023	Valor liquidativo por acción a 31/12/2022
Total del activo neto			EUR		999,332,644	1,267,667,803	390,766,206
C	LU0354091653	Capitalización	EUR	906,758.43	106.78	104.95	102.07
C	LU0354091737	Distribución	EUR	378.37	102.83	103.02	100.19
I	LU0354091901	Capitalización	EUR	284,931.30	1,098.47	1,077.91	1,044.77
I	LU0354127358	Distribución	EUR	21,875.07	1,056.95	1,057.05	1,024.78
R	LU0936338655	Capitalización	EUR	9,669.71	157.28	154.35	149.63
V	LU0354092115	Capitalización	EUR	396,890.48	1,102.64	1,081.68	1,047.48
V	LU0354092206	Distribución	EUR	1.00	1,068.32	1,067.78	1,033.03
Z	LU0391999470	Capitalización	EUR	114,632.80	1,109.75	1,088.23	1,053.29

Candriam Money Market USD Sustainable

Nombre	ISIN	Tipo de acciones	Divisa	Número de acciones en circulación	Valor liquidativo por acción a 30/06/2024	Valor liquidativo por acción a 31/12/2023	Valor liquidativo por acción a 31/12/2022
Total del activo neto			USD		149,658,047	144,481,404	103,579,075
C	LU0049341216	Capitalización	USD	56,568.90	599.05	585.04	557.70
C	LU0094032728	Distribución	USD	25,075.96	381.08	388.87	371.35
I	LU0206982414	Capitalización	USD	73,945.66	627.96	612.23	581.64
I	LU0355214700	Distribución	USD	13,667.80	570.14	580.59	552.04
V	LU0323048347	Capitalización	USD	1.00	1,218.96	1,187.47	1,126.31
Z	LU0391999553	Capitalización	USD	42,391.06	1,226.34	1,194.46	1,132.56



Candriam Money Market Euro

Cartera de inversiones a 30 de junio de 2024

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en EUR)	% del activo neto
Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado regulado				
Bonos				
Australia				
0638630NATIONAL ZCP 151024	13,000,000	EUR	12,751,154	0.86
NATIONAL AUSTR 0.3 081124	20,000,000	EUR	20,004,268	1.34
			32,755,422	2.20
Bélgica				
AEDIFICA NV/SA ZCP 050924	4,000,000	EUR	3,961,104	0.27
AEDIFICA NV/SA ZCP 160924	3,000,000	EUR	2,970,284	0.20
AEDIFICA NV/SA ZCP 240924	3,000,000	EUR	2,970,983	0.20
AEDIFICA NV/SA ZCP 300924	5,000,000	EUR	4,950,564	0.33
COFINIMMO SA ZCP 060924	10,000,000	EUR	9,906,983	0.67
COFINIMMO SA ZCP 080724	5,000,000	EUR	4,952,285	0.33
COFINIMMO SA ZCP 130824	5,000,000	EUR	4,952,951	0.33
PROXIMUS SA ZCP 230924	10,000,000	EUR	9,906,106	0.67
REGION WALLONNE ZCP 010724	5,000,000	EUR	4,986,499	0.33
REGION WALLONNE ZCP 010824	10,000,000	EUR	9,968,540	0.67
			59,526,299	4.00
Canadá				
BANK OF MONTREAL LDN FL.R 12-11-24	15,000,000	EUR	15,001,890	1.01
BANK OF MONTREAL LDN FL.R 12-11-24	15,000,000	EUR	15,004,675	1.01
			30,006,565	2.02
Dinamarca				
JYSKE BANK DNK 0.3 190924	15,000,000	EUR	15,005,696	1.01
NYKREDIT REALKREDIT 0.1250 19-24 10/07A	7,000,000	EUR	6,994,330	0.47
			22,000,026	1.48
Finlandia				
NORDEA BANK ABP 0.0 181124	20,000,000	EUR	20,004,028	1.34
			20,004,028	1.34
Francia				
AEGIDE ZCP 170724	8,000,000	EUR	7,977,312	0.54
ALLIANZ BQ 0.23 061224	5,000,000	EUR	4,997,919	0.34
ALLIANZ BQ 0.23 210325	10,000,000	EUR	9,996,595	0.67
ALLIANZ BQ 0.23 220525	5,000,000	EUR	4,999,023	0.34
ALLIANZ BQ 0.23 221124	5,000,000	EUR	4,997,981	0.34
ALLIANZ BQ 0.23 230125	5,000,000	EUR	4,997,911	0.34
ALLIANZ BQ 0.23 251024	5,000,000	EUR	4,998,165	0.34
ALLIANZ BQ 0.24 060625	4,000,000	EUR	3,999,794	0.27
ALLIANZ BQ 0.25 240625	5,000,000	EUR	4,999,490	0.34
BPCE (ISSUER) 0.32 111024	15,000,000	EUR	15,003,161	1.01
BPCE SA ZCP 170425	35,000,000	EUR	33,756,750	2.27
BQ POSTALE ZCP 17-04-25	37,000,000	EUR	35,727,987	2.40
BROKERFR2 0.23 010724	5,000,000	EUR	5,000,000	0.34
CMCIFRPA 0.3 190724	10,000,000	EUR	10,000,524	0.67
CMCIFRPA 0.3 230824	8,000,000	EUR	8,001,033	0.54
CMCIFRPA 0.32 191124	8,000,000	EUR	8,001,878	0.54
CMCIFRPA 0.32 300824	15,000,000	EUR	15,002,575	1.01
ICADE SA ZCP 040924	2,500,000	EUR	2,476,267	0.17
LA BQUE POST 0.25 250225	5,000,000	EUR	5,001,978	0.34
SOCIETE FONCIERE LYO ZCP 250724	5,000,000	EUR	4,952,636	0.33
STE FONCIERE LYONNAISE 1.50 18-25 29/05A	1,500,000	EUR	1,467,555	0.10
			196,356,534	13.19
Alemania				
CONTINENTAL AG ZCP 240724	10,000,000	EUR	9,972,305	0.67
			9,972,305	0.67
Irlanda				
CRH FINANCE DAC ZCP 190724	13,000,000	EUR	12,875,944	0.86
JOHNSON CONTROLS INT ZCP 260824	4,000,000	EUR	3,962,305	0.27

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 2024

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en EUR)	% del activo neto
			16,838,249	1.13
Italia				
SNAM SPA ZCP 110924	20,000,000	EUR	19,819,567	1.33
			19,819,567	1.33
Japón				
GOVERNMENT OF JAPAN ZCP 170924	5,000,000,000	JPY	29,000,477	1.95
JAPAN TREASURY DISC ZCP 220724	2,500,000,000	JPY	14,500,369	0.97
			43,500,846	2.92
Luxemburgo				
DH EUROPE FINANCE II ZCP 010824	20,500,000	EUR	20,299,638	1.36
DH EUROPE FINANCE II ZCP 200924	8,000,000	EUR	7,925,502	0.53
DH EUROPE FINANCE II ZCP 240724	8,500,000	EUR	8,419,473	0.57
			36,644,613	2.46
Países Bajos				
AKZO NOBEL NV ZCP 160824	12,000,000	EUR	11,881,097	0.80
BNP PARIBAS 1.125 19-24 28/08A	1,100,000	EUR	1,095,353	0.07
COOPERATIEVE RABOBANK 0.28 081124	20,000,000	EUR	20,003,659	1.34
COOPERATIEVE RABOBANK 0.31 180724	10,000,000	EUR	10,000,122	0.67
			42,980,231	2.89
Noruega				
DNB BANK A OISEST 08-11-24	20,000,000	EUR	20,009,303	1.34
			20,009,303	1.34
España				
AMADEUS IT GROUP ZCP 151124	8,000,000	EUR	7,847,059	0.53
CAIXABANK SA 0.625 19-24 01/10A	6,800,000	EUR	6,746,926	0.45
			14,593,985	0.98
Suecia				
ASSA ABLOY FIN. SERV ZCP 081124	12,000,000	EUR	11,774,581	0.79
HANDESS ZCP 041124	10,000,000	EUR	9,814,015	0.66
HANDESS ZCP 091024	10,000,000	EUR	9,815,777	0.66
HANDESS ZCP 170425	32,000,000	EUR	30,872,232	2.07
SWEDBANK AB 0.25 19-24 09/10A	2,185,000	EUR	2,164,111	0.15
			64,440,716	4.33
Reino Unido				
BARCLAYS BANK PLC 0.3 311224	10,000,000	EUR	10,006,146	0.67
BARCLAYS BANK PLC 0.4 290824	13,000,000	EUR	13,004,875	0.87
BARCLAYS BANK PLC ZCP 070425	15,000,000	EUR	14,475,838	0.97
LLOYDS BANK CORP E 0.3 201124	10,000,000	EUR	10,004,706	0.67
RELX INVESTMENTS ZCP 03-07-24	5,000,000	EUR	4,993,606	0.34
TRANSPORT FOR LONDON ZCP 030924	10,000,000	EUR	9,902,995	0.67
			62,388,166	4.19
Estados Unidos de América				
BOOKING HOLDINGS INC 0.1 21-25 08/03A	8,000,000	EUR	7,808,480	0.52
DH EUROPE FINANCE ZCP 010824	5,000,000	EUR	4,984,084	0.33
FISERV INC ZCP 080824	10,000,000	EUR	9,944,738	0.67
FISERV INC ZCP 150824	5,000,000	EUR	4,973,979	0.33
FISERV INC ZCP 220824	8,500,000	EUR	8,447,586	0.57
FISERV INC ZCP 290824	10,000,000	EUR	9,938,063	0.67
			46,096,930	3.10
Total de bonos			737,933,785	49.56
Floating Rate Notes				
Canadá				
BANK OF MONTREAL FL.R 23-25 06/06Q	26,000,000	EUR	26,060,580	1.75
BANK OF NOVA SC FL.R 23-25 12/12Q	15,800,000	EUR	15,860,277	1.07
BANK OF NOVA SCOTIA FL.R 23-25 02/05Q	25,000,000	EUR	25,061,375	1.68
CAN IMP BK FL.R 23-25 09/06Q	5,000,000	EUR	5,011,150	0.34
CANADIAN IMPERIAL FL.R 23-25 24/01Q	24,000,000	EUR	24,044,760	1.61
NATL BANK OF CANADA FL.R 23-25 13/05Q	21,000,000	EUR	21,061,320	1.41
NATL BANK OF CANADA FL.R 24-26 06/03Q	10,000,000	EUR	10,010,000	0.67

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 2024

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en EUR)	% del activo neto
ROYAL BANK OF CANADA FL.R 23-25 17/01Q	44,000,000	EUR	44,081,400	2.96
TORONTO DOMINION BA FL.R 24-26 16/04Q	7,400,000	EUR	7,404,884	0.50
TORONTO DOMINION BANK FL.R 23-25 20/01Q	1,000,000	EUR	1,002,055	0.07
			179,597,801	12.06
Dinamarca				
NYKREDIT REALKREDIT FL.R 24-26 27/02Q	1,342,000	EUR	1,348,811	0.09
			1,348,811	0.09
Francia				
BANQUE FEDERATIVE FL.R 24-26 12/01Q	3,000,000	EUR	3,006,405	0.20
BNP PARIBAS FL.R 23-25 24/02Q	21,000,000	EUR	21,028,875	1.41
COMPAGNIE DE SAINT G FL.R 23-24 18/07Q	22,000,000	EUR	22,001,540	1.48
SG FL.R 23-25 13/01Q	20,900,000	EUR	20,934,381	1.41
SOCIETE GENERALE SUB FL.R 24-26 19/01Q	15,300,000	EUR	15,342,458	1.03
			82,313,659	5.53
Alemania				
DEUTSCHE BANK AKT FL.R 23-25 11/07Q	15,000,000	EUR	15,042,675	1.01
MERCEDES-BENZ GROUP FL.R 17-24 03/07Q	3,900,000	EUR	3,900,176	0.26
			18,942,851	1.27
Países Bajos				
ABN AMRO BK FL.R 23-25 10/01Q	32,500,000	EUR	32,545,988	2.19
SIEMENS FINANCIER FL.R 23-25 18/12Q	16,200,000	EUR	16,247,709	1.09
SIKA CAPITAL BV FL.R 23-24 01/11Q	12,000,000	EUR	12,003,480	0.81
			60,797,177	4.08
España				
BANCO SANTANDER FL.R 23-25 16/01Q	30,000,000	EUR	30,077,700	2.02
BBVA FL.R 22-25 26/11Q	5,500,000	EUR	5,564,378	0.37
			35,642,078	2.39
Suecia				
SKANDINAVISKA ENSKIL FL.R 23-25 13/06Q	7,000,000	EUR	7,019,845	0.47
			7,019,845	0.47
Reino Unido				
NATL WESTM BK SUB FL.R 24-26 09/01Q	10,000,000	EUR	10,041,950	0.67
NATWEST MKTS FL.R 22-25 27/08Q	7,000,000	EUR	7,058,975	0.47
UBS AG LONDON BRANCH FL.R 24-26 12/04Q	7,090,000	EUR	7,088,440	0.48
			24,189,365	1.62
Estados Unidos de América				
BANK OF AMERICA CORP FL.R 21-25 24/05Q	38,000,000	EUR	38,056,810	2.56
CATERPILLAR FIN FL.R 23-25 08/12Q	17,800,000	EUR	17,861,410	1.20
KRAFT HEINZ FOODS CO FL.R 23-25 09/05Q	5,067,000	EUR	5,079,414	0.34
			60,997,634	4.10
Total de floating rate notes			470,849,221	31.62
Total de valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado regulado			1,208,783,006	81.18
Organismos de inversión colectiva				
Acciones/Participaciones de fondos de inversión				
Francia				
CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV Z C	41,000	EUR	64,105,961	4.31
			64,105,961	4.31
Luxemburgo				
CANDRIAM MONEY MARKET USD SUSTAINABLE Z C	14,500	USD	16,586,755	1.11
CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO Z C	56,000	EUR	62,224,960	4.18
			78,811,715	5.29
Total de Acciones/Participaciones de fondos de inversión			142,917,676	9.60
Total de Organismos de inversión colectiva			142,917,676	9.60
Total de la cartera de inversiones			1,351,700,682	90.77
Coste de adquisición			1,347,391,842	

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 2024

Distribución geográfica (en % del activo neto)

Francia	23.02
Canadá	14.08
Luxemburgo	7.75
Estados Unidos de América	7.19
Países Bajos	6.97
Reino Unido	5.81
Suecia	4.80
Bélgica	4.00
España	3.37
Japón	2.92
Australia	2.20
Alemania	1.94
Dinamarca	1.57
Finlandia	1.34
Noruega	1.34
Italia	1.33
Irlanda	1.13
	90.77

Distribución económica (en % del activo neto)

Bancos y otras entidades financieras	66.07
Fondos de inversión	11.93
Bienes inmuebles	3.20
Bonos de Estados, provincias y municipios	1.98
Materiales de construcción	1.48
Suministros públicos	1.33
Internet y servicios de Internet	1.05
Productos químicos	0.80
Comunicación	0.67
Neumáticos y caucho	0.67
Transporte	0.67
Industria gráfica y editorial	0.34
Alimentos y bebidas no alcohólicas	0.34
Vehículos de carretera	0.26
	90.77



Candriam Money Market Euro AAA

Cartera de inversiones a 30 de junio de 2024

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en EUR)	% del activo neto
Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado regulado				
Bonos				
Australia				
AUST AND NEW ZEALAND ZCP 041024	20,000,000	EUR	19,636,200	1.96
NATIONAL AUSTR 0.3 081124	10,000,000	EUR	10,002,160	1.00
NATL AUSTRALIA BANK 0.625 17-24 18/09A	4,900,000	EUR	4,865,945	0.49
			34,504,305	3.45
Bélgica				
BRUS MUNI REGI FUN ZCP 15-07-24	18,000,000	EUR	17,947,623	1.80
BRUSSELS MUNICIPALIT ZCP 030724	14,150,000	EUR	14,144,101	1.42
KBC BANK ZCP 010724	35,000,000	EUR	34,989,502	3.50
SOCIETE WALLONNE DU ZCP 190724	32,000,000	EUR	31,803,627	3.18
			98,884,853	9.90
Canadá				
BANK OF MONTREAL LDN FL.R 12-11-24	10,000,000	EUR	10,003,150	1.00
BANK OF MONTREAL LDN FL.R 12-11-24	15,000,000	EUR	15,001,931	1.50
RBC TORONTO 0.125 19-24 23/07A	6,400,000	EUR	6,385,632	0.64
TOR DOM BK LDN BR ZCP 130924	25,000,000	EUR	24,786,650	2.48
			56,177,363	5.62
Finlandia				
FINLAND TBILL ZCP 13-02-25	20,000,000	EUR	19,498,625	1.95
FINLAND TBILL ZCP 13-11-24	10,000,000	EUR	9,799,699	0.98
NORD B OISEST+0.22% 16-01-25	20,000,000	EUR	19,995,974	2.00
OP CORPORATE BANK PL 0.125 20-24 01/07A	6,680,000	EUR	6,678,096	0.67
			55,972,394	5.60
Francia				
AIR LIQUIDE FINANCE ZCP 160924	30,000,000	EUR	29,646,444	2.97
ALLI B OISEST+0.23% 22-07-24	5,000,000	EUR	4,999,531	0.50
ALLIANZ BQ 0.2 111024	5,000,000	EUR	4,998,247	0.50
ALLIANZ BQ 0.22 070225	5,000,000	EUR	4,997,682	0.50
ALLIANZ BQ 0.22 250225	5,000,000	EUR	4,997,781	0.50
ALLIANZ BQ 0.23 041024	5,000,000	EUR	4,998,342	0.50
ALLIANZ BQ 0.23 230824	5,000,000	EUR	4,998,943	0.50
ALLIANZ BQ 0.23 280325	5,000,000	EUR	4,998,312	0.50
ALLIANZ BQ 0.24 060625	5,000,000	EUR	4,999,763	0.50
AXA PAR ZCP 151024	25,000,000	EUR	24,545,465	2.46
BANQUE FEDERATIVE 0.32 280125	10,000,000	EUR	10,002,705	1.00
BPCE (ISSUER) 0.32 111024	10,000,000	EUR	10,002,142	1.00
BPCE OISEST+0.33% 19-07-24	10,000,000	EUR	10,000,545	1.00
BPCE SA 0.33 110924	5,000,000	EUR	5,000,922	0.50
BPCE SA ZCP 160425	5,000,000	EUR	4,821,482	0.48
BQ POSTALE ZCP 17-04-25	10,000,000	EUR	9,655,577	0.97
CMCIFRPA 0.3 190724	10,000,000	EUR	10,000,557	1.00
CMCIFRPA 0.3 230824	5,000,000	EUR	5,000,661	0.50
CMCIFRPA 0.32 300824	5,000,000	EUR	5,000,877	0.50
DASSAULT SYSTEMES ZCP 040924	37,500,000	EUR	37,161,563	3.72
FRENCH REPUBLIC ZCP 17-07-24	20,000,000	EUR	19,830,619	1.98
LA BQUE POST 0.25 250225	15,000,000	EUR	15,006,008	1.50
REGION AUVERG RHONE ZCP 060824	3,500,000	EUR	3,485,775	0.35
REGION HAUTS DE FRA ZCP 220724	13,000,000	EUR	12,960,614	1.30
SANOFI SA 1 20-25 30/03A	17,000,000	EUR	16,663,910	1.67
SOCIETE GENERALE 0.3 230824	5,000,000	EUR	5,000,777	0.50
SOCIETE GENERALE 0.3 300125	10,000,000	EUR	10,005,896	1.00
			283,781,140	28.40
Alemania				
DEUTSCHE BAHN AG ZCP 080724	25,000,000	EUR	24,764,225	2.48
			24,764,225	2.48

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 2024

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en EUR)	% del activo neto
Irlanda				
ZURICH FINANCE IRE ZCP 240724	10,000,000	EUR	9,906,409	0.99
			9,906,409	0.99
Japón				
JAPAN TREASURY DISC ZCP 220724	4,700,000,000	JPY	27,319,562	2.73
			27,319,562	2.73
Luxemburgo				
EURO STAB MECH TRE ZCP 19-09-24	26,000,000	EUR	25,718,103	2.57
			25,718,103	2.57
Países Bajos				
COOPERATIEVE RABOBANK 0.28 081124	15,000,000	EUR	15,002,781	1.50
COOPERATIEVE RABOBANK 0.31 180724	10,000,000	EUR	10,000,131	1.00
LINDE FINANCE BV ZCP 290724	23,000,000	EUR	22,882,066	2.29
TOYOTA MOTOR FIN ZCP 160924	20,000,000	EUR	19,833,927	1.98
			67,718,905	6.78
Noruega				
DNB BANK A OISEST 08-11-24	25,000,000	EUR	25,011,744	2.50
			25,011,744	2.50
Suecia				
HANDESS ZCP 091024	10,000,000	EUR	9,815,172	0.98
HANDESS ZCP 170425	4,000,000	EUR	3,858,770	0.39
SWED A OISEST+0.32% 02-01-25	15,000,000	EUR	15,009,548	1.50
VOLVO TREASURY AB ZCP 220724	15,000,000	EUR	14,954,374	1.50
			43,637,864	4.37
Reino Unido				
BARCLAYS BANK PLC 0.3 311224	15,000,000	EUR	15,009,318	1.50
BARCLAYS BANK PLC 0.4 290824	5,000,000	EUR	5,001,911	0.50
BARCLAYS BANK PLC ZCP 070425	10,000,000	EUR	9,649,916	0.97
LLOYDS BANK 0.33 270924	15,000,000	EUR	15,004,634	1.50
LLOYDS BANK PLC ZCP 150724	29,000,000	EUR	28,778,760	2.88
TRANSPORT FOR LONDON ZCP 050924	25,000,000	EUR	24,768,408	2.48
			98,212,947	9.83
Estados Unidos de América				
COLGATE PALMOLIVE CO ZCP 090724	30,000,000	EUR	29,944,400	3.00
ILLINOIS TOOL WORKS 0.25 19-24 05/12A	14,000,000	EUR	13,790,350	1.38
PROCTER AND GAMBLE C ZCP 050724	25,000,000	EUR	24,759,957	2.48
			68,494,707	6.85
Total de bonos			920,104,521	92.07
Floating Rate Notes				
Canadá				
TORONTO DOMINION BANK FL.R 23-25 20/01Q	9,000,000	EUR	9,018,540	0.90
			9,018,540	0.90
Francia				
SG FL.R 23-25 13/01Q	5,000,000	EUR	5,008,100	0.50
			5,008,100	0.50
Alemania				
MERCEDES-BENZ GROUP FL.R 17-24 03/07Q	11,700,000	EUR	11,700,527	1.17
			11,700,527	1.17
Países Bajos				
ABN AMRO BK FL.R 23-25 10/01Q	1,000,000	EUR	1,001,435	0.10
			1,001,435	0.10
Total de floating rate notes			26,728,602	2.67
Total de valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado regulado			946,833,123	94.75
Total de la cartera de inversiones			946,833,123	94.75
Coste de adquisición			947,030,432	

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

Distribución geográfica y económica de la cartera de inversiones a 30 de junio de 2024

Distribución geográfica (en % del activo neto)

Francia	28.90
Bélgica	9.90
Reino Unido	9.83
Países Bajos	6.88
Estados Unidos de América	6.85
Canadá	6.52
Finlandia	5.60
Suecia	4.37
Alemania	3.65
Australia	3.45
Japón	2.73
Luxemburgo	2.57
Noruega	2.50
Irlanda	0.99
	94.75

Distribución económica (en % del activo neto)

Bancos y otras entidades financieras	65.05
Bonos de Estados, provincias y municipios	9.30
Bienes de consumo varios	5.47
Transporte	4.96
Otros	3.18
Organizaciones supranacionales	2.57
Industria farmacéutica	1.67
Construcción de máquinas y aparatos	1.38
Vehículos de carretera	1.17
	94.75



Candriam Money Market USD Sustainable

Cartera de inversiones a 30 de junio de 2024

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en USD)	% del activo neto
Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado regulado				
Bonos				
Australia				
AUSTRALIA NEW 5.65 100125	3,500,000	USD	3,501,097	2.34
			3,501,097	2.34
Canadá				
BOM ZCP 090824	4,000,000	USD	3,975,939	2.66
			3,975,939	2.66
Francia				
BANQUE FEDERATIVE ZCP 100425	5,000,000	USD	4,739,763	3.17
BPCE 2.375 20-25 14/01S	5,537,000	USD	5,433,929	3.63
BPCE SA 2.3750 20-25 14/01S	1,500,000	USD	1,471,980	0.98
LA BQUE POST ZCP 310724	5,000,000	USD	4,793,468	3.20
SOCIETE GENERALE 2.6250 19-24 16/10S	5,000,000	USD	4,949,975	3.31
VEOLIA ENVIRONMNT ZCP 090425	5,000,000	USD	4,740,179	3.17
			26,129,294	17.46
Irlanda				
JOHNSON CONTROLS 3.625 16-24 02/07S	4,000,000	USD	3,999,440	2.67
			3,999,440	2.67
Japón				
GOVERNMENT OF JAPAN ZCP 170924	500,000,000	JPY	3,108,126	2.08
			3,108,126	2.08
Luxemburgo				
HP ENTERPRISE CO 5.90 23-24 01/10S	3,138,000	USD	3,137,576	2.10
			3,137,576	2.10
Países Bajos				
ABN AMRO BANK NV ZCP 120824	2,000,000	USD	1,972,184	1.32
ABN AMRO BK ZCP 16-09-24	2,000,000	USD	1,966,227	1.31
COOPERATIEVE RABOBANK ZCP 161224	8,000,000	USD	7,589,597	5.07
COOPERATIEVE RABOBANK ZCP 25-07-24	2,000,000	USD	1,888,624	1.26
ENEL FINANCE INTL 2.65 19-24 10/09S	3,553,000	USD	3,529,994	2.36
ENEL FINANCE INTL 2.6500 19-24 10/09S	1,900,000	USD	1,886,947	1.26
NATWEST MARKETS N.V. ZCP 070425	5,000,000	USD	4,740,996	3.17
			23,574,569	15.75
Noruega				
AMGEN 5.25 23-25 02/03S	5,500,000	USD	5,487,460	3.67
			5,487,460	3.67
Suecia				
HANDESS ZCP 101024	5,000,000	USD	5,000,263	3.34
SKANDINAVISKA ZCP 100724	3,000,000	USD	2,952,032	1.97
SWEDBANK AB. ZCP 120724	5,000,000	USD	4,981,401	3.33
			12,933,696	8.64
Estados Unidos de América				
CVS HEALTH CORP 5.0 16-24 01/12S	3,500,000	USD	3,488,433	2.33
EBAY INC 1.9 20-25 11/03S	1,500,000	USD	1,462,208	0.98
EBAY INC 3.45 14-24 01/08S	3,000,000	USD	2,993,760	2.00
FISERV INC 2.75 19-24 07/01S	7,074,000	USD	7,072,445	4.73
FISERV INC ZCP 290824	5,000,000	EUR	5,326,119	3.56
GLAXOSMITHKLINE 3.6250 18-25 15/05S	5,000,000	USD	4,925,625	3.29
INTEL CORP 3.4 20-25 25/03S	5,000,000	USD	4,926,700	3.29
THE WALT DISNEY COMP 1.75 19-24 30/08S	2,707,000	USD	2,689,621	1.80
THE WALT DISNEY COMP 3.35 20-25 23/03S	3,000,000	USD	2,954,805	1.97
THERMO FISHER SCIENTI 1.125 21-24 18/10S	5,000,000	USD	4,935,025	3.30
TOYOTA MOTOR CREDIT 0.625 21-24 13/09S	1,557,000	USD	1,541,414	1.03
UNIT STAT TREA BIL ZCP 03-10-24	3,000,000	USD	2,923,237	1.95
UNIT STAT TREA BIL ZCP 05-09-24	4,000,000	USD	3,953,095	2.64
UNIT STAT TREA BIL ZCP 19-09-24	2,500,000	USD	2,469,604	1.65
ZIMMER BIOMET HLDG 1.4500 21-24 22/11S	4,000,000	USD	3,932,040	2.63
			55,594,131	37.15

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 2024

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en USD)	% del activo neto
Total de bonos			141,441,328	94.51
Floating Rate Notes				
Francia				
SG FL.R 22-26 21/01Q	880,000	USD	880,493	0.59
			880,493	0.59
Estados Unidos de América				
TOYOTA MOTOR CREDIT FL.R 23-25 11/09Q	4,075,000	USD	4,089,018	2.73
			4,089,018	2.73
Total de floating rate notes			4,969,511	3.32
Total de valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado regulado			146,410,839	97.83
Total de la cartera de inversiones			146,410,839	97.83
Coste de adquisición			145,768,356	

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

Distribución geográfica y económica de la cartera de inversiones a 30 de junio de 2024

Distribución geográfica (en % del activo neto)

Estados Unidos de América	39.88
Francia	18.05
Países Bajos	15.75
Suecia	8.64
Noruega	3.67
Irlanda	2.67
Canadá	2.66
Australia	2.34
Luxemburgo	2.10
Japón	2.08
	97.83

Distribución económica (en % del activo neto)

Bancos y otras entidades financieras	63.92
Electrónica y semiconductores	6.59
Bonos de Estados, provincias y municipios	6.24
Industria farmacéutica	6.00
Industria gráfica y editorial	3.77
Bienes inmuebles	3.56
Comercio minorista y grandes almacenes	2.98
Bienes de consumo varios	2.67
Suministros de oficina y ordenadores	2.10
	97.83



Notas a los estados financieros - Inventario de instrumentos derivados

Contratos de divisas a plazo

A 30 de junio de 2024, los siguientes contratos de contratos de divisas a plazo estaban pendientes:

Candriam Money Market Euro AAA

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Contraparte	Latente (en EUR)
EUR	28,125,921	JPY	4,700,000,000	22/07/2024	Nomura Financial Products & Services	743,273
						743,273

Candriam Money Market USD Sustainable

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Contraparte	Latente (en USD)
USD	5,361,910	EUR	5,000,000	29/08/2024	Nomura Financial Products & Services	(11,835)
USD	3,205,897	JPY	500,000,000	17/09/2024	Nomura Financial Products & Services	60,283
						48,448

Candriam Money Market Euro

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Contraparte	Latente (en EUR)
EUR	16,512,688	USD	17,700,000	26/07/2024	UBS Europe SE	16,231
EUR	14,962,005	JPY	2,500,000,000	22/07/2024	UBS Europe SE	429,515
EUR	29,783,517	JPY	5,000,000,000	17/09/2024	J.P. Morgan SE	543,661
						989,407

Consulte la Nota 7 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 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:

- 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.

En el marco del Reglamento sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR), la información sobre las características medioambientales y/o sociales y/o las inversiones sostenibles está disponible en los anexos pertinentes, en el apartado (sin auditar) «Reglamento sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR)».

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 2024.

Subfondos Candriam Money Market Euro y Candriam Money Market USD Sustainable: el valor liquidativo de cada subfondo se calculó el 2 de enero de 2023 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 2024 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.

De acuerdo con la política de valoración de la SICAV, el 40,22% de los activos se valoraron según un modelo a 29 de diciembre de 2023 para el subfondo Candriam Money Market Euro, el 50,37% para Candriam Money Market Euro AAA y el 40,18% para Candriam Money Market USD Sustainable.

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 2024:

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

1 EUR =	1.604800	AUD	1 EUR =	0.963050	CHF	1 EUR =	0.847850	GBP	1 EUR =	11.350000	SEK
1 EUR =	1.466550	CAD	1 EUR =	7.457450	DKK	1 EUR =	172.401700	JPY	1 EUR =	1.071750	USD



Otras notas a los estados financieros

Nota 2 - Principales métodos contables (continuación)

Para el subfondo Candriam Money Market Euro AAA:

d) Estados financieros combinados de la SICAV

El estado combinado del patrimonio neto de la SICAV y el estado combinado de variación patrimonial que se expresan en euros son la suma del estado del activo neto, el estado de variación patrimonial de cada subfondo convertido a la moneda de la SICAV utilizando los tipos de cambio vigentes en la fecha de cierre.

Las inversiones realizadas por determinados subfondos de la SICAV en otros subfondos de la SICAV no se han eliminado del estado combinado del activo neto a 30 de junio de 2024. A 30 de junio de 2024, el total de las inversiones dentro de la SICAV ascendía a 16.586.755 EUR. Por consiguiente, el activo neto combinado a la fecha de cierre ascendería a 2.611.485.043 euros si se eliminaran dichas inversiones dentro de la SICAV.

Subfondos	Inversiones dentro de la SICAV	Importe (EUR)
Candriam Money Market Euro	CANDRIAM MONEY MARKET USD SUSTAINABLE Z C	16,586,755

e) 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».

f) Gastos de operaciones

En el periodo cerrado a 30 de junio de 2024, 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».

g) 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*.

h) Abreviaturas utilizadas en la cartera de valores:

FL.R: Obligaciones de tipo variable

ZCP: Cupón cero

Q: Trimestral

A: Anual

S: Semestral

Nota 3 - Comisiones de gestión

Candriam, sociedad comanditaria por acciones de derecho luxemburgués, con domicilio social en SERENITY - Bloc B, 19-21, Route d'Arlon, L-8009 Strassen, ha sido designada Sociedad Gestora. A tal efecto, se firmó un contrato con una duración ilimitada. En cualquier momento, cualquiera de las partes podrá rescindir dicho contrato y notificárselo a la otra parte por correo certificado con acuse de recibo con una antelación de 90 días.

Candriam es una filial de Candriam Group, entidad del grupo New York Life Insurance Company.

Está aprobada como Sociedad Gestora en el sentido de lo dispuesto en el capítulo 15 de la ley de 17 diciembre de 2010 relativa a los OICVM y está autorizada para ejercer las actividades de gestión de carteras colectivas, de gestión de carteras de inversión y de asesoramiento en materia de inversiones.

La Sociedad Gestora tiene las más amplias facultades para llevar a cabo todas las actuaciones relativas a la gestión y la administración de la SICAV en el ámbito de esta finalidad, de acuerdo con sus estatutos sociales. Es responsable de las actividades de gestión de la cartera, las actividades de administración (Agente Administrativo, Agente de Transferencias (incluidas las actividades de Conservador de Registro)) y las actividades de marketing (distribución).

La función de gestión de carteras recae directamente en Candriam y/o en una o varias de sus sucursales: Candriam -Belgian Branch, Candriam - Succursale française, Candriam - UK Establishment.

La Sociedad Gestora recibe como remuneración por sus servicios unas comisiones de gestión, expresadas como un porcentaje anual del valor liquidativo medio. Dichas comisiones son pagaderas por la SICAV al finalizar cada mes.



Otras notas a los estados financieros

Nota 3 - Comisiones de gestión (continuación)

Los tipos en vigor a 30 de junio de 2024 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	0.20%
	R	Capitalización	LU0936337848	0.20%
	R2	Distribución	LU1389877876	0.13%
	V	Capitalización	LU0323048693	0.06%
	Z	Capitalización	LU0391999124	0.00%
Candriam Money Market Euro AAA	C	Capitalización	LU0354091653	0.45%
	C	Distribución	LU0354091737	0.45%
	I	Capitalización	LU0354091901	0.14%
	I	Distribución	LU0354127358	0.14%
	R	Capitalización	LU0936338655	0.14%
	V	Capitalización	LU0354092115	0.10%
	V	Distribución	LU0354092206	0.10%
Candriam Money Market USD Sustainable	Z	Capitalización	LU0391999470	0.00%
	C	Capitalización	LU0049341216	0.50%
	C	Distribución	LU0094032728	0.50%
	I	Capitalización	LU0206982414	0.20%
	I	Distribución	LU0355214700	0.20%
	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 2024 a los OICVM en que invierte Candriam Money Market.

Fondo objetivo	Tipo máximo
CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV Z C	0.15%
CANDRIAM MONEY MARKET USD SUSTAINABLE Z C	0.00%
CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO Z C	0.00%

Nota 4 - 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 ejercicio 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.



Otras notas a los estados financieros

Nota 4 - Gastos operativos y administrativos (continuación)

Los tipos máximos en vigor a 30 de junio de 2024 son:

Subfondos	Clase de acciones	Tipo de acciones	ISIN	Tipo máximo
Candriam Money Market Euro	C	Distribución	LU0093583234	0.30%
	C	Capitalización	LU0093583077	0.30%
	I	Capitalización	LU0206982331	0.17%
	R	Capitalización	LU0936337848	0.30%
	R2	Distribución	LU1389877876	0.30%
	V	Capitalización	LU0323048693	0.17%
Candriam Money Market Euro AAA	Z	Capitalización	LU0391999124	0.17%
	C	Distribución	LU0354091737	0.30%
	C	Capitalización	LU0354091653	0.30%
	I	Distribución	LU0354127358	0.17%
	I	Capitalización	LU0354091901	0.17%
	R	Capitalización	LU0936338655	0.30%
	V	Distribución	LU0354092206	0.17%
Candriam Money Market USD Sustainable	V	Capitalización	LU0354092115	0.17%
	Z	Capitalización	LU0391999470	0.17%
	C	Distribución	LU0094032728	0.25%
	C	Capitalización	LU0049341216	0.25%
	I	Distribución	LU0355214700	0.16%
	I	Capitalización	LU0206982414	0.16%
	V	Capitalización	LU0323048347	0.16%
	Z	Capitalización	LU0391999553	0.16%

Nota 5 - 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 prever 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 ha sido 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 en lengua flamenca) de 21 de abril de 2022 no rebata 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 6 - Dividendos

La SICAV repartió los siguientes dividendos durante el periodo cerrado a 30 de junio de 2024:

Subfondos	Clase de acciones	Divisa	Dividendo	Fecha ex dividendo
Candriam Money Market Euro	C	EUR	6.92	29/04/2024
	R2	EUR	2.89	29/04/2024
Candriam Money Market Euro AAA	C	EUR	1.96	29/04/2024
	I	EUR	20.14	29/04/2024
	V	EUR	20.34	29/04/2024
Candriam Money Market USD Sustainable	C	USD	16.83	29/04/2024
	I	USD	25.13	29/04/2024



Otras notas a los estados financieros

Nota 7 - Garantía

En relación con los instrumentos derivados OTC, se ha recibido y proporcionado efectivo como garantía de/a Barclays Bank PLC - Ireland - LC, Société Générale SA y UBS Europe SE (Brexit / en curso) por importe de para:

Subfondos	Divisa	Garantía en efectivo pagada	Garantía en efectivo mantenida
Candriam Money Market Euro	EUR	490,000	340,000
Candriam Money Market Euro AAA	EUR	0	660,000

Nota 8 - 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 9 - Hechos posteriores al cierre

No hay ningún acontecimiento posterior.



Información adicional sin auditar

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.

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: <https://www.candriam.com/en/professional/investment-solutions/sustainability-documents/#engagement-activities>.