



Informe semestral sin auditar
Candriam Money Market

30 de junio de 2023



Candriam Money Market

SICAV de derecho luxemburgués

Informe semestral sin auditar correspondiente al periodo
del 1 de enero de 2023 al 30 de junio de 2023



Índice

Administración de la SICAV	4
Detalles de la SICAV	5
Estado del activo neto a 30 de junio de 2023	6
Estado de variación patrimonial del periodo cerrado a 30 de junio de 2023	8
Estadísticas	10
Cartera de inversiones a 30 de junio de 2023	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	23
Información adicional sin auditar	29



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), 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 2023

		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	1,270,455,942	448,640,677	108,979,720
Efectivo en bancos e intermediarios financieros		101,996,355	75,801,460	9,882,497
Importe por cobrar de inversiones vendidas		2,135,300	2,986,040	5,125,147
Importe por cobrar de suscripciones		2,378,205	0	32,867
Intereses y dividendos por cobrar, netos		7,727,613	2,732,121	1,098,731
Plusvalía latente neta de contratos de divisas a plazo	2d	0	0	29,322
Plusvalía latente neta de Swaps		0	0	10,481
Total activo		1,384,693,415	530,160,298	125,158,765
Pasivo				
Importe por pagar por inversiones adquiridas		44,897,799	59,922,652	5,104,856
Acreedores por reembolsos		3,369,947	0	99,445
Minusvalía latente neta de contratos de divisas a plazo	2d	0	255,389	0
Comisiones de gestión por pagar	3	255,509	65,621	29,143
Gastos operativos y administrativos por pagar	4	77,800	30,833	6,170
Impuesto de suscripción por pagar	5	91,769	0	8,317
Total pasivo		48,692,824	60,274,495	5,247,931
Total del activo neto		1,336,000,591	469,885,803	119,910,834



Estado del activo neto a 30 de junio de 2023

		Combinado
		EUR
Activo		
Cartera de inversiones al valor de mercado	2a	1,818,986,372
Efectivo en bancos e intermediarios financieros		186,856,016
Importe por cobrar de inversiones vendidas		9,819,000
Importe por cobrar de suscripciones		2,408,331
Intereses y dividendos por cobrar, netos		11,466,820
Plusvalía latente neta de contratos de divisas a plazo	2d	26,876
Plusvalía latente neta de Swaps		9,607
Total activo		2,029,573,022
Pasivo		
Importe por pagar por inversiones adquiridas		109,499,512
Acreedores por reembolsos		3,461,097
Minusvalía latente neta de contratos de divisas a plazo	2d	255,389
Comisiones de gestión por pagar	3	347,842
Gastos operativos y administrativos por pagar	4	114,288
Impuesto de suscripción por pagar	5	99,392
Total pasivo		113,777,520
Total del activo neto		1,915,795,502



Estado de variación patrimonial del periodo cerrado a 30 de junio de 2023

		Candriam Money Market Euro	Candriam Money Market Euro AAA	Candriam Money Market USD Sustainable
		EUR	EUR	USD
Activo neto al inicio del periodo		1,731,332,326	390,766,206	103,579,075
Ingresos				
Intereses netos de bonos e instrumentos del mercado monetario	2f	17,950,507	4,836,800	2,149,447
Intereses recibidos de swaps		0	0	870,111
Intereses bancarios		1,862,069	1,585,412	275,076
Otros ingresos		588	57,198	26
Total ingresos		19,813,164	6,479,410	3,294,660
Gastos				
Comisiones de gestión	3	1,576,754	322,534	176,799
Gastos operativos y administrativos	4	461,763	136,275	35,843
Comisiones del depositario	4	35,246	10,975	2,574
Impuesto de suscripción	5	60,629	0	11,097
Intereses pagados de swaps	2g	0	0	879,416
Intereses bancarios		1,496	0	437
Total gastos		2,135,888	469,784	1,106,166
Ingresos/(Pérdidas) netos(as) de las inversiones		17,677,276	6,009,626	2,188,494
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de ventas de inversiones	2b	581,530	514,706	169,542
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de contratos de divisas a plazo	2d	(1,515,096)	(477,519)	(2,217,948)
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de divisas		1,971,878	425,772	2,225,163
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas		18,715,588	6,472,585	2,365,251
Variación de la plusvalía/minusvalía latente neta de inversiones	2a	(2,522,545)	295,613	(1,778,215)
Variación de la plusvalía/minusvalía latente neta de contratos de divisas a plazo	2d	4,860,007	(255,389)	2,108,955
Variación de la plusvalía/minusvalía latente neta de swaps		0	0	10,481
Aumento/(Disminución) neto/a del activo neto resultante de operaciones		21,053,050	6,512,809	2,706,472
Evolución del capital				
Suscripciones de acciones		1,187,317,607	2,094,187,378	120,930,701
Reembolsos de acciones		(1,603,702,392)	(2,021,580,590)	(107,299,021)
Dividendos pagados		0	0	(6,393)
Conversión de divisas		0	0	0
Activo neto al final del periodo		1,336,000,591	469,885,803	119,910,834



Estado de variación patrimonial del periodo cerrado a 30 de junio de 2023

		Combinado
		EUR
Activo neto al inicio del periodo		2,219,150,840
Ingresos		
Intereses netos de bonos e instrumentos del mercado monetario	2f	24,757,469
Intereses recibidos de swaps		797,535
Intereses bancarios		3,699,613
Otros ingresos		57,810
Total ingresos		29,312,427
Gastos		
Comisiones de gestión	3	2,061,340
Gastos operativos y administrativos	4	630,891
Comisiones del depositario	4	48,580
Impuesto de suscripción	5	70,800
Intereses pagados de swaps	2g	806,064
Intereses bancarios		1,897
Total gastos		3,619,572
Ingresos/(Pérdidas) netos(as) de las inversiones		25,692,855
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de ventas de inversiones	2b	1,251,637
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de contratos de divisas a plazo	2d	(4,025,565)
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas de divisas		4,437,214
Ganancias/(Pérdidas) materializadas netas		27,356,141
Variación de la plusvalía/minusvalía latente neta de inversiones	2a	(3,856,827)
Variación de la plusvalía/minusvalía latente neta de contratos de divisas a plazo	2d	6,537,666
Variación de la plusvalía/minusvalía latente neta de swaps		9,607
Aumento/(Disminución) neto/a del activo neto resultante de operaciones		30,046,587
Evolución del capital		
Suscripciones de acciones		3,392,348,891
Reembolsos de acciones		(3,723,632,222)
Dividendos pagados		(5,860)
Conversión de divisas		(2,112,734)
Activo neto al final del periodo		1,915,795,502



Estadísticas

Candriam Money Market Euro

Nombre	ISIN	Tipo de acciones	Divisa	Número de acciones en circulación	Valor liquidativo por acción a 30/06/2023	Valor liquidativo por acción a 31/12/2022	Valor liquidativo por acción a 31/12/2021
Total del activo neto			EUR		1,336,000,591	1,731,332,326	1,333,059,823
C	LU0093583077	Capitalización	EUR	737,863.99	514.16	508.21	510.67
C	LU0093583234	Distribución	EUR	86,261.72	357.08	353.18	355.12
I	LU0206982331	Capitalización	EUR	679,352.48	551.23	543.99	544.23
R	LU0936337848	Capitalización	EUR	1,499.72	99.43	98.13	98.20
R2	LU1389877876	Distribución	EUR	241,260.00	149.13	147.14	147.28
V	LU0323048693	Capitalización	EUR	371,247.72	1,021.66	1,007.46	1,007.36
Z	LU0391999124	Capitalización	EUR	132,325.73	1,027.11	1,012.59	1,012.04

Candriam Money Market Euro AAA

Nombre	ISIN	Tipo de acciones	Divisa	Número de acciones en circulación	Valor liquidativo por acción a 30/06/2023	Valor liquidativo por acción a 31/12/2022	Valor liquidativo por acción a 31/12/2021
Total del activo neto			EUR		469,885,803	390,766,206	326,824,499
C	LU0354091653	Capitalización	EUR	925,450.75	103.21	102.07	102.22
C	LU0354091737	Distribución	EUR	2,282.54	101.30	100.19	99.97
I	LU0354091901	Capitalización	EUR	114,905.56	1,058.19	1,044.77	1,045.55
I	LU0354127358	Distribución	EUR	9,648.31	1,037.72	1,024.78	1,025.56
R	LU0936338655	Capitalización	EUR	8,560.83	151.54	149.63	149.77
V	LU0354092115	Capitalización	EUR	140,820.23	1,061.41	1,047.48	1,048.09
V	LU0354092206	Distribución	EUR	1.00	1,047.18	1,033.03	1,032.72
Z	LU0391999470	Capitalización	EUR	85,961.14	1,067.57	1,053.29	1,053.57

Candriam Money Market USD Sustainable

Nombre	ISIN	Tipo de acciones	Divisa	Número de acciones en circulación	Valor liquidativo por acción a 30/06/2023	Valor liquidativo por acción a 31/12/2022	Valor liquidativo por acción a 31/12/2021
Total del activo neto			USD		119,910,834	103,579,075	121,258,156
C	LU0049341216	Capitalización	USD	68,443.81	570.08	557.70	549.25
C	LU0094032728	Distribución	USD	24,357.75	379.12	371.35	365.99
I	LU0206982414	Capitalización	USD	75,359.86	595.56	581.64	571.71
I	LU0355214700	Distribución	USD	2,512.33	564.79	552.04	542.66
V	LU0323048347	Capitalización	USD	1.00	1,154.19	1,126.31	1,105.34
Z	LU0391999553	Capitalización	USD	21,843.35	1,160.80	1,132.56	1,111.68



Candriam Money Market Euro

Cartera de inversiones a 30 de junio de 2023

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				
Bélgica				
AEDIFICA NV/SA ZCP 170723	12,000,000	EUR	11,966,001	0.90
BRUS MUNI REGI FUN ZCP 05-07-23	7,000,000	EUR	6,983,298	0.52
COFINIMMO ZCP 03-08-23	15,000,000	EUR	14,954,507	1.12
COFINIMMO ZCP 12-07-23	7,000,000	EUR	6,982,094	0.52
PROXIMUS SA ZCP 310823	25,000,000	EUR	24,852,219	1.86
PROXIMUS ZCP 31-07-23	15,000,000	EUR	14,955,391	1.12
REGION WALLONNE ZCP 010823	10,000,000	EUR	9,972,428	0.75
REGION WALLONNE ZCP 03-07-23	10,000,000	EUR	9,972,982	0.75
REGION WALLONNE ZCP 170723	4,500,000	EUR	4,489,475	0.34
			105,128,395	7.87
Dinamarca				
JYSK B OISEST+0.32% 20-11-23	20,000,000	EUR	20,015,015	1.50
			20,015,015	1.50
Francia				
ATEGIDE ZCP 190723	12,000,000	EUR	11,950,980	0.89
ALLIANZ BANQUE SA 0.21 111223	2,000,000	EUR	1,999,564	0.15
ALLIANZ BANQUE SA 0.215 220324	5,000,000	EUR	4,999,703	0.37
ALLIANZ BANQUE SA 0.22 161123	3,000,000	EUR	2,999,317	0.22
ALLIANZ BANQUE SA 0.22 220524	5,000,000	EUR	4,999,162	0.37
ALLIANZ BANQUE SA 0.23 230124	5,000,000	EUR	5,015,851	0.38
AXA PAR ZCP 180723	11,000,000	EUR	10,912,502	0.82
BFCM B OISEST+0.26% 20-11-23	20,000,000	EUR	20,006,209	1.50
BPCE OISEST+0.26% 22-11-23	20,000,000	EUR	20,008,861	1.50
BROKERFR2 0.22 140624	5,000,000	EUR	4,999,345	0.37
BROKERFR2 0.23 010724	5,000,000	EUR	4,999,501	0.37
SANOFI ZCP 111023	10,000,000	EUR	9,825,024	0.74
SCHNEIDER ELEC.SE ZCP 200723	10,000,000	EUR	9,919,317	0.74
SOCIETE GENERALE SA 0.285 180124	12,000,000	EUR	12,005,571	0.90
VINCI SA 0.095 180823	30,000,000	EUR	30,001,347	2.25
			154,642,254	11.58
Alemania				
CONTINENTAL AG ZCP 210723	15,000,000	EUR	14,975,217	1.12
DEUTSCHE BOERSE ZCP 28-08-23	17,000,000	EUR	16,899,057	1.26
SAP SE ZCP 10-08-23	3,000,000	EUR	2,974,899	0.22
VOLKSWAGEN FIN. SVC ZCP 170723	5,000,000	EUR	4,935,948	0.37
VOLKSWAGEN LEASING 0.00 21-23 12/07A	13,000,000	EUR	12,987,975	0.97
			52,773,096	3.95
Irlanda				
CRH FINANCE DAC ZCP 210823	6,000,000	EUR	5,964,878	0.45
CRH FINANCE DAC ZCP 21-08-23	16,000,000	EUR	15,909,489	1.19
CRH FINANCE DAC ZCP 260723	18,000,000	EUR	17,954,565	1.34
			39,828,932	2.98
Luxemburgo				
ABN AMRO BANK 0.50 18-23 17/07A	3,000,000	EUR	2,996,520	0.22
			2,996,520	0.22
Países Bajos				
COOP R OISEST+0.26% 10-11-23	20,000,000	EUR	20,007,156	1.50
HEINEKEN NV ZCP 030823	25,000,000	EUR	24,915,956	1.86
STELLANTIS NV 3.375 20-23 07/07A	8,500,000	EUR	8,502,890	0.64
			53,426,002	4.00
Noruega				
DNB BA OISEST+0.27% 20-11-23	20,000,000	EUR	20,012,259	1.50
			20,012,259	1.50

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 2023

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en EUR)	% del activo neto
Reino Unido				
ABN AMRO BK ZCP 02-10-23	12,000,000	EUR	11,798,724	0.88
BANK O OISEST+0.39% 14-11-23	20,000,000	EUR	20,016,124	1.50
Denominación				
	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en EUR)	% del activo neto
BARCLAYS BANK PLC 0.35 111023	18,000,000	EUR	18,000,386	1.35
HALEON ZCP 03-07-23	16,000,000	EUR	15,939,580	1.19
LLOYDS BANK 0.44 201123	10,000,000	EUR	10,005,666	0.75
NATL A OISEST+0.27% 10-11-23	20,000,000	EUR	20,008,558	1.50
NORD B OISEST+0.25% 20-11-23	20,000,000	EUR	20,004,174	1.50
ROYA B OISEST+0.33% 05-12-23	20,000,000	EUR	19,998,462	1.50
STAN C OISEST+0.28% 19-02-24	12,000,000	EUR	12,001,653	0.90
THE TO OISEST+0.41% 14-11-23	20,000,000	EUR	20,018,425	1.50
			167,791,752	12.56
Estados Unidos de América				
DANAHER CORP ZCP 060723	8,000,000	EUR	7,980,401	0.60
DANAHER ZCP 30-08-23	6,000,000	EUR	5,965,449	0.45
FIDE NATL INFO SER ZCP 02-08-23	27,000,000	EUR	26,926,087	2.02
FISERV INC 0.375 19-23 01/07A	28,800,000	EUR	28,797,120	2.16
HEWL PACK ENTE ZCP 31-07-23	14,000,000	EUR	13,903,398	1.04
			83,572,455	6.26
Total de bonos			700,186,680	52.41
Floating Rate Notes				
Canadá				
BANK OF MONTREAL FL.R 23-25 06/06Q	26,000,000	EUR	26,029,120	1.95
BANK OF NOVA SCOTIA FL.R 23-25 02/05Q	30,000,000	EUR	30,036,900	2.25
CANADIAN IMPERI FL.R 23-25 24/01Q	14,000,000	EUR	14,034,090	1.05
NATL BANK OF CAN FL.R 22-24 01/02Q	5,000,000	EUR	5,013,125	0.38
NATL BANK OF CANADA FL.R 23-25 13/05Q	15,100,000	EUR	15,105,662	1.13
ROYAL BANK OF CANADA FL.R 23-25 17/01Q	34,801,000	EUR	34,875,996	2.61
TORONTO DOMINION BK FL.R 23-25 20/01Q	34,927,000	EUR	35,023,224	2.62
			160,118,117	11.98
Francia				
BNP PARIBAS FL.R 17-24 07/06Q	32,486,000	EUR	32,669,059	2.45
COMPAGNIE DE SAINT G FL.R 23-24 18/07Q	18,600,000	EUR	18,611,439	1.39
SG FL.R 23-25 13/01Q	30,000,000	EUR	30,022,800	2.25
SOCIETE GENERALE FL.R 17-24 22/05Q	10,000,000	EUR	10,039,600	0.75
			91,342,898	6.84
Alemania				
DAIMLER AG FL.R 17-24 03/07Q	3,900,000	EUR	3,910,374	0.29
			3,910,374	0.29
Irlanda				
BANK OF IRELAND GRP FL.R 19-24 08/07A	5,000,000	EUR	4,998,500	0.37
			4,998,500	0.37
Luxemburgo				
TRATON FINANCE LUXEMBO FL.R 22-23 21/07Q	7,000,000	EUR	7,000,350	0.52
			7,000,350	0.52
Países Bajos				
ABB FINANCE FL.R 22-24 31/03Q	2,473,000	EUR	2,482,274	0.19
ABN AMRO BK FL.R 23-25 10/01Q	29,000,000	EUR	29,034,510	2.17
DAIMLER TRUCK INTL FL.R 22-23 06/10Q	1,500,000	EUR	1,501,665	0.11
ING GROUP NV FL.R 18-23 20/09Q	15,500,000	EUR	15,521,855	1.16
SIKA CAPITAL BV FL.R 23-24 01/11Q	12,000,000	EUR	12,005,760	0.90
THERMO FISHER SCIENTIF FL.R 21-23 18/11Q	14,500,000	EUR	14,497,462	1.09
			75,043,526	5.62
España				
BANCO BILBAO VIZCAYA FL.R 21-23 09/09Q	7,000,000	EUR	7,009,975	0.52

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 2023

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en EUR)	% del activo neto
BANCO NTANDER F.LR 22-24 05/05Q	17,700,000	EUR	17,806,466	1.33
BANCO NTANDER FL.R 23-25 16/01Q	13,500,000	EUR	13,528,688	1.01
BBVA FL.R 21-23 03/12Q	10,000,000	EUR	10,016,200	0.75
			48,361,329	3.62
Reino Unido				
LLOYDS BANKING GROUP FL.R 17-24 21/06Q	9,000,000	EUR	9,039,465	0.68
			9,039,465	0.68
Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en EUR)	% del activo neto
Estados Unidos de América				
AT&T FL.R 23-25 06/03Q	8,322,000	EUR	8,333,900	0.62
AT&T INC FL.R 18-23 05/09Q	27,336,000	EUR	27,363,883	2.05
KRAFT HEINZ FOODS CO FL.R 23-25 09/05Q	5,067,000	EUR	5,073,080	0.38
			40,770,863	3.05
Total de floating rate notes			440,585,422	32.98
Total de valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado regulado			1,140,772,102	85.39
Organismos de inversión colectiva				
Acciones/Participaciones de fondos de inversión				
Francia				
CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV Z C	43,000	EUR	64,557,190	4.83
			64,557,190	4.83
Luxemburgo				
CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO Z C	61,000	EUR	65,126,650	4.87
			65,126,650	4.87
Total de Acciones/Participaciones de fondos de inversión			129,683,840	9.71
Total de Organismos de inversión colectiva			129,683,840	9.71
Total de la cartera de inversiones			1,270,455,942	95.09
Coste de adquisición			1,268,588,829	



Candriam Money Market Euro

Distribución geográfica y económica de la cartera de inversiones a 30 de junio de 2023

Distribución geográfica (en % del activo neto)

Francia	23.24
Reino Unido	13.24
Canadá	11.98
Países Bajos	9.62
Estados Unidos de América	9.31
Bélgica	7.87
Luxemburgo	5.62
Alemania	4.24
España	3.62
Irlanda	3.36
Dinamarca	1.50
Noruega	1.50
	95.09

Distribución económica (en % del activo neto)

Bancos y otras entidades financieras	58.63
Fondos de inversión	12.24
Internet y servicios de Internet	4.39
Comunicación	3.79
Materiales de construcción	3.64
Tabaco y bebidas alcohólicas	1.86
Bonos de Estados, Provincias y municipios	1.83
Neumáticos y caucho	1.12
Construcción de máquinas y aparatos	1.04
Suministros de oficina y ordenadores	1.04
Vehículos de carretera	1.04
Bienes inmuebles	0.89
Servicios varios	0.88
Seguros	0.82
Instituciones inclasificables	0.74
Industria farmacéutica	0.74
Alimentos y bebidas no alcohólicas	0.38
	95.09



Candriam Money Market Euro AAA

Cartera de inversiones a 30 de junio de 2023

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				
Bélgica				
BRUS MUNI REGI FUN ZCP 05-07-23	10,000,000	EUR	9,979,183	2.12
BRUSSELS MUNICIPALIT ZCP 300623	4,000,000	EUR	3,997,357	0.85
KBC BANK NV ZCP 030723	40,000,000	EUR	39,988,670	8.51
			53,965,210	11.48
Dinamarca				
JYSK B OISEST+0.32% 20-11-23	5,000,000	EUR	5,003,785	1.06
			5,003,785	1.06
Finlandia				
OP CORPORATE BANK ZCP 29-09-23	15,000,000	EUR	14,826,980	3.16
			14,826,980	3.16
Francia				
ALLIANZ BANQUE SA 0.21 061223	3,000,000	EUR	2,999,344	0.64
ALLIANZ BANQUE SA 0.21 111223	4,000,000	EUR	3,999,125	0.85
ALLIANZ BANQUE SA 0.22 190424	5,000,000	EUR	4,999,748	1.06
ALLIANZ BANQUE SA 0.22 241123	3,000,000	EUR	2,999,344	0.64
AXA PAR ZCP 110923	10,000,000	EUR	9,910,742	2.11
AXA PAR ZCP 180723	5,000,000	EUR	4,959,660	1.06
BFCM 0.2 070723	15,000,000	EUR	15,000,389	3.19
BFCM B OISEST+0.26% 20-11-23	5,000,000	EUR	5,001,567	1.06
BPCE OISEST+0.26% 22-11-23	5,000,000	EUR	5,002,235	1.06
FRAN TREA BILL BTF ZCP 23-08-23	24,000,000	EUR	23,840,402	5.07
OREAL PAR ZCP 061023	5,000,000	EUR	4,914,590	1.05
PARIS (VILLE DE) ZCP 100723	18,000,000	EUR	17,981,196	3.83
REGION AUVERG RHONE ZCP 200723	18,000,000	EUR	17,953,686	3.82
REGION HAUTS DE FRA ZCP 200723	20,000,000	EUR	19,948,092	4.25
RTE EDF TRANSPORT ZCP 200723	5,000,000	EUR	4,986,911	1.06
SANOFI ZCP 111023	5,000,000	EUR	4,911,849	1.05
			149,408,880	31.80
Alemania				
DEUTSCHE BOERSE AG ZCP 110823	10,000,000	EUR	9,942,464	2.12
MERCEDES-BENZ GROUP 1.625 20-23 22/05A	15,935,000	EUR	15,888,231	3.38
SAP SE ZCP 10-08-23	5,000,000	EUR	4,957,584	1.06
			30,788,279	6.55
Irlanda				
ZURICH FINANCE IRE ZCP 240723	10,000,000	EUR	9,917,951	2.11
			9,917,951	2.11
Luxemburgo				
ABN AMRO BANK 0.50 18-23 17/07A	14,736,000	EUR	14,717,948	3.13
NESTLE FIN ZCP 080823	10,000,000	EUR	9,963,517	2.12
NESTLE FIN ZCP 30-06-23	30,000,000	EUR	29,926,796	6.37
			54,608,261	11.62
Países Bajos				
BMW ZCP 130723	10,000,000	EUR	9,974,771	2.12
COOP R OISEST+0.26% 10-11-23	5,000,000	EUR	5,001,806	1.06
DUTCH TREASURY CERT ZCP 280723	15,000,000	EUR	14,921,236	3.18
TOYOTA MOTOR FIN ZCP 310723	10,000,000	EUR	9,973,234	2.12
			39,871,047	8.49
Noruega				
DNB BA OISEST+0.27% 20-11-23	5,000,000	EUR	5,003,090	1.06
			5,003,090	1.06
Reino Unido				
ABN AMRO BK ZCP 02-10-23	5,000,000	EUR	4,915,458	1.05
BANK O OISEST+0.39% 14-11-23	5,000,000	EUR	5,004,065	1.06
BANK OF NOVA SCOTIA ZCP 300623	10,000,000	GBP	11,464,330	2.44

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 2023

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en EUR)	% del activo neto
BARCLAYS BANK PLC 0.35 111023	5,000,000	EUR	5,000,111	1.06
LLOYDS BANK 0.44 201123	5,000,000	EUR	5,002,858	1.06
Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en EUR)	% del activo neto
NATL A OISEST+0.27% 10-11-23	5,000,000	EUR	5,002,159	1.06
NORD B OISEST+0.25% 20-11-23	5,000,000	EUR	5,001,055	1.06
ROYA B OISEST+0.33% 05-12-23	5,000,000	EUR	4,999,618	1.06
STAN C OISEST+0.28% 19-02-24	4,000,000	EUR	4,000,559	0.85
THE TO OISEST+0.41% 14-11-23	5,000,000	EUR	5,004,645	1.07
			55,394,858	11.79
Estados Unidos de América				
COLGATE PALMOLIVE CO ZCP 180723	15,000,000	EUR	14,967,275	3.19
PROCTER AND GAMBLE C ZCP 060723	15,000,000	EUR	14,885,061	3.17
			29,852,336	6.35
Total de bonos			448,640,677	95.48
Total de valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado regulado			448,640,677	95.48
Total de la cartera de inversiones			448,640,677	95.48
Coste de adquisición			448,320,933	

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 2023

Distribución geográfica (en % del activo neto)

Francia	31.80
Reino Unido	11.79
Luxemburgo	11.62
Bélgica	11.48
Países Bajos	8.49
Alemania	6.55
Estados Unidos de América	6.35
Finlandia	3.16
Irlanda	2.11
Dinamarca	1.06
Noruega	1.06
	95.48

Distribución económica (en % del activo neto)

Bancos y otras entidades financieras	58.45
Bonos de Estados, Provincias y municipios	20.14
Varios bienes de consumo	6.35
Seguros	3.16
Instituciones inclasificables	2.11
Industria farmacéutica	2.09
Internet y servicios de Internet	1.06
Suministros públicos	1.06
Servicios varios	1.05
	95.48



Candriam Money Market USD Sustainable

Cartera de inversiones a 30 de junio de 2023

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				
MACQUARIE ZCP 01-08-23	5,000,000	USD	4,867,450	4.06
			4,867,450	4.06
Bélgica				
AEDIFICA NV/SA ZCP 310723	5,000,000	EUR	5,439,336	4.54
COFINIMMO ZCP 12-07-23	3,500,000	EUR	3,808,732	3.18
			9,248,068	7.71
Canadá				
TORONTO DOMINION ZCP 240124	5,000,000	USD	4,731,709	3.95
			4,731,709	3.95
Dinamarca				
JYSKE BANK DNK ZCP 081123	5,000,000	USD	4,801,975	4.00
			4,801,975	4.00
Francia				
BFCM 3.75 18-23 20/07S	2,400,000	USD	2,398,144	2.00
DANONE 144A 2.589 16-23 02/11S	9,000,000	USD	8,910,630	7.43
LA BANQUE POSTALE ZCP 060224	5,000,000	USD	4,728,531	3.94
			16,037,305	13.37
Japón				
JAPAN TREASURY DISC ZCP 280823	500,000,000	JPY	3,460,081	2.89
TAKEDA PHARMACEUTICAL 4.40 19-23 26/11S	4,006,000	USD	3,982,545	3.32
			7,442,626	6.21
Países Bajos				
ABN AMRO BANK NV ZCP 020224	4,000,000	USD	3,785,033	3.16
COOPERAT RABOBANK UA ZCP 160124	5,000,000	USD	4,736,324	3.95
			8,521,357	7.11
Noruega				
DNB BANK ASA ZCP 060224	5,000,000	USD	4,733,694	3.95
			4,733,694	3.95
Suecia				
SKANDINAVISKA ENSKIL ZCP 180723	4,000,000	USD	3,903,381	3.26
			3,903,381	3.26
Reino Unido				
LLOYDS BANK PLC ZCP 131023	3,000,000	USD	2,888,582	2.41
			2,888,582	2.41
Estados Unidos de América				
BECTON DICKINSON 3.363 17-24 06/06S	3,009,000	USD	2,943,795	2.45
DAIMLER TRUCKS 1.1250 21-23 14/12S	9,250,000	USD	9,056,536	7.55
FISERV INC ZCP 170823	4,700,000	EUR	5,105,295	4.26
KELLOGG CO 2.65 16-23 01/12S	5,819,000	USD	5,757,610	4.80
			22,863,236	19.07
Total de bonos			90,039,383	75.09
Floating Rate Notes				
Canadá				
BANK OF MONTREAL FL.R 21-23 15/09S	3,157,000	USD	3,156,274	2.63
BANK OF NOVA SC FL.R 21-23 15/09Q	600,000	USD	600,087	0.50
BANK OF NOVA SCOTIA FL.R 20-23 16/09Q	4,500,000	USD	4,502,858	3.76
			8,259,219	6.89
Francia				
BPCE FL.R 18-23 12/09Q	4,200,000	USD	4,204,914	3.51
			4,204,914	3.51
Reino Unido				
ASTRAZENECA PLC FL.R 18-23 17/08Q	1,635,000	USD	1,634,943	1.36
			1,634,943	1.36

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 2023

Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en USD)	% del activo neto
Estados Unidos de América				
AMERICAN EXPRESS CO FL.R 21-23 03/11Q	1,441,000	USD	1,439,667	1.20
AMEX SOFRIND F.LR 22-24 03/05Q	1,100,000	USD	1,101,226	0.92
Denominación	Cantidad	Divisa	Valor de mercado (en USD)	% del activo neto
BFCM FL.R 18-23 20/07Q	2,300,000	USD	2,300,368	1.92
			4,841,261	4.04
Total de floating rate notes			18,940,337	15.80
Total de valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado regulado			108,979,720	90.88
Total de la cartera de inversiones			108,979,720	90.88
Coste de adquisición			109,003,820	



Candriam Money Market USD Sustainable

Distribución geográfica y económica de la cartera de inversiones a 30 de junio de 2023

Distribución geográfica (en % del activo neto)

Estados Unidos de América	23.10
Francia	16.88
Canadá	10.83
Bélgica	7.71
Países Bajos	7.11
Japón	6.21
Australia	4.06
Dinamarca	4.00
Noruega	3.95
Reino Unido	3.77
Suecia	3.26
	90.88

Distribución económica (en % del activo neto)

Bancos y otras entidades financieras	49.10
Alimentos y bebidas no alcohólicas	12.23
Fondos de inversión	7.71
Construcción de máquinas y aparatos	7.55
Industria farmacéutica	7.14
Internet y servicios de Internet	4.26
Bonos de Estados, Provincias y municipios	2.89
	90.88



Notas a los estados financieros - Inventario de instrumentos derivados

Contratos de divisas a plazo

A 30 de junio de 2023, 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	11,332,767	GBP	10,000,000	30/06/2023	Société Générale	(255,389)
						(255,389)

Candriam Money Market USD Sustainable

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Contraparte	Latente (en USD)
USD	3,761,608	EUR	3,500,000	12/07/2023	UBS Europe SE	(58,361)
USD	5,488,775	EUR	5,000,000	31/07/2023	UBS Europe SE	26,124
USD	5,143,313	EUR	4,700,000	23/08/2023	Société Générale	2,762
USD	3,549,569	JPY	500,200,000	28/08/2023	Société Générale	58,797
						29,322

Consulte la Nota 7 para las Garantías recibidas/emitidas en relación con los contratos de divisas a plazo.



Notas a los estados financieros - Inventario de instrumentos derivados

Swaps de tipos de interés («IRS»)

A 30 de junio de 2023, los siguientes swaps de tipos de interés estaban pendientes:

Candriam Money Market USD Sustainable

Nominal	Divisa	Fecha de	Contraparte	El subfondo paga	El subfondo recibe	Latente (en USD)
25,000,000	USD	16/07/2023	J.P. Morgan SE	4.940%	USD SOFR COMPOUNDED	2,516
6,500,000	USD	15/09/2023	J.P. Morgan SE	4.720%	USD SOFR COMPOUNDED	7,965
						10,481

Consulte la Nota 7 para las Garantías recibidas/emitidas en relación con los swaps de tipos de interés.



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:

- 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 2023.

Subfondos Candriam Money Market Euro y Candriam Money Market USD Sustainable: el valor liquidativo de cada subfondo se calculó el 3 de julio 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 2023 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 2023:

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

1 EUR =	1.639000	AUD	1 EUR =	0.976050	CHF	1 EUR =	157.687700	JPY	1 EUR =	1.091000	USD
1 EUR =	1.443700	CAD	1 EUR =	7.445950	DKK	1 EUR =	11.784250	SEK			

Para el subfondo Candriam Money Market Euro AAA:

1 EUR =	0.9768	CHF	1 EUR =	7.447	DKK	1 EUR =	0.86295	GBP	1 EUR =	1.08885	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».



Otras notas a los estados financieros

Nota 2 - Principales métodos contables (continuación)

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».

e) Gastos de operaciones

En el periodo cerrado a 30 de junio de 2023, 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 - Comisiones de gestión

Candriam (en adelante, la «Sociedad Gestora»), sociedad limitada por acciones de derecho luxemburgués con domicilio social en SERENITY - Bloc B, 19-21, Route d'Arlon, 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.

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

Así pues, la gestión de la cartera de los subfondos siguientes se delegó a Candriam France: CANDRIAM BONDS Convertible Defensive, CANDRIAM BONDS Credit Opportunities, CANDRIAM BONDS Euro High Yield y CANDRIAM BONDS Global High Yield.

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*.



Otras notas a los estados financieros

Nota 3 - Comisiones de gestión (continuación)

Los tipos en vigor a 30 de junio de 2023 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	0.05%
Candriam Money Market Euro AAA	Z	Capitalización	LU0391999124	0.00%
	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%
Candriam Money Market Usd Sustainable	V	Capitalización	LU0354092115	0.05%
	V	Distribución	LU0354092206	0.05%
	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 2023 a los OICVM en que invierte Candriam Money Market.

Fondo objetivo	Tipo máximo
CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV Z CAPITALISATION	0.15%
CANDRIAM SUS MONEY MARKET EURO Z EUR C Z CAPITALISATION	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 2023 son:

Subfondos	Clase de acciones	Tipo de acciones	ISIN	Tipo 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%
Candriam Money Market Euro AAA	Z	Capitalización	LU0391999124	0.17%
	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%
Candriam Money Market USD Sustainable	V	Capitalización	LU0354092115	0.17%
	V	Distribución	LU0354092206	0.17%
	Z	Capitalización	LU0391999470	0.17%
	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 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 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 6 - Depósitos a plazo

Candriam Money Market Euro AAA

Contraparte	Fecha de	Importe (en EUR)
NATIXIS (CAPITAL MARKET)	30/06/2023	26,000,000

Nota 7 - Garantía

En relación con los instrumentos derivados OTC, se ha recibido efectivo como garantía de Société Générale S.A.:

Subfondos	Divisa	Garantía en efectivo pagada	Garantía en efectivo mantenida
Candriam Money Market Euro AAA	EUR	(260,000)	0



Otras notas a los estados financieros

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.