

# Candriam Bonds

R.C.S. Luxemburgo B-30659



SICAV de derecho luxemburgués

Informe semestral no auditado al 30 de junio de 2021

# Candriam Bonds

SICAV de derecho luxemburgués

Informe semestral no auditado del período  
del 1 de enero de 2021 al 30 de junio de 2021

# Candriam Bonds

---

## Indice

|                                                                                                          |     |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
| Administración de la SICAV                                                                               | 4   |
| Detalles de la SICAV                                                                                     | 5   |
| Estado del activo neto al 30 de junio de 2021                                                            | 6   |
| Variaciones de los activos netos del período cerrado al 30 de junio de 2021                              | 14  |
| Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021                         | 30  |
| Estadísticas                                                                                             | 30  |
| Cartera de valores / Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021 | 89  |
| Candriam Bonds Capital Securities                                                                        | 89  |
| Candriam Bonds Convertible Defensive                                                                     | 93  |
| Candriam Bonds Credit Alpha                                                                              | 97  |
| Candriam Bonds Credit Opportunities                                                                      | 100 |
| Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies                                                            | 104 |
| Candriam Bonds Emerging Markets                                                                          | 108 |
| Candriam Bonds Emerging Markets Corporate                                                                | 115 |
| Candriam Bonds Emerging Markets Total Return                                                             | 120 |
| Candriam Bonds Euro                                                                                      | 124 |
| Candriam Bonds Euro Corporate                                                                            | 133 |
| Candriam Bonds Euro Diversified                                                                          | 140 |
| Candriam Bonds Euro Government                                                                           | 148 |
| Candriam Bonds Euro High Yield                                                                           | 153 |
| Candriam Bonds Euro Long Term                                                                            | 158 |
| Candriam Bonds Euro Short Term                                                                           | 164 |
| Candriam Bonds Floating Rate Notes                                                                       | 172 |
| Candriam Bonds Global Government                                                                         | 176 |
| Candriam Bonds Global High Yield                                                                         | 181 |
| Candriam Bonds Global Inflation Short Duration                                                           | 185 |
| Candriam Bonds International                                                                             | 188 |
| Candriam Bonds Total Return                                                                              | 194 |
| Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados                                        | 205 |
| Otras notas a los estados financieros                                                                    | 225 |
| Información suplementaria                                                                                | 246 |

No se aceptará ninguna suscripción con base a los informes financieros. Las suscripciones tan sólo son válidas cuando se reciban sobre la base del folleto de emisión, acompañado del último informe anual y, tras su publicación, del último informe semestral.

# Candriam Bonds

---

## Administración de la SICAV

### Consejo de Administración

#### Presidente

Jean-Yves MALDAGUE  
Managing Director, Candriam Luxembourg

#### Consejeros

Annemarie ARENS  
Independent Director

Thierry BLONDEAU (desde el 20 de abril de 2021)  
Independent Director

Isabelle CABIE  
Head of Sustainable and Responsible Investment, Candriam Belgium

Pascal DEQUENNE  
Global Head of Operations, Candriam Belgium

Vincent HAMELINK  
Member of the Group Strategic Committee, Candriam Belgium

Koen VAN DE MAELE  
Global Head of Investment Solutions, Candriam Belgium

Jan VERGOTE  
Head of Investment Strategy, Belfius Banque S.A.

### Domicilio social

5, Allée Scheffer  
L-2520 Luxemburgo

### Custodio y Agente de Pagos

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

### Sociedad Gestora

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

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

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

La realización de la **Gestión de Cartera** de determinados compartimentos se ha delegado en:

Candriam Belgium  
58, Avenue des Arts  
B-1000 Bruselas

La realización de la **Gestión de Cartera** de otros compartimentos se ha delegado en:

Candriam France  
40, rue Washington  
F-75408 Paris Cedex 08

La ejecución de las **operaciones de préstamo y empréstito de valores** se delega a:

Candriam France  
40, rue Washington  
F-75408 Paris Cedex 08

Para los compartimentos Candriam Bonds Convertible Defensive y Candriam Bonds Convertible Opportunities, la ejecución de **las operaciones de préstamo y empréstito de valores** está subdelegada a:

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

### Réviseur d'entreprises agréé

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

### Servicios financieros

– en el Gran Ducado de Luxemburgo  
Banque Internationale à Luxembourg S.A.  
69, Route d'Esch  
L-1470 Luxemburgo

– en Bélgica  
Belfius Banque S.A.  
11, Place Rogier  
B-1210 Bruselas

### Agente de Pagos en Austria

Erste Bank AG  
Graben 21,  
A-1010 Viena

### Detalles de la SICAV

La Junta General Ordinaria 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.

La convocatoria de todas las Juntas Generales se enviará por correo certificado a todos los Accionistas nominativos, con una antelación mínima de 8 días respecto de la Junta, a la dirección que figure en el registro de Accionistas. 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.

Dichas notificaciones también se publicarán en la prensa de los países en los que se comercialice la SICAV, cuando así lo exija la legislación de dichos países.

Los informes para los Accionistas sobre el ejercicio anterior y los resultados están disponibles en el domicilio social de la SICAV.

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

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

# Candriam Bonds

Estado del activo neto al 30 de junio de 2021

|                                                                |          | Candriam Bonds<br>Capital Securities | Candriam Bonds<br>Convertible<br>Defensive | Candriam Bonds<br>Credit Alpha |
|----------------------------------------------------------------|----------|--------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------|
|                                                                |          | EUR                                  | EUR                                        | EUR                            |
| <b>Activo</b>                                                  |          |                                      |                                            |                                |
| Cartera de valores por su valor de evaluación                  | 2a       | 48.195.531                           | 282.087.125                                | 69.074.646                     |
| Opciones (posición larga) al valor de mercado                  | 2e       | 0                                    | 0                                          | 0                              |
| Efectivos en banco e intermediario financiero                  | 11       | 995.237                              | 23.070.384                                 | 6.760.210                      |
| Inversiones vendidas a cobrar                                  |          | 0                                    | 0                                          | 859.052                        |
| Suscripciones a cobrar                                         |          | 0                                    | 62.902                                     | 0                              |
| Cuentas por cobrar en CFD                                      |          | 0                                    | 0                                          | 69.168                         |
| Cuentas a cobrar por pactos de recompra inversa                | 2i,8     | 0                                    | 0                                          | 24.997.952                     |
| Divisas a cobrar                                               |          | 0                                    | 0                                          | 0                              |
| Interés y dividendos a cobrar, netos                           |          | 583.049                              | 205.269                                    | 1.031.971                      |
| Plusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo  | 2f,2g    | 0                                    | 0                                          | 0                              |
| Plusvalía neta sin realizar sobre futuros                      | 2e       | 0                                    | 114.375                                    | 33.151                         |
| Plusvalía neta sin realizar sobre swaps                        | 2i,2j,2k | 0                                    | 0                                          | 188.713                        |
| <b>Total activo</b>                                            |          | <b>49.773.818</b>                    | <b>305.540.056</b>                         | <b>103.014.863</b>             |
| <b>Pasivo</b>                                                  |          |                                      |                                            |                                |
| Opciones (posición corta) al valor de mercado                  | 2e       | 0                                    | 0                                          | 0                              |
| Descubiertos bancarios                                         |          | 0                                    | 0                                          | 0                              |
| Inversiones compradas a pagar                                  |          | 0                                    | 1.646.007                                  | 843.242                        |
| Recompras a pagar                                              |          | 0                                    | 355.288                                    | 0                              |
| Pagar en CFD                                                   |          | 0                                    | 0                                          | 7.157                          |
| Swaps a pagar                                                  |          | 0                                    | 0                                          | 6.247                          |
| Divisas a pagar                                                |          | 0                                    | 0                                          | 0                              |
| Minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | 238.225                              | 2.736.222                                  | 62.387                         |
| Minusvalía neta sin realizar sobre futuros                     | 2e       | 20.673                               | 0                                          | 0                              |
| Minusvalía neta sin realizar sobre CFD                         | 2h       | 0                                    | 0                                          | 19.241                         |
| Minusvalía neta sin realizar sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 0                                    | 0                                          | 0                              |
| Comisiones de gestión a pagar                                  | 3        | 1.216                                | 26.280                                     | 832                            |
| Gastos Operativos y Administrativos a pagar                    | 4        | 5.443                                | 27.250                                     | 10.203                         |
| Comisiones sobre rentabilidad a pagar                          | 5        | 0                                    | 20.913                                     | 76.302                         |
| "Taxe d'abonnement" (Tasa de suscripción) a pagar              | 6        | 1.238                                | 23.565                                     | 2.550                          |
| Otros gastos a pagar                                           |          | 617                                  | 49.909                                     | 0                              |
| <b>Total pasivo</b>                                            |          | <b>267.412</b>                       | <b>4.885.434</b>                           | <b>1.028.161</b>               |
| <b>Total del activo neto</b>                                   |          | <b>49.506.406</b>                    | <b>300.654.622</b>                         | <b>101.986.702</b>             |

# Candriam Bonds

Estado del activo neto al 30 de junio de 2021

|                                                                |          | Candriam Bonds<br>Credit Opportunities | Candriam Bonds<br>Emerging Debt Local<br>Currencies | Candriam Bonds<br>Emerging Markets |
|----------------------------------------------------------------|----------|----------------------------------------|-----------------------------------------------------|------------------------------------|
|                                                                |          | EUR                                    | USD                                                 | USD                                |
| <b>Activo</b>                                                  |          |                                        |                                                     |                                    |
| Cartera de valores por su valor de evaluación                  | 2a       | 1.481.660.802                          | 294.360.098                                         | 1.128.418.869                      |
| Opciones (posición larga) al valor de mercado                  | 2e       | 0                                      | 0                                                   | 0                                  |
| Efectivos en banco e intermediario financiero                  | 11       | 124.767.367                            | 28.817.745                                          | 56.238.574                         |
| Inversiones vendidas a cobrar                                  |          | 0                                      | 0                                                   | 1.467.227                          |
| Suscripciones a cobrar                                         |          | 2.167.452                              | 143.240                                             | 415.028                            |
| Cuentas por cobrar en CFD                                      |          | 0                                      | 0                                                   | 0                                  |
| Cuentas a cobrar por pactos de recompra inversa                | 2l,8     | 0                                      | 0                                                   | 0                                  |
| Divisas a cobrar                                               |          | 0                                      | 26.437.442                                          | 0                                  |
| Interés y dividendos a cobrar, netos                           |          | 12.903.136                             | 8.656.358                                           | 21.225.565                         |
| Plusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo  | 2f,2g    | 0                                      | 0                                                   | 0                                  |
| Plusvalía neta sin realizar sobre futuros                      | 2e       | 0                                      | 0                                                   | 0                                  |
| Plusvalía neta sin realizar sobre swaps                        | 2i,2j,2k | 0                                      | 0                                                   | 0                                  |
| <b>Total activo</b>                                            |          | <b>1.621.498.757</b>                   | <b>358.414.883</b>                                  | <b>1.207.765.263</b>               |
| <b>Pasivo</b>                                                  |          |                                        |                                                     |                                    |
| Opciones (posición corta) al valor de mercado                  | 2e       | 1.346.926                              | 0                                                   | 0                                  |
| Descubiertos bancarios                                         |          | 0                                      | 8.140.952                                           | 0                                  |
| Inversiones compradas a pagar                                  |          | 0                                      | 0                                                   | 2.751.094                          |
| Recompras a pagar                                              |          | 20.058.953                             | 686.999                                             | 501.865                            |
| Pagar en CFD                                                   |          | 0                                      | 0                                                   | 0                                  |
| Swaps a pagar                                                  |          | 0                                      | 0                                                   | 0                                  |
| Divisas a pagar                                                |          | 0                                      | 26.403.288                                          | 0                                  |
| Minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | 1.106.886                              | 252.774                                             | 4.442.591                          |
| Minusvalía neta sin realizar sobre futuros                     | 2e       | 132.275                                | 374.392                                             | 4.305.826                          |
| Minusvalía neta sin realizar sobre CFD                         | 2h       | 171.820                                | 0                                                   | 0                                  |
| Minusvalía neta sin realizar sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 19.418.354                             | 1.589.515                                           | 0                                  |
| Comisiones de gestión a pagar                                  | 3        | 677.927                                | 152.621                                             | 512.263                            |
| Gastos Operativos y Administrativos a pagar                    | 4        | 193.216                                | 45.970                                              | 152.129                            |
| Comisiones sobre rentabilidad a pagar                          | 5        | 6.293.140                              | 0                                                   | 595.539                            |
| "Taxe d'abonnement" (Tasa de suscripción) a pagar              | 6        | 72.330                                 | 94.657                                              | 137.917                            |
| Otros gastos a pagar                                           |          | 37.528                                 | 12.576                                              | 50.612                             |
| <b>Total pasivo</b>                                            |          | <b>49.509.355</b>                      | <b>37.753.744</b>                                   | <b>13.449.836</b>                  |
| <b>Total del activo neto</b>                                   |          | <b>1.571.989.402</b>                   | <b>320.661.139</b>                                  | <b>1.194.315.427</b>               |

# Candriam Bonds

Estado del activo neto al 30 de junio de 2021

|                                                                |          | Candriam Bonds<br>Emerging Markets<br>Corporate | Candriam Bonds<br>Emerging Markets<br>Total Return | Candriam Bonds<br>Euro |
|----------------------------------------------------------------|----------|-------------------------------------------------|----------------------------------------------------|------------------------|
|                                                                |          | USD                                             | USD                                                | EUR                    |
| <b>Activo</b>                                                  |          |                                                 |                                                    |                        |
| Cartera de valores por su valor de evaluación                  | 2a       | 153.618.841                                     | 65.276.866                                         | 538.498.375            |
| Opciones (posición larga) al valor de mercado                  | 2e       | 0                                               | 0                                                  | 331.816                |
| Efectivos en banco e intermediario financiero                  | 11       | 2.800.652                                       | 4.693.688                                          | 6.303.713              |
| Inversiones vendidas a cobrar                                  |          | 733.614                                         | 366.807                                            | 3.751.876              |
| Suscripciones a cobrar                                         |          | 115.258                                         | 0                                                  | 191.850                |
| Cuentas por cobrar en CFD                                      |          | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| Cuentas a cobrar por pactos de recompra inversa                | 2l,8     | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| Divisas a cobrar                                               |          | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| Interés y dividendos a cobrar, netos                           |          | 1.889.440                                       | 945.947                                            | 2.123.434              |
| Plusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo  | 2f,2g    | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| Plusvalía neta sin realizar sobre futuros                      | 2e       | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| Plusvalía neta sin realizar sobre swaps                        | 2i,2j,2k | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| <b>Total activo</b>                                            |          | <b>159.157.805</b>                              | <b>71.283.307</b>                                  | <b>551.201.064</b>     |
| <b>Pasivo</b>                                                  |          |                                                 |                                                    |                        |
| Opciones (posición corta) al valor de mercado                  | 2e       | 0                                               | 0                                                  | 165.908                |
| Descubiertos bancarios                                         |          | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| Inversiones compradas a pagar                                  |          | 522.101                                         | 197.336                                            | 4.477.735              |
| Recompras a pagar                                              |          | 42.278                                          | 244.431                                            | 227.352                |
| Pagar en CFD                                                   |          | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| Swaps a pagar                                                  |          | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| Divisas a pagar                                                |          | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| Minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | 279.892                                         | 224.221                                            | 216.741                |
| Minusvalía neta sin realizar sobre futuros                     | 2e       | 124.750                                         | 277.895                                            | 231.000                |
| Minusvalía neta sin realizar sobre CFD                         | 2h       | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| Minusvalía neta sin realizar sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 0                                               | 53.174                                             | 458.542                |
| Comisiones de gestión a pagar                                  | 3        | 15.728                                          | 1.016                                              | 37.012                 |
| Gastos Operativos y Administrativos a pagar                    | 4        | 18.472                                          | 6.649                                              | 49.622                 |
| Comisiones sobre rentabilidad a pagar                          | 5        | 8.006                                           | 0                                                  | 60.351                 |
| "Taxe d'abonnement" (Tasa de suscripción) a pagar              | 6        | 6.834                                           | 1.650                                              | 40.119                 |
| Otros gastos a pagar                                           |          | 4.076                                           | 2.432                                              | 0                      |
| <b>Total pasivo</b>                                            |          | <b>1.022.137</b>                                | <b>1.008.804</b>                                   | <b>5.964.382</b>       |
| <b>Total del activo neto</b>                                   |          | <b>158.135.668</b>                              | <b>70.274.503</b>                                  | <b>545.236.682</b>     |

# Candriam Bonds

Estado del activo neto al 30 de junio de 2021

|                                                                |          | Candriam Bonds<br>Euro Corporate | Candriam Bonds<br>Euro Diversified | Candriam Bonds<br>Euro Government |
|----------------------------------------------------------------|----------|----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|
|                                                                |          | EUR                              | EUR                                | EUR                               |
| <b>Activo</b>                                                  |          |                                  |                                    |                                   |
| Cartera de valores por su valor de evaluación                  | 2a       | 809.657.676                      | 619.640.692                        | 816.876.698                       |
| Opciones (posición larga) al valor de mercado                  | 2e       | 16.345                           | 381.567                            | 505.945                           |
| Efectivos en banco e intermediario financiero                  | 11       | 66.720.424                       | 10.363.480                         | 8.043.580                         |
| Inversiones vendidas a cobrar                                  |          | 16.643.095                       | 3.183.050                          | 0                                 |
| Suscripciones a cobrar                                         |          | 9.999                            | 1.296                              | 312.220                           |
| Cuentas por cobrar en CFD                                      |          | 0                                | 0                                  | 0                                 |
| Cuentas a cobrar por pactos de recompra inversa                | 2l,8     | 0                                | 0                                  | 0                                 |
| Divisas a cobrar                                               |          | 0                                | 0                                  | 0                                 |
| Interés y dividendos a cobrar, netos                           |          | 4.581.497                        | 2.483.791                          | 5.285.635                         |
| Plusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo  | 2f,2g    | 0                                | 0                                  | 0                                 |
| Plusvalía neta sin realizar sobre futuros                      | 2e       | 84.722                           | 0                                  | 0                                 |
| Plusvalía neta sin realizar sobre swaps                        | 2i,2j,2k | 2.450.061                        | 0                                  | 0                                 |
| <b>Total activo</b>                                            |          | <b>900.163.819</b>               | <b>636.053.876</b>                 | <b>831.024.078</b>                |
| <b>Pasivo</b>                                                  |          |                                  |                                    |                                   |
| Opciones (posición corta) al valor de mercado                  | 2e       | 8.311                            | 190.783                            | 252.972                           |
| Descubiertos bancarios                                         |          | 0                                | 0                                  | 0                                 |
| Inversiones compradas a pagar                                  |          | 575.089                          | 3.395.600                          | 1.539.105                         |
| Recompras a pagar                                              |          | 3.405.555                        | 258.379                            | 823.696                           |
| Pagar en CFD                                                   |          | 0                                | 0                                  | 0                                 |
| Swaps a pagar                                                  |          | 0                                | 0                                  | 0                                 |
| Divisas a pagar                                                |          | 0                                | 0                                  | 0                                 |
| Minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | 948.999                          | 308.394                            | 18.906                            |
| Minusvalía neta sin realizar sobre futuros                     | 2e       | 0                                | 276.420                            | 544.353                           |
| Minusvalía neta sin realizar sobre CFD                         | 2h       | 0                                | 0                                  | 0                                 |
| Minusvalía neta sin realizar sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 0                                | 1.487.163                          | 0                                 |
| Comisiones de gestión a pagar                                  | 3        | 39.587                           | 22.788                             | 114.475                           |
| Gastos Operativos y Administrativos a pagar                    | 4        | 77.503                           | 55.867                             | 74.129                            |
| Comisiones sobre rentabilidad a pagar                          | 5        | 162.799                          | 10.605                             | 120.479                           |
| "Taxe d'abonnement" (Tasa de suscripción) a pagar              | 6        | 23.477                           | 20.156                             | 40.621                            |
| Otros gastos a pagar                                           |          | 21.157                           | 9.312                              | 10.299                            |
| <b>Total pasivo</b>                                            |          | <b>5.262.477</b>                 | <b>6.035.467</b>                   | <b>3.539.035</b>                  |
| <b>Total del activo neto</b>                                   |          | <b>894.901.342</b>               | <b>630.018.409</b>                 | <b>827.485.043</b>                |

# Candriam Bonds

Estado del activo neto al 30 de junio de 2021

|                                                                |          | Candriam Bonds<br>Euro High Yield | Candriam Bonds<br>Euro Long Term | Candriam Bonds<br>Euro Short Term |
|----------------------------------------------------------------|----------|-----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|
|                                                                |          | EUR                               | EUR                              | EUR                               |
| <b>Activo</b>                                                  |          |                                   |                                  |                                   |
| Cartera de valores por su valor de evaluación                  | 2a       | 3.128.654.523                     | 101.548.735                      | 1.444.466.305                     |
| Opciones (posición larga) al valor de mercado                  | 2e       | 0                                 | 63.243                           | 0                                 |
| Efectivos en banco e intermediario financiero                  | 11       | 27.755.727                        | 902.817                          | 4.546.560                         |
| Inversiones vendidas a cobrar                                  |          | 72.595.365                        | 626.286                          | 0                                 |
| Suscripciones a cobrar                                         |          | 3.117.050                         | 326                              | 2.531.401                         |
| Cuentas por cobrar en CFD                                      |          | 0                                 | 0                                | 0                                 |
| Cuentas a cobrar por pactos de recompra inversa                | 2l,8     | 0                                 | 0                                | 0                                 |
| Divisas a cobrar                                               |          | 0                                 | 0                                | 0                                 |
| Interés y dividendos a cobrar, netos                           |          | 34.869.154                        | 625.438                          | 8.763.347                         |
| Plusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo  | 2f,2g    | 515.190                           | 0                                | 0                                 |
| Plusvalía neta sin realizar sobre futuros                      | 2e       | 0                                 | 6.329                            | 317.513                           |
| Plusvalía neta sin realizar sobre swaps                        | 2i,2j,2k | 3.725.821                         | 0                                | 0                                 |
| <b>Total activo</b>                                            |          | <b>3.271.232.829</b>              | <b>103.773.174</b>               | <b>1.460.625.126</b>              |
| <b>Pasivo</b>                                                  |          |                                   |                                  |                                   |
| Opciones (posición corta) al valor de mercado                  | 2e       | 0                                 | 31.622                           | 0                                 |
| Descubiertos bancarios                                         |          | 0                                 | 0                                | 0                                 |
| Inversiones compradas a pagar                                  |          | 10.992.534                        | 862.916                          | 6.152.977                         |
| Recompras a pagar                                              |          | 4.786.618                         | 209.172                          | 1.787.664                         |
| Pagar en CFD                                                   |          | 0                                 | 0                                | 0                                 |
| Swaps a pagar                                                  |          | 0                                 | 0                                | 0                                 |
| Divisas a pagar                                                |          | 0                                 | 0                                | 0                                 |
| Minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | 0                                 | 23.770                           | 1.838.087                         |
| Minusvalía neta sin realizar sobre futuros                     | 2e       | 1.639.570                         | 0                                | 0                                 |
| Minusvalía neta sin realizar sobre CFD                         | 2h       | 0                                 | 0                                | 0                                 |
| Minusvalía neta sin realizar sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 0                                 | 86.751                           | 0                                 |
| Comisiones de gestión a pagar                                  | 3        | 1.324.685                         | 6.688                            | 178.596                           |
| Gastos Operativos y Administrativos a pagar                    | 4        | 344.413                           | 9.438                            | 126.008                           |
| Comisiones sobre rentabilidad a pagar                          | 5        | 692.594                           | 296                              | 62.217                            |
| "Taxe d'abonnement" (Tasa de suscripción) a pagar              | 6        | 269.090                           | 5.029                            | 56.664                            |
| Otros gastos a pagar                                           |          | 70.296                            | 1.641                            | 38.084                            |
| <b>Total pasivo</b>                                            |          | <b>20.119.800</b>                 | <b>1.237.323</b>                 | <b>10.240.297</b>                 |
| <b>Total del activo neto</b>                                   |          | <b>3.251.113.029</b>              | <b>102.535.851</b>               | <b>1.450.384.829</b>              |

## Candriam Bonds

Estado del activo neto al 30 de junio de 2021

|                                                                |          | Candriam Bonds<br>Floating Rate Notes | Candriam Bonds<br>Global Government | Candriam Bonds<br>Global High Yield |
|----------------------------------------------------------------|----------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|                                                                |          | EUR                                   | EUR                                 | EUR                                 |
| <b>Activo</b>                                                  |          |                                       |                                     |                                     |
| Cartera de valores por su valor de evaluación                  | 2a       | 551.140.346                           | 127.428.105                         | 292.960.580                         |
| Opciones (posición larga) al valor de mercado                  | 2e       | 0                                     | 0                                   | 0                                   |
| Efectivos en banco e intermediario financiero                  | 11       | 2.772.766                             | 4.433.263                           | 27.335.484                          |
| Inversiones vendidas a cobrar                                  |          | 0                                     | 1.212.223                           | 7.788.884                           |
| Suscripciones a cobrar                                         |          | 0                                     | 192.465                             | 374.239                             |
| Cuentas por cobrar en CFD                                      |          | 0                                     | 0                                   | 0                                   |
| Cuentas a cobrar por pactos de recompra inversa                | 2l,8     | 0                                     | 0                                   | 0                                   |
| Divisas a cobrar                                               |          | 0                                     | 834.649                             | 0                                   |
| Interés y dividendos a cobrar, netos                           |          | 1.124.516                             | 549.934                             | 3.555.731                           |
| Plusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo  | 2f,2g    | 0                                     | 52.000                              | 0                                   |
| Plusvalía neta sin realizar sobre futuros                      | 2e       | 45.272                                | 0                                   | 0                                   |
| Plusvalía neta sin realizar sobre swaps                        | 2i,2j,2k | 0                                     | 0                                   | 0                                   |
| <b>Total activo</b>                                            |          | <b>555.082.901</b>                    | <b>134.702.639</b>                  | <b>332.014.918</b>                  |
| <b>Pasivo</b>                                                  |          |                                       |                                     |                                     |
| Opciones (posición corta) al valor de mercado                  | 2e       | 0                                     | 0                                   | 0                                   |
| Descubiertos bancarios                                         |          | 101.800                               | 0                                   | 0                                   |
| Inversiones compradas a pagar                                  |          | 908.699                               | 307.622                             | 20.315.319                          |
| Recompras a pagar                                              |          | 1.502.630                             | 1.898.582                           | 707.544                             |
| Pagar en CFD                                                   |          | 0                                     | 0                                   | 0                                   |
| Swaps a pagar                                                  |          | 0                                     | 0                                   | 0                                   |
| Divisas a pagar                                                |          | 0                                     | 837.678                             | 0                                   |
| Minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | 2.810.437                             | 0                                   | 964.298                             |
| Minusvalía neta sin realizar sobre futuros                     | 2e       | 0                                     | 85.297                              | 4.400                               |
| Minusvalía neta sin realizar sobre CFD                         | 2h       | 0                                     | 0                                   | 0                                   |
| Minusvalía neta sin realizar sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 0                                     | 9.323                               | 0                                   |
| Comisiones de gestión a pagar                                  | 3        | 18.929                                | 22.645                              | 173.236                             |
| Gastos Operativos y Administrativos a pagar                    | 4        | 34.347                                | 11.903                              | 41.964                              |
| Comisiones sobre rentabilidad a pagar                          | 5        | 0                                     | 0                                   | 233.755                             |
| "Taxe d'abonnement" (Tasa de suscripción) a pagar              | 6        | 17.342                                | 6.024                               | 25.746                              |
| Otros gastos a pagar                                           |          | 994                                   | 2.391                               | 4.697                               |
| <b>Total pasivo</b>                                            |          | <b>5.395.178</b>                      | <b>3.181.465</b>                    | <b>22.470.959</b>                   |
| <b>Total del activo neto</b>                                   |          | <b>549.687.723</b>                    | <b>131.521.174</b>                  | <b>309.543.959</b>                  |

## Candriam Bonds

Estado del activo neto al 30 de junio de 2021

|                                                                |          | Candriam Bonds<br>Global Inflation Short<br>Duration | Candriam Bonds<br>International | Candriam Bonds<br>Total Return |
|----------------------------------------------------------------|----------|------------------------------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|
|                                                                |          | EUR                                                  | EUR                             | EUR                            |
| <b>Activo</b>                                                  |          |                                                      |                                 |                                |
| Cartera de valores por su valor de evaluación                  | 2a       | 251.775.537                                          | 107.749.531                     | 857.657.922                    |
| Opciones (posición larga) al valor de mercado                  | 2e       | 0                                                    | 67.459                          | 0                              |
| Efectivos en banco e intermediario financiero                  | 11       | 7.452.986                                            | 2.950.162                       | 139.153.513                    |
| Inversiones vendidas a cobrar                                  |          | 746.361                                              | 939.276                         | 2.843.945                      |
| Suscripciones a cobrar                                         |          | 114.719                                              | 1.094                           | 364.083                        |
| Cuentas por cobrar en CFD                                      |          | 0                                                    | 0                               | 0                              |
| Cuentas a cobrar por pactos de recompra inversa                | 2l,8     | 0                                                    | 0                               | 0                              |
| Divisas a cobrar                                               |          | 716.697                                              | 244.251                         | 0                              |
| Interés y dividendos a cobrar, netos                           |          | 632.381                                              | 454.598                         | 5.505.986                      |
| Plusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo  | 2f,2g    | 0                                                    | 0                               | 0                              |
| Plusvalía neta sin realizar sobre futuros                      | 2e       | 0                                                    | 0                               | 0                              |
| Plusvalía neta sin realizar sobre swaps                        | 2i,2j,2k | 0                                                    | 0                               | 0                              |
| <b>Total activo</b>                                            |          | <b>261.438.681</b>                                   | <b>112.406.371</b>              | <b>1.005.525.449</b>           |
| <b>Pasivo</b>                                                  |          |                                                      |                                 |                                |
| Opciones (posición corta) al valor de mercado                  | 2e       | 0                                                    | 33.730                          | 0                              |
| Descubiertos bancarios                                         |          | 0                                                    | 1.130                           | 0                              |
| Inversiones compradas a pagar                                  |          | 0                                                    | 1.091.501                       | 9.888.636                      |
| Recompras a pagar                                              |          | 451.716                                              | 144.818                         | 1.885.095                      |
| Pagar en CFD                                                   |          | 0                                                    | 0                               | 0                              |
| Swaps a pagar                                                  |          | 0                                                    | 0                               | 0                              |
| Divisas a pagar                                                |          | 713.710                                              | 244.627                         | 0                              |
| Minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | 5.357.167                                            | 947.900                         | 6.570.388                      |
| Minusvalía neta sin realizar sobre futuros                     | 2e       | 180.690                                              | 29.326                          | 2.730.019                      |
| Minusvalía neta sin realizar sobre CFD                         | 2h       | 0                                                    | 0                               | 0                              |
| Minusvalía neta sin realizar sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 8.964                                                | 247.861                         | 8.630.014                      |
| Comisiones de gestión a pagar                                  | 3        | 30.083                                               | 32.831                          | 331.484                        |
| Gastos Operativos y Administrativos a pagar                    | 4        | 26.933                                               | 15.710                          | 97.583                         |
| Comisiones sobre rentabilidad a pagar                          | 5        | 0                                                    | 2.102                           | 25.346                         |
| "Taxe d'abonnement" (Tasa de suscripción) a pagar              | 6        | 11.335                                               | 22.479                          | 56.967                         |
| Otros gastos a pagar                                           |          | 4.074                                                | 2.400                           | 18.080                         |
| <b>Total pasivo</b>                                            |          | <b>6.784.672</b>                                     | <b>2.816.415</b>                | <b>30.233.612</b>              |
| <b>Total del activo neto</b>                                   |          | <b>254.654.009</b>                                   | <b>109.589.956</b>              | <b>975.291.837</b>             |

# Candriam Bonds

Estado del activo neto al 30 de junio de 2021

|                                                                |          | Combinado             |
|----------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
|                                                                |          | EUR                   |
| <b>Activo</b>                                                  |          |                       |
| Cartera de valores por su valor de evaluación                  | 2a       | 12.913.401.214        |
| Opciones (posición larga) al valor de mercado                  | 2e       | 1.366.375             |
| Efectivos en banco e intermediario financiero                  | 11       | 542.370.222           |
| Inversiones vendidas a cobrar                                  |          | 113.354.560           |
| Suscripciones a cobrar                                         |          | 10.009.041            |
| Cuentas por cobrar en CFD                                      |          | 69.168                |
| Cuentas a cobrar por pactos de recompra inversa                | 2l,8     | 24.997.952            |
| Divisas a cobrar                                               |          | 24.088.743            |
| Interés y dividendos a cobrar, netos                           |          | 112.867.458           |
| Plusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo  | 2f,2g    | 567.190               |
| Plusvalía neta sin realizar sobre futuros                      | 2e       | 601.362               |
| Plusvalía neta sin realizar sobre swaps                        | 2i,2j,2k | 6.364.595             |
| <b>Total activo</b>                                            |          | <b>13.750.057.880</b> |
| <b>Pasivo</b>                                                  |          |                       |
| Opciones (posición corta) al valor de mercado                  | 2e       | 2.030.252             |
| Descubiertos bancarios                                         |          | 6.967.718             |
| Inversiones compradas a pagar                                  |          | 65.923.478            |
| Recompras a pagar                                              |          | 39.747.326            |
| Pagar en CFD                                                   |          | 7.157                 |
| Swaps a pagar                                                  |          | 6.247                 |
| Divisas a pagar                                                |          | 24.060.361            |
| Minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | 28.533.222            |
| Minusvalía neta sin realizar sobre futuros                     | 2e       | 10.160.104            |
| Minusvalía neta sin realizar sobre CFD                         | 2h       | 191.061               |
| Minusvalía neta sin realizar sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 31.732.155            |
| Comisiones de gestión a pagar                                  | 3        | 3.614.071             |
| Gastos Operativos y Administrativos a pagar                    | 4        | 1.389.760             |
| Comisiones sobre rentabilidad a pagar                          | 5        | 8.269.833             |
| "Taxe d'abonnement" (Tasa de suscripción) a pagar              | 6        | 898.002               |
| Otros gastos a pagar                                           |          | 330.250               |
| <b>Total pasivo</b>                                            |          | <b>223.860.997</b>    |
| <b>Total del activo neto</b>                                   |          | <b>13.526.196.883</b> |

# Candriam Bonds

Variaciones de los activos netos del período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                                              |          | Candriam Bonds<br>Capital Securities | Candriam Bonds<br>Convertible<br>Defensive | Candriam Bonds<br>Credit Alpha |
|------------------------------------------------------------------------------|----------|--------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------|
|                                                                              |          | EUR                                  | EUR                                        | EUR                            |
| <b>Activos netos al inicio del periodo</b>                                   |          | <b>45.177.094</b>                    | <b>273.930.214</b>                         | <b>0</b>                       |
| <b>Ingresos</b>                                                              |          |                                      |                                            |                                |
| Dividendos netos                                                             | 2n       | 0                                    | 0                                          | 0                              |
| Intereses netos sobre obligaciones e instrumentos del mercado monetario      | 2n       | 838.861                              | 349.901                                    | 601.684                        |
| Intereses cobrados sobre CFD                                                 |          | 0                                    | 0                                          | 21.509                         |
| Intereses cobrados sobre swaps                                               |          | 0                                    | 0                                          | 73.835                         |
| Interés sobre préstamos de títulos                                           | 7        | 147                                  | 26.630                                     | 0                              |
| Interés bancario                                                             |          | 0                                    | 1.002                                      | 7.386                          |
| Otros ingresos                                                               |          | 12.539                               | 0                                          | 0                              |
| <b>Total ingresos</b>                                                        |          | <b>851.547</b>                       | <b>377.533</b>                             | <b>704.414</b>                 |
| <b>Gastos</b>                                                                |          |                                      |                                            |                                |
| Dividendos pagados, neto                                                     |          | 0                                    | 0                                          | 0                              |
| Dividendos pagados en CFD, neto                                              |          | 0                                    | 0                                          | 2.414                          |
| Comisiones de gestión                                                        | 3        | 5.502                                | 154.580                                    | 4.120                          |
| Gastos Operativos y Administrativos                                          | 4        | 31.066                               | 153.476                                    | 31.767                         |
| Comisiones sobre rentabilidad                                                | 5        | 0                                    | 7.864                                      | 76.302                         |
| Comisiones del custodio                                                      | 4        | 1.064                                | 6.253                                      | 1.197                          |
| "Taxe d'abonnement" (Tasa de suscripción)                                    | 6        | 2.462                                | 37.965                                     | 3.958                          |
| Costos de transacciones                                                      | 2m       | 1.290                                | 51.110                                     | 495                            |
| Intereses pagados sobre CFD                                                  |          | 0                                    | 0                                          | 96.839                         |
| Intereses pagados sobre swaps                                                |          | 0                                    | 0                                          | 69.171                         |
| Intereses en pactos de recompra inversa                                      |          | 0                                    | 0                                          | 29.664                         |
| Interés bancario                                                             |          | 8.453                                | 45.382                                     | 14.716                         |
| Otros gastos                                                                 |          | 0                                    | 0                                          | 0                              |
| <b>Total gastos</b>                                                          |          | <b>49.837</b>                        | <b>456.630</b>                             | <b>330.643</b>                 |
| <b>Ingresos / (Pérdidas) netos(as) de las inversiones</b>                    |          | <b>801.710</b>                       | <b>(79.097)</b>                            | <b>373.771</b>                 |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre ventas de inversiones       | 2b       | 300.473                              | 13.510.426                                 | 280.247                        |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre opciones                    | 2e       | 0                                    | 0                                          | 0                              |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | (84.862)                             | (268.998)                                  | (173.497)                      |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre futuros                     | 2e       | 98.399                               | (837.000)                                  | 28.629                         |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre CFD                         | 2h       | 0                                    | 0                                          | 95.049                         |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 0                                    | 0                                          | (437.194)                      |
| Beneficio / (Pérdida) de cambio neto(a)                                      |          | 105.574                              | (1.164.650)                                | 60.609                         |
| <b>Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a)</b>                            |          | <b>1.221.294</b>                     | <b>11.160.681</b>                          | <b>227.614</b>                 |

# Candriam Bonds

Variaciones de los activos netos del período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                                              |          | Candriam Bonds<br>Credit Opportunities | Candriam Bonds<br>Emerging Debt Local<br>Currencies | Candriam Bonds<br>Emerging Markets |
|------------------------------------------------------------------------------|----------|----------------------------------------|-----------------------------------------------------|------------------------------------|
|                                                                              |          | EUR                                    | USD                                                 | USD                                |
| <b>Activos netos al inicio del periodo</b>                                   |          | <b>1.559.467.582</b>                   | <b>429.791.776</b>                                  | <b>1.772.561.985</b>               |
| <b>Ingresos</b>                                                              |          |                                        |                                                     |                                    |
| Dividendos netos                                                             | 2n       | 0                                      | 707.762                                             | 0                                  |
| Intereses netos sobre obligaciones e instrumentos del mercado monetario      | 2n       | 23.704.567                             | 9.463.591                                           | 33.732.671                         |
| Intereses cobrados sobre CFD                                                 |          | 0                                      | 0                                                   | 0                                  |
| Intereses cobrados sobre swaps                                               |          | 1.956.315                              | 4.221.497                                           | 0                                  |
| Interés sobre préstamos de títulos                                           | 7        | 0                                      | 0                                                   | 0                                  |
| Interés bancario                                                             |          | 9.391                                  | 40.939                                              | 5.052                              |
| Otros ingresos                                                               |          | 0                                      | 245.095                                             | 0                                  |
| <b>Total ingresos</b>                                                        |          | <b>25.670.273</b>                      | <b>14.678.884</b>                                   | <b>33.737.723</b>                  |
| <b>Gastos</b>                                                                |          |                                        |                                                     |                                    |
| Dividendos pagados, neto                                                     |          | 54.937                                 | 0                                                   | 0                                  |
| Dividendos pagados en CFD, neto                                              |          | 10.310                                 | 0                                                   | 0                                  |
| Comisiones de gestión                                                        | 3        | 4.038.541                              | 1.006.480                                           | 3.683.099                          |
| Gastos Operativos y Administrativos                                          | 4        | 1.117.829                              | 301.840                                             | 1.047.010                          |
| Comisiones sobre rentabilidad                                                | 5        | 1.793.217                              | 28.612                                              | 609.540                            |
| Comisiones del custodio                                                      | 4        | 34.632                                 | 8.092                                               | 32.664                             |
| "Taxe d'abonnement" (Tasa de suscripción)                                    | 6        | 143.704                                | 116.763                                             | 204.920                            |
| Costos de transacciones                                                      | 2m       | 48.374                                 | 105.369                                             | 70.893                             |
| Intereses pagados sobre CFD                                                  |          | 0                                      | 0                                                   | 0                                  |
| Intereses pagados sobre swaps                                                |          | 6.852.837                              | 2.951.702                                           | 0                                  |
| Intereses en pactos de recompra inversa                                      |          | 0                                      | 0                                                   | 0                                  |
| Interés bancario                                                             |          | 168.494                                | 60.724                                              | 53.841                             |
| Otros gastos                                                                 |          | 0                                      | 0                                                   | 0                                  |
| <b>Total gastos</b>                                                          |          | <b>14.262.875</b>                      | <b>4.579.582</b>                                    | <b>5.701.967</b>                   |
| <b>Ingresos / (Pérdidas) netos(as) de las inversiones</b>                    |          | <b>11.407.398</b>                      | <b>10.099.302</b>                                   | <b>28.035.756</b>                  |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre ventas de inversiones       | 2b       | 12.578.950                             | (837.670)                                           | (32.140.081)                       |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre opciones                    | 2e       | 2.042.087                              | 0                                                   | 0                                  |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | (1.937.618)                            | (4.689.914)                                         | 10.897.187                         |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre futuros                     | 2e       | 475.550                                | 1.610.263                                           | 5.066.518                          |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre CFD                         | 2h       | (110.885)                              | 0                                                   | 0                                  |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 14.322.985                             | 1.148.959                                           | 0                                  |
| Beneficio / (Pérdida) de cambio neto(a)                                      |          | (4.958.398)                            | (4.720.915)                                         | 2.350.280                          |
| <b>Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a)</b>                            |          | <b>33.820.069</b>                      | <b>2.610.025</b>                                    | <b>14.209.660</b>                  |

# Candriam Bonds

Variaciones de los activos netos del período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                                              |          | Candriam Bonds<br>Emerging Markets<br>Corporate | Candriam Bonds<br>Emerging Markets<br>Total Return | Candriam Bonds<br>Euro |
|------------------------------------------------------------------------------|----------|-------------------------------------------------|----------------------------------------------------|------------------------|
|                                                                              |          | USD                                             | USD                                                | EUR                    |
| <b>Activos netos al inicio del periodo</b>                                   |          | <b>160.943.678</b>                              | <b>87.097.922</b>                                  | <b>570.227.013</b>     |
| <b>Ingresos</b>                                                              |          |                                                 |                                                    |                        |
| Dividendos netos                                                             | 2n       | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| Intereses netos sobre obligaciones e instrumentos del mercado monetario      | 2n       | 3.677.415                                       | 1.651.683                                          | 3.205.506              |
| Intereses cobrados sobre CFD                                                 |          | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| Intereses cobrados sobre swaps                                               |          | 0                                               | 835.261                                            | 306                    |
| Interés sobre préstamos de títulos                                           | 7        | 0                                               | 0                                                  | 28.305                 |
| Interés bancario                                                             |          | 0                                               | 22.319                                             | 439                    |
| Otros ingresos                                                               |          | 125.230                                         | 55                                                 | 0                      |
| <b>Total ingresos</b>                                                        |          | <b>3.802.645</b>                                | <b>2.509.318</b>                                   | <b>3.234.556</b>       |
| <b>Gastos</b>                                                                |          |                                                 |                                                    |                        |
| Dividendos pagados, neto                                                     |          | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| Dividendos pagados en CFD, neto                                              |          | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| Comisiones de gestión                                                        | 3        | 98.644                                          | 8.147                                              | 237.365                |
| Gastos Operativos y Administrativos                                          | 4        | 108.278                                         | 43.191                                             | 292.984                |
| Comisiones sobre rentabilidad                                                | 5        | 8.824                                           | 0                                                  | 39.916                 |
| Comisiones del custodio                                                      | 4        | 3.558                                           | 1.755                                              | 12.202                 |
| "Taxe d'abonnement" (Tasa de suscripción)                                    | 6        | 13.840                                          | 3.526                                              | 60.220                 |
| Costos de transacciones                                                      | 2m       | 5.714                                           | 37.953                                             | 10.205                 |
| Intereses pagados sobre CFD                                                  |          | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| Intereses pagados sobre swaps                                                |          | 0                                               | 880.661                                            | 56.792                 |
| Intereses en pactos de recompra inversa                                      |          | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| Interés bancario                                                             |          | 1.312                                           | 6.390                                              | 16.740                 |
| Otros gastos                                                                 |          | 0                                               | 3.109                                              | 0                      |
| <b>Total gastos</b>                                                          |          | <b>240.170</b>                                  | <b>984.732</b>                                     | <b>726.424</b>         |
| <b>Ingresos / (Pérdidas) netos(as) de las inversiones</b>                    |          | <b>3.562.475</b>                                | <b>1.524.586</b>                                   | <b>2.508.132</b>       |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre ventas de inversiones       | 2b       | 822.683                                         | 478.322                                            | 4.018.101              |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre opciones                    | 2e       | 0                                               | 0                                                  | 2.394                  |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | (93.817)                                        | (1.220.664)                                        | 31.898                 |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre futuros                     | 2e       | 62.571                                          | 55.741                                             | 1.608.413              |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre CFD                         | 2h       | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 0                                               | (186.839)                                          | 433.619                |
| Beneficio / (Pérdida) de cambio neto(a)                                      |          | (10.363)                                        | 97.675                                             | (22.137)               |
| <b>Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a)</b>                            |          | <b>4.343.549</b>                                | <b>748.821</b>                                     | <b>8.580.420</b>       |

# Candriam Bonds

Variaciones de los activos netos del período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                                              |          | Candriam Bonds<br>Euro Corporate | Candriam Bonds<br>Euro Corporate ex-<br>Financials | Candriam Bonds<br>Euro Diversified |
|------------------------------------------------------------------------------|----------|----------------------------------|----------------------------------------------------|------------------------------------|
|                                                                              |          | EUR                              | EUR                                                | EUR                                |
| <b>Activos netos al inicio del periodo</b>                                   |          | <b>955.924.643</b>               | <b>37.594.748</b>                                  | <b>628.476.315</b>                 |
| <b>Ingresos</b>                                                              |          |                                  |                                                    |                                    |
| Dividendos netos                                                             | 2n       | 0                                | 0                                                  | 0                                  |
| Intereses netos sobre obligaciones e instrumentos del mercado monetario      | 2n       | 6.130.497                        | 207.465                                            | 3.311.219                          |
| Intereses cobrados sobre CFD                                                 |          | 0                                | 0                                                  | 0                                  |
| Intereses cobrados sobre swaps                                               |          | 531.203                          | 0                                                  | 1.222                              |
| Interés sobre préstamos de títulos                                           | 7        | 1.380                            | 131                                                | 22.344                             |
| Interés bancario                                                             |          | 3.723                            | 0                                                  | 186                                |
| Otros ingresos                                                               |          | 4                                | 0                                                  | 0                                  |
| <b>Total ingresos</b>                                                        |          | <b>6.666.807</b>                 | <b>207.596</b>                                     | <b>3.334.971</b>                   |
| <b>Gastos</b>                                                                |          |                                  |                                                    |                                    |
| Dividendos pagados, neto                                                     |          | 0                                | 0                                                  | 0                                  |
| Dividendos pagados en CFD, neto                                              |          | 0                                | 0                                                  | 0                                  |
| Comisiones de gestión                                                        | 3        | 255.187                          | 7.209                                              | 141.374                            |
| Gastos Operativos y Administrativos                                          | 4        | 460.549                          | 17.826                                             | 324.041                            |
| Comisiones sobre rentabilidad                                                | 5        | 36.036                           | 0                                                  | 5.659                              |
| Comisiones del custodio                                                      | 4        | 20.318                           | 786                                                | 13.855                             |
| "Taxe d'abonnement" (Tasa de suscripción)                                    | 6        | 47.111                           | 2.041                                              | 38.999                             |
| Costos de transacciones                                                      | 2m       | 30.958                           | 591                                                | 19.772                             |
| Intereses pagados sobre CFD                                                  |          | 0                                | 0                                                  | 0                                  |
| Intereses pagados sobre swaps                                                |          | 221.872                          | 0                                                  | 187.889                            |
| Intereses en pactos de recompra inversa                                      |          | 0                                | 0                                                  | 0                                  |
| Interés bancario                                                             |          | 118.911                          | 917                                                | 18.121                             |
| Otros gastos                                                                 |          | 0                                | 0                                                  | 0                                  |
| <b>Total gastos</b>                                                          |          | <b>1.190.942</b>                 | <b>29.370</b>                                      | <b>749.710</b>                     |
| <b>Ingresos / (Pérdidas) netos(as) de las inversiones</b>                    |          | <b>5.475.865</b>                 | <b>178.226</b>                                     | <b>2.585.261</b>                   |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre ventas de inversiones       | 2b       | 12.070.414                       | 1.182.295                                          | 2.952.329                          |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre opciones                    | 2e       | 0                                | 0                                                  | 2.646                              |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | 10.111                           | 0                                                  | 27.107                             |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre futuros                     | 2e       | (429.571)                        | 14.470                                             | 2.017.968                          |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre CFD                         | 2h       | 0                                | 0                                                  | 0                                  |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre swaps                       | 2i,2j,2k | (2.229.303)                      | 0                                                  | 1.373.541                          |
| Beneficio / (Pérdida) de cambio neto(a)                                      |          | (557.805)                        | 953                                                | 15.043                             |
| <b>Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a)</b>                            |          | <b>14.339.711</b>                | <b>1.375.944</b>                                   | <b>8.973.895</b>                   |

# Candriam Bonds

Variaciones de los activos netos del período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                                              |          | Candriam Bonds<br>Euro Government | Candriam Bonds<br>Euro High Yield | Candriam Bonds<br>Euro Long Term |
|------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|
|                                                                              |          | EUR                               | EUR                               | EUR                              |
| <b>Activos netos al inicio del periodo</b>                                   |          | <b>776.149.490</b>                | <b>3.109.660.440</b>              | <b>137.723.569</b>               |
| <b>Ingresos</b>                                                              |          |                                   |                                   |                                  |
| Dividendos netos                                                             | 2n       | 0                                 | 0                                 | 0                                |
| Intereses netos sobre obligaciones e instrumentos del mercado monetario      | 2n       | 6.353.692                         | 48.291.171                        | 815.270                          |
| Intereses cobrados sobre CFD                                                 |          | 0                                 | 0                                 | 0                                |
| Intereses cobrados sobre swaps                                               |          | 0                                 | 1.424.985                         | 91                               |
| Interés sobre préstamos de títulos                                           | 7        | 91.019                            | 0                                 | 6.837                            |
| Interés bancario                                                             |          | 0                                 | 217.983                           | 0                                |
| Otros ingresos                                                               |          | 0                                 | 2.930.211                         | 6.221                            |
| <b>Total ingresos</b>                                                        |          | <b>6.444.711</b>                  | <b>52.864.350</b>                 | <b>828.419</b>                   |
| <b>Gastos</b>                                                                |          |                                   |                                   |                                  |
| Dividendos pagados, neto                                                     |          | 0                                 | 0                                 | 0                                |
| Dividendos pagados en CFD, neto                                              |          | 0                                 | 0                                 | 0                                |
| Comisiones de gestión                                                        | 3        | 668.536                           | 8.063.774                         | 50.392                           |
| Gastos Operativos y Administrativos                                          | 4        | 417.596                           | 2.006.808                         | 58.855                           |
| Comisiones sobre rentabilidad                                                | 5        | 124.100                           | 282.700                           | 9.601                            |
| Comisiones del custodio                                                      | 4        | 17.856                            | 72.236                            | 2.420                            |
| "Taxe d'abonnement" (Tasa de suscripción)                                    | 6        | 68.381                            | 420.397                           | 9.077                            |
| Costos de transacciones                                                      | 2m       | 25.665                            | 89.235                            | 3.682                            |
| Intereses pagados sobre CFD                                                  |          | 0                                 | 0                                 | 0                                |
| Intereses pagados sobre swaps                                                |          | 0                                 | 286.064                           | 11.286                           |
| Intereses en pactos de recompra inversa                                      |          | 0                                 | 0                                 | 0                                |
| Interés bancario                                                             |          | 21.889                            | 287.624                           | 2.368                            |
| Otros gastos                                                                 |          | 0                                 | 0                                 | 0                                |
| <b>Total gastos</b>                                                          |          | <b>1.344.023</b>                  | <b>11.508.838</b>                 | <b>147.681</b>                   |
| <b>Ingresos / (Pérdidas) netos(as) de las inversiones</b>                    |          | <b>5.100.688</b>                  | <b>41.355.512</b>                 | <b>680.738</b>                   |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre ventas de inversiones       | 2b       | 1.968.055                         | 69.461.396                        | 1.730.081                        |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre opciones                    | 2e       | 0                                 | 0                                 | 525                              |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | 87.781                            | (2.149.969)                       | (11.863)                         |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre futuros                     | 2e       | 2.870.280                         | 2.796.130                         | 81.201                           |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre CFD                         | 2h       | 0                                 | 0                                 | 0                                |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 0                                 | (8.433.624)                       | 78.166                           |
| Beneficio / (Pérdida) de cambio neto(a)                                      |          | (80.912)                          | (4.445.045)                       | 2.243                            |
| <b>Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a)</b>                            |          | <b>9.945.892</b>                  | <b>98.584.400</b>                 | <b>2.561.091</b>                 |

# Candriam Bonds

Variaciones de los activos netos del período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                                              |          | Candriam Bonds<br>Euro Short Term | Candriam Bonds<br>Floating Rate Notes | Candriam Bonds<br>Global Government |
|------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|                                                                              |          | EUR                               | EUR                                   | EUR                                 |
| <b>Activos netos al inicio del periodo</b>                                   |          | <b>1.640.766.142</b>              | <b>478.704.230</b>                    | <b>145.028.067</b>                  |
| <b>Ingresos</b>                                                              |          |                                   |                                       |                                     |
| Dividendos netos                                                             | 2n       | 0                                 | 0                                     | 0                                   |
| Intereses netos sobre obligaciones e instrumentos del mercado monetario      | 2n       | 9.444.843                         | 1.244.316                             | 1.164.285                           |
| Intereses cobrados sobre CFD                                                 |          | 0                                 | 0                                     | 0                                   |
| Intereses cobrados sobre swaps                                               |          | 0                                 | 0                                     | 0                                   |
| Interés sobre préstamos de títulos                                           | 7        | 34.436                            | 83                                    | 8.258                               |
| Interés bancario                                                             |          | 3.265                             | 148                                   | 448                                 |
| Otros ingresos                                                               |          | 0                                 | 0                                     | 0                                   |
| <b>Total ingresos</b>                                                        |          | <b>9.482.544</b>                  | <b>1.244.547</b>                      | <b>1.172.991</b>                    |
| <b>Gastos</b>                                                                |          |                                   |                                       |                                     |
| Dividendos pagados, neto                                                     |          | 0                                 | 0                                     | 0                                   |
| Dividendos pagados en CFD, neto                                              |          | 0                                 | 0                                     | 1.375                               |
| Comisiones de gestión                                                        | 3        | 1.170.819                         | 65.369                                | 152.077                             |
| Gastos Operativos y Administrativos                                          | 4        | 775.954                           | 159.657                               | 72.439                              |
| Comisiones sobre rentabilidad                                                | 5        | 32.383                            | 0                                     | 0                                   |
| Comisiones del custodio                                                      | 4        | 34.093                            | 10.336                                | 2.959                               |
| "Taxe d'abonnement" (Tasa de suscripción)                                    | 6        | 116.072                           | 30.284                                | 11.481                              |
| Costos de transacciones                                                      | 2m       | 51.536                            | 6.668                                 | 5.922                               |
| Intereses pagados sobre CFD                                                  |          | 0                                 | 0                                     | 0                                   |
| Intereses pagados sobre swaps                                                |          | 0                                 | 0                                     | 1.002                               |
| Intereses en pactos de recompra inversa                                      |          | 0                                 | 0                                     | 0                                   |
| Interés bancario                                                             |          | 30.801                            | 16.226                                | 6.365                               |
| Otros gastos                                                                 |          | 0                                 | 0                                     | 0                                   |
| <b>Total gastos</b>                                                          |          | <b>2.211.658</b>                  | <b>288.540</b>                        | <b>253.620</b>                      |
| <b>Ingresos / (Pérdidas) netos(as) de las inversiones</b>                    |          | <b>7.270.886</b>                  | <b>956.007</b>                        | <b>919.371</b>                      |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre ventas de inversiones       | 2b       | (7.525.848)                       | (189.656)                             | 44.840                              |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre opciones                    | 2e       | 0                                 | 0                                     | (15.461)                            |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | (89.200)                          | 426.781                               | (175.880)                           |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre futuros                     | 2e       | (12.592)                          | 143.063                               | 200.135                             |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre CFD                         | 2h       | 0                                 | 0                                     | 0                                   |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 0                                 | 0                                     | 0                                   |
| Beneficio / (Pérdida) de cambio neto(a)                                      |          | 615.160                           | 539.519                               | (2.062.906)                         |
| <b>Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a)</b>                            |          | <b>258.406</b>                    | <b>1.875.714</b>                      | <b>(1.089.901)</b>                  |

# Candriam Bonds

Variaciones de los activos netos del período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                                              |          | Candriam Bonds<br>Global High Yield | Candriam Bonds<br>Global Inflation Short<br>Duration | Candriam Bonds<br>International |
|------------------------------------------------------------------------------|----------|-------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------|
|                                                                              |          | EUR                                 | EUR                                                  | EUR                             |
| <b>Activos netos al inicio del periodo</b>                                   |          | <b>254.476.909</b>                  | <b>160.787.989</b>                                   | <b>154.518.002</b>              |
| <b>Ingresos</b>                                                              |          |                                     |                                                      |                                 |
| Dividendos netos                                                             | 2n       | 0                                   | 0                                                    | 7.425                           |
| Intereses netos sobre obligaciones e instrumentos del mercado monetario      | 2n       | 5.432.848                           | 694.884                                              | 884.448                         |
| Intereses cobrados sobre CFD                                                 |          | 0                                   | 0                                                    | 0                               |
| Intereses cobrados sobre swaps                                               |          | 0                                   | 0                                                    | 611                             |
| Interés sobre préstamos de títulos                                           | 7        | 0                                   | 23.150                                               | 1.189                           |
| Interés bancario                                                             |          | 4.307                               | 4.417                                                | 998                             |
| Otros ingresos                                                               |          | 0                                   | 0                                                    | 0                               |
| <b>Total ingresos</b>                                                        |          | <b>5.437.155</b>                    | <b>722.451</b>                                       | <b>894.671</b>                  |
| <b>Gastos</b>                                                                |          |                                     |                                                      |                                 |
| Dividendos pagados, neto                                                     |          | 39.062                              | 0                                                    | 0                               |
| Dividendos pagados en CFD, neto                                              |          | 0                                   | 0                                                    | 0                               |
| Comisiones de gestión                                                        | 3        | 891.973                             | 107.942                                              | 211.544                         |
| Gastos Operativos y Administrativos                                          | 4        | 223.028                             | 127.136                                              | 99.473                          |
| Comisiones sobre rentabilidad                                                | 5        | 95.969                              | 0                                                    | 1.707                           |
| Comisiones del custodio                                                      | 4        | 6.096                               | 4.445                                                | 2.621                           |
| "Taxe d'abonnement" (Tasa de suscripción)                                    | 6        | 47.660                              | 19.136                                               | 31.749                          |
| Costos de transacciones                                                      | 2m       | 4.783                               | 7.540                                                | 8.669                           |
| Intereses pagados sobre CFD                                                  |          | 0                                   | 0                                                    | 0                               |
| Intereses pagados sobre swaps                                                |          | 0                                   | 964                                                  | 37.833                          |
| Intereses en pactos de recompra inversa                                      |          | 0                                   | 0                                                    | 0                               |
| Interés bancario                                                             |          | 64.325                              | 14.684                                               | 9.074                           |
| Otros gastos                                                                 |          | 0                                   | 0                                                    | 0                               |
| <b>Total gastos</b>                                                          |          | <b>1.372.896</b>                    | <b>281.847</b>                                       | <b>402.670</b>                  |
| <b>Ingresos / (Pérdidas) netos(as) de las inversiones</b>                    |          | <b>4.064.259</b>                    | <b>440.604</b>                                       | <b>492.001</b>                  |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre ventas de inversiones       | 2b       | 8.615.554                           | 3.399.071                                            | 2.303.959                       |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre opciones                    | 2e       | 0                                   | (18.554)                                             | (15.604)                        |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | (4.202.109)                         | 2.274.661                                            | (511.036)                       |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre futuros                     | 2e       | (9.900)                             | 339.891                                              | 418.004                         |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre CFD                         | 2h       | 0                                   | 0                                                    | 0                               |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 0                                   | 0                                                    | 203.169                         |
| Beneficio / (Pérdida) de cambio neto(a)                                      |          | 340.486                             | 88.284                                               | (972.941)                       |
| <b>Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a)</b>                            |          | <b>8.808.290</b>                    | <b>6.523.957</b>                                     | <b>1.917.552</b>                |

# Candriam Bonds

Variaciones de los activos netos del período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                                              |          | Candriam Bonds<br>Total Return | Candriam Bonds<br>Total Return<br>Defensive | Combinado             |
|------------------------------------------------------------------------------|----------|--------------------------------|---------------------------------------------|-----------------------|
|                                                                              |          | EUR                            | EUR                                         | EUR                   |
| <b>Activos netos al inicio del periodo</b>                                   |          | <b>1.076.545.716</b>           | <b>62.356.262</b>                           | <b>14.070.207.704</b> |
| <b>Ingresos</b>                                                              |          |                                |                                             |                       |
| Dividendos netos                                                             | 2n       | 0                              | 0                                           | 604.239               |
| Intereses netos sobre obligaciones e instrumentos del mercado monetario      | 2n       | 8.624.850                      | 339.138                                     | 162.558.038           |
| Intereses cobrados sobre CFD                                                 |          | 0                              | 0                                           | 21.509                |
| Intereses cobrados sobre swaps                                               |          | 894.789                        | 0                                           | 9.147.425             |
| Interés sobre préstamos de títulos                                           | 7        | 14.284                         | 0                                           | 258.193               |
| Interés bancario                                                             |          | 14.152                         | 1.757                                       | 327.204               |
| Otros ingresos                                                               |          | 292.036                        | 0                                           | 3.553.331             |
| <b>Total ingresos</b>                                                        |          | <b>9.840.111</b>               | <b>340.895</b>                              | <b>176.469.939</b>    |
| <b>Gastos</b>                                                                |          |                                |                                             |                       |
| Dividendos pagados, neto                                                     |          | 7.273                          | 0                                           | 101.272               |
| Dividendos pagados en CFD, neto                                              |          | 0                              | 0                                           | 14.099                |
| Comisiones de gestión                                                        | 3        | 2.038.576                      | 34.987                                      | 22.344.365            |
| Gastos Operativos y Administrativos                                          | 4        | 575.461                        | 28.409                                      | 8.239.485             |
| Comisiones sobre rentabilidad                                                | 5        | 4.241                          | 6                                           | 3.055.258             |
| Comisiones del custodio                                                      | 4        | 21.981                         | 1.285                                       | 305.482               |
| "Taxe d'abonnement" (Tasa de suscripción)                                    | 6        | 90.471                         | 2.035                                       | 1.469.103             |
| Costos de transacciones                                                      | 2m       | 83.031                         | 1.948                                       | 636.927               |
| Intereses pagados sobre CFD                                                  |          | 0                              | 0                                           | 96.839                |
| Intereses pagados sobre swaps                                                |          | 3.787.999                      | 0                                           | 14.745.316            |
| Intereses en pactos de recompra inversa                                      |          | 0                              | 0                                           | 29.664                |
| Interés bancario                                                             |          | 157.347                        | 7.698                                       | 1.113.236             |
| Otros gastos                                                                 |          | 0                              | 17                                          | 2.639                 |
| <b>Total gastos</b>                                                          |          | <b>6.766.380</b>               | <b>76.385</b>                               | <b>52.153.685</b>     |
| <b>Ingresos / (Pérdidas) netos(as) de las inversiones</b>                    |          | <b>3.073.731</b>               | <b>264.510</b>                              | <b>124.316.254</b>    |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre ventas de inversiones       | 2b       | 12.320.629                     | 153.283                                     | 112.463.455           |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre opciones                    | 2e       | 302.938                        | 0                                           | 2.300.971             |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | 7.554.527                      | 11.843                                      | 4.945.482             |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre futuros                     | 2e       | 9.900.771                      | (20.696)                                    | 25.413.049            |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre CFD                         | 2h       | 0                              | 0                                           | (15.836)              |
| Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 7.695.617                      | 0                                           | 13.818.275            |
| Beneficio / (Pérdida) de cambio neto(a)                                      |          | (6.122.721)                    | (314.212)                                   | (20.859.249)          |
| <b>Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a)</b>                            |          | <b>34.725.492</b>              | <b>94.728</b>                               | <b>262.382.401</b>    |

## Candriam Bonds

Variaciones de los activos netos del período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                                                            |          | Candriam Bonds<br>Capital Securities | Candriam Bonds<br>Convertible<br>Defensive | Candriam Bonds<br>Credit Alpha |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|----------|--------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------|
|                                                                                            |          | EUR                                  | EUR                                        | EUR                            |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre inversiones                 | 2b       | 206.654                              | 435.920                                    | 180.520                        |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre opciones                    | 2e       | 0                                    | 0                                          | 0                              |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | (540.041)                            | (3.479.051)                                | (62.387)                       |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre futuros                     | 2e       | (17.343)                             | 114.375                                    | 33.151                         |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre CFD                         | 2h       | 0                                    | 0                                          | (19.241)                       |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 0                                    | 0                                          | 188.713                        |
| <b>Aumento / (Diminución) neta de los activos netos procedente de operaciones</b>          |          | <b>870.564</b>                       | <b>8.231.926</b>                           | <b>548.369</b>                 |
| <b>Evolución del capital</b>                                                               |          |                                      |                                            |                                |
| Suscripciones de acciones                                                                  |          | 5.937.498                            | 46.390.751                                 | 101.823.691                    |
| Recompra de acciones                                                                       |          | (2.478.750)                          | (27.310.784)                               | (385.358)                      |
| Dividendos pagados                                                                         | 9        | 0                                    | (587.485)                                  | 0                              |
| Diferencias de cambio                                                                      |          | 0                                    | 0                                          | 0                              |
| <b>Activos netos al final del periodo</b>                                                  |          | <b>49.506.406</b>                    | <b>300.654.622</b>                         | <b>101.986.702</b>             |

## Candriam Bonds

Variaciones de los activos netos del período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                                                            |          | Candriam Bonds<br>Credit Opportunities | Candriam Bonds<br>Emerging Debt Local<br>Currencies | Candriam Bonds<br>Emerging Markets |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|----------|----------------------------------------|-----------------------------------------------------|------------------------------------|
|                                                                                            |          | EUR                                    | USD                                                 | USD                                |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre inversiones                 | 2b       | (232.573)                              | (27.374.850)                                        | (18.146.833)                       |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre opciones                    | 2e       | 1.774.484                              | 0                                                   | 0                                  |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | (6.747.114)                            | (342.665)                                           | (18.435.295)                       |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre futuros                     | 2e       | (132.275)                              | (282.625)                                           | (4.305.826)                        |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre CFD                         | 2h       | (171.820)                              | 0                                                   | 0                                  |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre swaps                       | 2i,2j,2k | (19.505.298)                           | (6.604.737)                                         | 0                                  |
| <b>Aumento / (Diminución) neta de los activos netos procedente de operaciones</b>          |          | <b>8.805.473</b>                       | <b>(31.994.852)</b>                                 | <b>(26.678.294)</b>                |
| <b>Evolución del capital</b>                                                               |          |                                        |                                                     |                                    |
| Suscripciones de acciones                                                                  |          | 405.119.989                            | 37.319.027                                          | 200.614.810                        |
| Recompra de acciones                                                                       |          | (400.957.384)                          | (108.385.308)                                       | (738.542.677)                      |
| Dividendos pagados                                                                         | 9        | (446.258)                              | (6.069.504)                                         | (13.640.397)                       |
| Diferencias de cambio                                                                      |          | 0                                      | 0                                                   | 0                                  |
| <b>Activos netos al final del periodo</b>                                                  |          | <b>1.571.989.402</b>                   | <b>320.661.139</b>                                  | <b>1.194.315.427</b>               |

## Candriam Bonds

Variaciones de los activos netos del período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                                                            |          | Candriam Bonds<br>Emerging Markets<br>Corporate | Candriam Bonds<br>Emerging Markets<br>Total Return | Candriam Bonds<br>Euro |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-------------------------------------------------|----------------------------------------------------|------------------------|
|                                                                                            |          | USD                                             | USD                                                | EUR                    |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre inversiones                 | 2b       | (3.821.486)                                     | (3.641.648)                                        | (19.062.269)           |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre opciones                    | 2e       | 0                                               | 0                                                  | 3.633                  |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | (449.989)                                       | 101.030                                            | (358.134)              |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre futuros                     | 2e       | (124.750)                                       | (277.895)                                          | (181.020)              |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre CFD                         | 2h       | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 0                                               | (196.750)                                          | (437.270)              |
| <b>Aumento / (Disminución) neta de los activos netos procedente de operaciones</b>         |          | <b>(52.676)</b>                                 | <b>(3.266.443)</b>                                 | <b>(11.454.641)</b>    |
| <b>Evolución del capital</b>                                                               |          |                                                 |                                                    |                        |
| Suscripciones de acciones                                                                  |          | 13.625.040                                      | 2.869.601                                          | 43.823.350             |
| Recompra de acciones                                                                       |          | (15.347.490)                                    | (16.426.577)                                       | (56.742.758)           |
| Dividendos pagados                                                                         | 9        | (1.032.884)                                     | 0                                                  | (616.282)              |
| Diferencias de cambio                                                                      |          | 0                                               | 0                                                  | 0                      |
| <b>Activos netos al final del periodo</b>                                                  |          | <b>158.135.668</b>                              | <b>70.274.503</b>                                  | <b>545.236.682</b>     |

## Candriam Bonds

Variaciones de los activos netos del período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                                                            |          | Candriam Bonds<br>Euro Corporate | Candriam Bonds<br>Euro Corporate ex-<br>Financials | Candriam Bonds<br>Euro Diversified |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|----------|----------------------------------|----------------------------------------------------|------------------------------------|
|                                                                                            |          | EUR                              | EUR                                                | EUR                                |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre inversiones                 | 2b       | (16.958.935)                     | (1.686.054)                                        | (9.900.893)                        |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre opciones                    | 2e       | (16.266)                         | 0                                                  | 4.178                              |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | (2.207.464)                      | 0                                                  | (432.972)                          |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre futuros                     | 2e       | 151.722                          | 1.700                                              | (201.594)                          |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre CFD                         | 2h       | 0                                | 0                                                  | 0                                  |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 2.318.590                        | 0                                                  | (1.426.293)                        |
| <b>Aumento / (Diminución) neta de los activos netos procedente de operaciones</b>          |          | <b>(2.372.642)</b>               | <b>(308.410)</b>                                   | <b>(2.983.679)</b>                 |
| <b>Evolución del capital</b>                                                               |          |                                  |                                                    |                                    |
| Suscripciones de acciones                                                                  |          | 69.241.922                       | 135.465                                            | 56.653.755                         |
| Recompra de acciones                                                                       |          | (127.564.344)                    | (37.421.218)                                       | (52.126.297)                       |
| Dividendos pagados                                                                         | 9        | (328.237)                        | (585)                                              | (1.685)                            |
| Diferencias de cambio                                                                      |          | 0                                | 0                                                  | 0                                  |
| <b>Activos netos al final del periodo</b>                                                  |          | <b>894.901.342</b>               | <b>0</b>                                           | <b>630.018.409</b>                 |

## Candriam Bonds

Variaciones de los activos netos del período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                                                            |          | Candriam Bonds<br>Euro Government | Candriam Bonds<br>Euro High Yield | Candriam Bonds<br>Euro Long Term |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|
|                                                                                            |          | EUR                               | EUR                               | EUR                              |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre inversiones                 | 2b       | (33.428.947)                      | (43.029.474)                      | (7.696.455)                      |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre opciones                    | 2e       | 5.540                             | 0                                 | 692                              |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | (18.906)                          | (5.397.269)                       | (25.291)                         |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre futuros                     | 2e       | (414.358)                         | (1.639.570)                       | (7.431)                          |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre CFD                         | 2h       | 0                                 | 0                                 | 0                                |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 0                                 | 6.390.086                         | (82.791)                         |
| <b>Aumento / (Diminución) neta de los activos netos procedente de operaciones</b>          |          | <b>(23.910.779)</b>               | <b>54.908.173</b>                 | <b>(5.250.185)</b>               |
| <b>Evolución del capital</b>                                                               |          |                                   |                                   |                                  |
| Suscripciones de acciones                                                                  |          | 168.067.278                       | 718.589.522                       | 8.782.713                        |
| Recompra de acciones                                                                       |          | (92.552.231)                      | (616.377.457)                     | (38.682.037)                     |
| Dividendos pagados                                                                         | 9        | (268.715)                         | (15.667.649)                      | (38.209)                         |
| Diferencias de cambio                                                                      |          | 0                                 | 0                                 | 0                                |
| <b>Activos netos al final del periodo</b>                                                  |          | <b>827.485.043</b>                | <b>3.251.113.029</b>              | <b>102.535.851</b>               |

## Candriam Bonds

Variaciones de los activos netos del período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                                                            |          | Candriam Bonds<br>Euro Short Term | Candriam Bonds<br>Floating Rate Notes | Candriam Bonds<br>Global Government |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|                                                                                            |          | EUR                               | EUR                                   | EUR                                 |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre inversiones                 | 2b       | (1.105.522)                       | 1.052.456                             | (1.479.956)                         |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre opciones                    | 2e       | 0                                 | 0                                     | 15.650                              |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | (2.245.740)                       | (2.768.213)                           | 238.411                             |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre futuros                     | 2e       | 371.723                           | 27.822                                | (74.397)                            |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre CFD                         | 2h       | 0                                 | 0                                     | 0                                   |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 0                                 | 0                                     | (9.323)                             |
| <b>Aumento / (Disminución) neta de los activos netos procedente de operaciones</b>         |          | <b>(2.721.133)</b>                | <b>187.780</b>                        | <b>(2.399.516)</b>                  |
| <b>Evolución del capital</b>                                                               |          |                                   |                                       |                                     |
| Suscripciones de acciones                                                                  |          | 363.714.075                       | 181.128.002                           | 25.425.117                          |
| Recompra de acciones                                                                       |          | (551.374.255)                     | (110.332.289)                         | (36.506.728)                        |
| Dividendos pagados                                                                         | 9        | 0                                 | 0                                     | (25.766)                            |
| Diferencias de cambio                                                                      |          | 0                                 | 0                                     | 0                                   |
| <b>Activos netos al final del periodo</b>                                                  |          | <b>1.450.384.829</b>              | <b>549.687.723</b>                    | <b>131.521.174</b>                  |

## Candriam Bonds

Variaciones de los activos netos del período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                                                            |          | Candriam Bonds<br>Global High Yield | Candriam Bonds<br>Global Inflation Short<br>Duration | Candriam Bonds<br>International |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------|
|                                                                                            |          | EUR                                 | EUR                                                  | EUR                             |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre inversiones                 | 2b       | 3.556.767                           | 5.966.756                                            | (3.103.949)                     |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre opciones                    | 2e       | 0                                   | 16.432                                               | 17.171                          |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | (5.659.355)                         | (9.059.697)                                          | (1.090.310)                     |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre futuros                     | 2e       | (4.400)                             | (177.076)                                            | (26.917)                        |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre CFD                         | 2h       | 0                                   | 0                                                    | 0                               |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre swaps                       | 2i,2j,2k | 0                                   | (8.964)                                              | (213.389)                       |
| <b>Aumento / (Diminución) neta de los activos netos procedente de operaciones</b>          |          | <b>6.701.302</b>                    | <b>3.261.408</b>                                     | <b>(2.499.842)</b>              |
| <b>Evolución del capital</b>                                                               |          |                                     |                                                      |                                 |
| Suscripciones de acciones                                                                  |          | 123.979.677                         | 155.424.159                                          | 15.083.732                      |
| Recompra de acciones                                                                       |          | (73.692.255)                        | (64.701.451)                                         | (57.333.105)                    |
| Dividendos pagados                                                                         | 9        | (1.921.674)                         | (118.096)                                            | (178.831)                       |
| Diferencias de cambio                                                                      |          | 0                                   | 0                                                    | 0                               |
| <b>Activos netos al final del periodo</b>                                                  |          | <b>309.543.959</b>                  | <b>254.654.009</b>                                   | <b>109.589.956</b>              |

## Candriam Bonds

Variaciones de los activos netos del período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                                                            |          | Candriam Bonds<br>Total Return | Candriam Bonds<br>Total Return<br>Defensive | Combinado             |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|----------|--------------------------------|---------------------------------------------|-----------------------|
|                                                                                            |          | EUR                            | EUR                                         | EUR                   |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre inversiones                 | 2b       | (4.641.117)                    | (9.608)                                     | (175.615.671)         |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre opciones                    | 2e       | 132.815                        | 0                                           | 1.954.329             |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo | 2f,2g    | (12.226.665)                   | (174.443)                                   | (68.383.251)          |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre futuros                     | 2e       | (2.754.181)                    | (21.777)                                    | (9.160.545)           |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre CFD                         | 2h       | 0                              | 0                                           | (191.061)             |
| Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre swaps                       | 2i,2j,2k | (5.045.628)                    | 0                                           | (23.566.863)          |
| <b>Aumento / (Disminución) neta de los activos netos procedente de operaciones</b>         |          | <b>10.190.717</b>              | <b>(111.101)</b>                            | <b>(12.580.661)</b>   |
| <b>Evolución del capital</b>                                                               |          |                                |                                             |                       |
| Suscripciones de acciones                                                                  |          | 76.210.402                     | 0                                           | 2.780.075.729         |
| Recompra de acciones                                                                       |          | (184.124.477)                  | (62.245.161)                                | (3.333.866.305)       |
| Dividendos pagados                                                                         | 9        | (3.530.521)                    | 0                                           | (41.221.168)          |
| Diferencias de cambio                                                                      |          | 0                              | 0                                           | 63.581.585            |
| <b>Activos netos al final del periodo</b>                                                  |          | <b>975.291.837</b>             | <b>0</b>                                    | <b>13.526.196.884</b> |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Capital Securities |                     |                     |                     |
|------------------------------------------------------------|--------------------------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
|                                                            | C<br>Capitalización                  | I<br>Capitalización | R<br>Capitalización | Z<br>Capitalización |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 7                                    | 1                   | 7                   | 26.832              |
| Número de acciones emitidas                                | 0                                    | 2.199               | 0                   | 1.341               |
| Número de acciones recompradas                             | 0                                    | 0                   | 0                   | (1.464)             |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 7                                    | 2.200               | 7                   | 26.709              |

### Estadísticas

|                              |            |          |        |          |
|------------------------------|------------|----------|--------|----------|
| Valor activo neto global     | EUR        |          |        |          |
| 30 de junio de 2021          | 49.506.406 |          |        |          |
| 31 de diciembre de 2020      | 45.177.094 |          |        |          |
| 31 de diciembre de 2019      | 99.154.364 |          |        |          |
| Valor activo neto por acción | EUR        | EUR      | EUR    | EUR      |
| 30 de junio de 2021          | 164,23     | 1.683,63 | 168,10 | 1.714,78 |
| 31 de diciembre de 2020      | 162,15     | 1.656,51 | 165,64 | 1.683,55 |
| 31 de diciembre de 2019      | 160,18     | 1.624,73 | 162,61 | 1.643,92 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Convertible<br>Defensive |                   |                     |                      |
|------------------------------------------------------------|--------------------------------------------|-------------------|---------------------|----------------------|
|                                                            | C<br>Capitalización                        | C<br>Distribución | I<br>Capitalización | R2<br>Capitalización |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 48.565                                     | 112.132           | 814                 | 24.059               |
| Número de acciones emitidas                                | 1.022                                      | 6.955             | 0                   | 0                    |
| Número de acciones recompradas                             | (11.916)                                   | (25.021)          | (36)                | 0                    |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 37.671                                     | 94.067            | 778                 | 24.059               |

### Estadísticas

|                              |             |        |          |        |
|------------------------------|-------------|--------|----------|--------|
| Valor activo neto global     | EUR         |        |          |        |
| 30 de junio de 2021          | 300.654.622 |        |          |        |
| 31 de diciembre de 2020      | 273.930.214 |        |          |        |
| 31 de diciembre de 2019      | 327.331.466 |        |          |        |
| Valor activo neto por acción | EUR         | EUR    | EUR      | EUR    |
| 30 de junio de 2021          | 139,43      | 126,91 | 1.736,72 | 162,20 |
| 31 de diciembre de 2020      | 135,85      | 124,84 | 1.697,26 | 157,63 |
| 31 de diciembre de 2019      | 128,79      | 118,37 | 1.620,95 | 148,67 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Convertible<br>Defensive |                     | Candriam Bonds<br>Credit Alpha* |                       |
|------------------------------------------------------------|--------------------------------------------|---------------------|---------------------------------|-----------------------|
|                                                            | R2<br>Distribución                         | Z<br>Capitalización | C**<br>Capitalización           | I**<br>Capitalización |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 262.502                                    | 123.719             | 0                               | 0                     |
| Número de acciones emitidas                                | 140.846                                    | 13.152              | 7                               | 1                     |
| Número de acciones recompradas                             | (18.559)                                   | (11.472)            | 0                               | 0                     |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 384.789                                    | 125.399             | 7                               | 1                     |

### Estadísticas

|                              |             |          |        |          |
|------------------------------|-------------|----------|--------|----------|
| Valor activo neto global     | EUR         |          |        |          |
| 30 de junio de 2021          | 101.986.702 |          |        |          |
| 31 de diciembre de 2020      | -           |          |        |          |
| 31 de diciembre de 2019      | -           |          |        |          |
| Valor activo neto por acción | EUR         | EUR      | EUR    | EUR      |
| 30 de junio de 2021          | 163,38      | 1.717,27 | 150,42 | 1.507,41 |
| 31 de diciembre de 2020      | 160,25      | 1.665,83 | -      | -        |
| 31 de diciembre de 2019      | 151,14      | 1.565,36 | -      | -        |

\*Ver nota 1

\*\*Primera valoración 5 de febrero de 2021

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Credit Alpha\*

|                                                            | R**<br>Capitalización | S***<br>Capitalización | V***<br>Capitalización | Z***<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|-----------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 0                     | 0                      | 0                      | 0                      |
| Número de acciones emitidas                                | 7                     | 16.667                 | 1                      | 51.013                 |
| Número de acciones recompradas                             | 0                     | 0                      | 0                      | (255)                  |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 7                     | 16.667                 | 1                      | 50.758                 |

### Estadísticas

|                                                     | EUR    | EUR      | EUR      | EUR      |
|-----------------------------------------------------|--------|----------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción<br>30 de junio de 2021 | 150,62 | 1.514,59 | 1.507,61 | 1.511,85 |
| 31 de diciembre de 2020                             | -      | -        | -        | -        |
| 31 de diciembre de 2019                             | -      | -        | -        | -        |

\*Ver nota 1

\*\*Primera valoración 5 de febrero de 2021

\*\*\*Primera valoración 1 de febrero de 2021

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Credit<br>Opportunities |                   |                           |                    |
|------------------------------------------------------------|-------------------------------------------|-------------------|---------------------------|--------------------|
|                                                            | C<br>Capitalización                       | C<br>Distribución | C USD H<br>Capitalización | CQ<br>Distribución |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 1.145.610                                 | 15.211            | 14.344                    | 49.902             |
| Número de acciones emitidas                                | 340.670                                   | 5.183             | 1.375                     | 18.136             |
| Número de acciones recompradas                             | (299.642)                                 | (2.654)           | (658)                     | (7.789)            |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 1.186.639                                 | 17.740            | 15.061                    | 60.249             |

### Estadísticas

|                              |               |        |        |        |
|------------------------------|---------------|--------|--------|--------|
| Valor activo neto global     | EUR           |        |        |        |
| 30 de junio de 2021          | 1.571.989.402 |        |        |        |
| 31 de diciembre de 2020      | 1.559.467.582 |        |        |        |
| 31 de diciembre de 2019      | 2.085.320.663 |        |        |        |
| Valor activo neto por acción | EUR           | EUR    | USD    | EUR    |
| 30 de junio de 2021          | 203,14        | 141,61 | 172,92 | 136,29 |
| 31 de diciembre de 2020      | 202,52        | 141,32 | 171,93 | 137,78 |
| 31 de diciembre de 2019      | 200,99        | 140,38 | 169,00 | 140,66 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Credit Opportunities

|                                                            | I<br>Capitalización | I USD H<br>Capitalización | IQ<br>Distribución | N<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------------|--------------------|---------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 2.491.133           | 6.101                     | 17.098             | 154.152             |
| Número de acciones emitidas                                | 979.730             | 3.337                     | 822                | 9.449               |
| Número de acciones recompradas                             | (951.380)           | (3.093)                   | (501)              | (26.323)            |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 2.519.483           | 6.345                     | 17.419             | 137.277             |

### Estadísticas

|                              | EUR    | USD      | EUR      | EUR    |
|------------------------------|--------|----------|----------|--------|
| Valor activo neto por acción |        |          |          |        |
| 30 de junio de 2021          | 234,36 | 1.770,05 | 1.392,49 | 183,86 |
| 31 de diciembre de 2020      | 233,06 | 1.755,55 | 1.403,90 | 183,74 |
| 31 de diciembre de 2019      | 230,14 | 1.717,14 | 1.425,84 | 183,22 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Credit Opportunities

|                                                            | R<br>Capitalización | R CHF H<br>Capitalización | R GBP<br>Capitalización | R2<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------------|-------------------------|----------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 272.314             | 52.425                    | 773                     | 3.103                |
| Número de acciones emitidas                                | 76.343              | 1.313                     | 329                     | 1.400                |
| Número de acciones recompradas                             | (41.269)            | (35.247)                  | (315)                   | 0                    |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 307.388             | 18.491                    | 788                     | 4.503                |

### Estadísticas

|                              | EUR    | CHF    | GBP    | EUR    |
|------------------------------|--------|--------|--------|--------|
| Valor activo neto por acción |        |        |        |        |
| 30 de junio de 2021          | 164,33 | 160,41 | 153,80 | 154,80 |
| 31 de diciembre de 2020      | 163,47 | 159,78 | 159,61 | 153,97 |
| 31 de diciembre de 2019      | 161,53 | 158,46 | 148,88 | 152,08 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Credit Opportunities

|                                                            | R2<br>Distribución | S<br>Capitalización | S3<br>Capitalización | Z<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|--------------------|---------------------|----------------------|---------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 40.034             | 1.643.817           | 131.626              | 109.149             |
| Número de acciones emitidas                                | 5.510              | 263.030             | 0                    | 80.342              |
| Número de acciones recompradas                             | (3.688)            | (247.792)           | 0                    | (144.707)           |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 41.857             | 1.659.054           | 131.626              | 44.784              |

### Estadísticas

|                              | EUR    | EUR    | EUR      | EUR    |
|------------------------------|--------|--------|----------|--------|
| Valor activo neto por acción |        |        |          |        |
| 30 de junio de 2021          | 154,19 | 237,80 | 1.540,33 | 241,27 |
| 31 de diciembre de 2020      | 153,50 | 236,25 | 1.528,95 | 239,45 |
| 31 de diciembre de 2019      | 151,77 | 232,83 | 1.503,79 | 235,45 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Emerging Debt<br>Local Currencies |                   |                         |                       |
|------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|-------------------|-------------------------|-----------------------|
|                                                            | C<br>Capitalización                                 | C<br>Distribución | C EUR<br>Capitalización | C EUR<br>Distribución |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 24.690                                              | 11.363            | 484.516                 | 1.584.282             |
| Número de acciones emitidas                                | 2.933                                               | 0                 | 53.333                  | 204.242               |
| Número de acciones recompradas                             | (3.322)                                             | (1.752)           | (65.931)                | (240.393)             |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 24.301                                              | 9.611             | 471.918                 | 1.548.131             |

### Estadísticas

|                              |             |       |       |       |
|------------------------------|-------------|-------|-------|-------|
| Valor activo neto global     | USD         |       |       |       |
| 30 de junio de 2021          | 320.661.139 |       |       |       |
| 31 de diciembre de 2020      | 429.791.776 |       |       |       |
| 31 de diciembre de 2019      | 385.435.481 |       |       |       |
| Valor activo neto por acción | USD         | USD   | EUR   | EUR   |
| 30 de junio de 2021          | 98,56       | 72,41 | 82,83 | 61,53 |
| 31 de diciembre de 2020      | 106,68      | 82,43 | 86,91 | 67,85 |
| 31 de diciembre de 2019      | 100,20      | 81,68 | 89,05 | 73,19 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies

|                                                            | CQ<br>Distribución | I<br>Capitalización | I EUR<br>Capitalización | I EUR H<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------------|---------------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 5.916              | 18.689              | 19.318                  | 3.350                     |
| Número de acciones emitidas                                | 2.089              | 533                 | 750                     | 0                         |
| Número de acciones recompradas                             | (228)              | (864)               | (18.020)                | 0                         |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 7.777              | 18.358              | 2.047                   | 3.350                     |

### Estadísticas

|                              | USD    | USD      | EUR      | EUR      |
|------------------------------|--------|----------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción |        |          |          |          |
| 30 de junio de 2021          | 142,34 | 1.033,25 | 1.258,40 | 1.435,69 |
| 31 de diciembre de 2020      | 158,35 | 1.110,32 | 1.310,56 | 1.555,88 |
| 31 de diciembre de 2019      | 157,19 | 1.046,19 | 1.345,98 | 1.493,34 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies

|                                                            | N EUR<br>Capitalización | R<br>Capitalización | R EUR<br>Capitalización | R GBP<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|-------------------------|---------------------|-------------------------|-------------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 4.089                   | 990                 | 3.396                   | 6                       |
| Número de acciones emitidas                                | 1.230                   | 0                   | 0                       | 0                       |
| Número de acciones recompradas                             | (1.763)                 | (269)               | 0                       | 0                       |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 3.557                   | 720                 | 3.396                   | 6                       |

### Estadísticas

|                                                     | EUR    | USD    | EUR    | GBP    |
|-----------------------------------------------------|--------|--------|--------|--------|
| Valor activo neto por acción<br>30 de junio de 2021 | 151,35 | 101,45 | 161,38 | 158,03 |
| 31 de diciembre de 2020                             | 159,22 | 109,57 | 168,94 | 172,51 |
| 31 de diciembre de 2019                             | 163,99 | 102,51 | 172,29 | 166,59 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies

|                                                            | R2<br>Distribución | R2 EUR<br>Distribución | V<br>Capitalización | Z<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|--------------------|------------------------|---------------------|---------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 133.494            | 30.949                 | 1.819               | 116.066             |
| Número de acciones emitidas                                | 7.737              | 1.239                  | 0                   | 10.687              |
| Número de acciones recompradas                             | (133.289)          | (28.331)               | (391)               | (18.865)            |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 7.941              | 3.857                  | 1.428               | 107.888             |

### Estadísticas

|                              | USD    | EUR    | USD      | USD      |
|------------------------------|--------|--------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción |        |        |          |          |
| 30 de junio de 2021          | 135,68 | 130,78 | 1.101,04 | 1.099,30 |
| 31 de diciembre de 2020      | 153,78 | 143,60 | 1.180,43 | 1.183,07 |
| 31 de diciembre de 2019      | 151,19 | 153,58 | 1.110,26 | 1.098,94 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Emerging Debt<br>Local Currencies | Candriam Bonds<br>Emerging Markets |                   |                           |
|------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|------------------------------------|-------------------|---------------------------|
|                                                            | Z EUR<br>Capitalización                             | C<br>Capitalización                | C<br>Distribución | C EUR H<br>Capitalización |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 7.956                                               | 59.983                             | 127.814           | 21.842                    |
| Número de acciones emitidas                                | 0                                                   | 1.885                              | 8.706             | 650                       |
| Número de acciones recompradas                             | (4.850)                                             | (11.824)                           | (17.982)          | (5.194)                   |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 3.106                                               | 50.044                             | 118.539           | 17.299                    |

### Estadísticas

|                              |          |               |          |          |
|------------------------------|----------|---------------|----------|----------|
| Valor activo neto global     |          | USD           |          |          |
| 30 de junio de 2021          |          | 1.194.315.427 |          |          |
| 31 de diciembre de 2020      |          | 1.772.561.985 |          |          |
| 31 de diciembre de 2019      |          | 3.058.915.131 |          |          |
| Valor activo neto por acción | EUR      | USD           | USD      | EUR      |
| 30 de junio de 2021          | 1.683,66 | 2.749,41      | 938,30   | 1.319,72 |
| 31 de diciembre de 2020      | 1.756,17 | 2.762,21      | 988,44   | 1.331,76 |
| 31 de diciembre de 2019      | 1.778,14 | 2.748,93      | 1.042,03 | 1.353,35 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Emerging Markets

|                                                            | CQ<br>Distribución | I<br>Capitalización | I<br>Distribución | I EUR<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|-------------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 115.468            | 54.021              | 6.227             | 3.181                   |
| Número de acciones emitidas                                | 1.003              | 10.098              | 1.002             | 292                     |
| Número de acciones recompradas                             | (19.996)           | (16.092)            | (965)             | (1.846)                 |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 96.475             | 48.027              | 6.263             | 1.627                   |

### Estadísticas

|                              | USD    | USD      | USD      | EUR      |
|------------------------------|--------|----------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción |        |          |          |          |
| 30 de junio de 2021          | 154,21 | 3.031,16 | 1.505,43 | 1.831,35 |
| 31 de diciembre de 2020      | 158,45 | 3.039,28 | 1.582,28 | 1.779,80 |
| 31 de diciembre de 2019      | 166,51 | 3.006,67 | 1.657,78 | 1.919,55 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Emerging Markets

|                                                            | I EUR H<br>Capitalización | I GBP<br>Capitalización | IQ EUR H<br>Distribución | IQ GBP H<br>Distribución |
|------------------------------------------------------------|---------------------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 60.975                    | 1                       | 7.439                    | 383                      |
| Número de acciones emitidas                                | 2.839                     | 0                       | 0                        | 0                        |
| Número de acciones recompradas                             | (18.505)                  | 0                       | (101)                    | (174)                    |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 45.309                    | 1                       | 7.338                    | 209                      |

### Estadísticas

|                              | EUR      | GBP      | EUR      | GBP      |
|------------------------------|----------|----------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción |          |          |          |          |
| 30 de junio de 2021          | 1.500,87 | 2.023,39 | 1.235,55 | 1.281,03 |
| 31 de diciembre de 2020      | 1.511,86 | 2.049,47 | 1.271,27 | 1.312,00 |
| 31 de diciembre de 2019      | 1.527,30 | 2.094,48 | 1.354,73 | 1.396,26 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Emerging Markets

|                                                            | L<br>Capitalización | N<br>Capitalización | R<br>Capitalización | R CHF H<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 1.760               | 2.301               | 87.683              | 8.242                     |
| Número de acciones emitidas                                | 68                  | 87                  | 3.469               | 20.200                    |
| Número de acciones recompradas                             | (301)               | (353)               | (22.522)            | (200)                     |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 1.527               | 2.035               | 68.630              | 28.242                    |

### Estadísticas

|                              | USD      | USD      | USD    | CHF    |
|------------------------------|----------|----------|--------|--------|
| Valor activo neto por acción |          |          |        |        |
| 30 de junio de 2021          | 2.707,20 | 2.372,02 | 143,39 | 150,55 |
| 31 de diciembre de 2020      | 2.721,50 | 2.389,86 | 143,76 | 151,84 |
| 31 de diciembre de 2019      | 2.709,82 | 2.392,17 | 142,46 | 154,10 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Emerging Markets

|                                                            | R EUR<br>Capitalización | R EUR H<br>Capitalización | R GBP H<br>Capitalización | RQ<br>Distribución |
|------------------------------------------------------------|-------------------------|---------------------------|---------------------------|--------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 8.950                   | 1.117                     | 126                       | 15.897             |
| Número de acciones emitidas                                | 568                     | 224                       | 335                       | 22.403             |
| Número de acciones recompradas                             | (2.385)                 | (233)                     | 0                         | (6.399)            |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 7.133                   | 1.108                     | 461                       | 31.900             |

### Estadísticas

|                                                     | EUR    | EUR    | GBP    | USD    |
|-----------------------------------------------------|--------|--------|--------|--------|
| Valor activo neto por acción<br>30 de junio de 2021 | 183,64 | 150,50 | 170,76 | 150,78 |
| 31 de diciembre de 2020                             | 178,44 | 151,62 | 171,42 | 154,87 |
| 31 de diciembre de 2019                             | 192,77 | 153,45 | 172,95 | -      |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Emerging Markets

|                                                            | R2<br>Capitalización | R2<br>Distribución | R2 EUR H<br>Capitalización | V EUR<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|----------------------|--------------------|----------------------------|-------------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 9.850                | 347.806            | 6.509                      | 2.795                   |
| Número de acciones emitidas                                | 0                    | 32.556             | 1.445                      | 0                       |
| Número de acciones recompradas                             | (854)                | (19.357)           | 0                          | (528)                   |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 8.996                | 361.005            | 7.954                      | 2.267                   |

### Estadísticas

|                              | USD    | USD    | EUR    | EUR      |
|------------------------------|--------|--------|--------|----------|
| Valor activo neto por acción |        |        |        |          |
| 30 de junio de 2021          | 159,76 | 140,99 | 146,83 | 1.816,12 |
| 31 de diciembre de 2020      | 159,89 | 147,89 | 147,65 | 1.763,25 |
| 31 de diciembre de 2019      | 157,91 | 154,62 | 148,86 | 1.896,45 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Emerging Markets

|                                                            | V EUR H<br>Capitalización | V2<br>Capitalización | V2 GBP<br>Capitalización | V2Q GBP H<br>Distribución |
|------------------------------------------------------------|---------------------------|----------------------|--------------------------|---------------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 127.170                   | 117.519              | 2                        | 198.821                   |
| Número de acciones emitidas                                | 9.262                     | 32.780               | 0                        | 7.380                     |
| Número de acciones recompradas                             | (82.735)                  | (4.121)              | 0                        | (203.082)                 |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 53.697                    | 146.178              | 2                        | 3.118                     |

### Estadísticas

|                                                     | EUR      | USD      | GBP      | GBP      |
|-----------------------------------------------------|----------|----------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción<br>30 de junio de 2021 | 1.489,19 | 1.655,98 | 1.352,29 | 1.276,73 |
| 31 de diciembre de 2020                             | 1.498,92 | 1.657,79 | 1.368,45 | 1.306,41 |
| 31 de diciembre de 2019                             | 1.510,82 | 1.638,06 | 1.396,07 | 1.387,29 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Emerging Markets

|                                                            | Z<br>Capitalización | Z<br>Distribución | Z EUR H<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|---------------------|-------------------|---------------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 45.190              | 28.118            | 26.544                    |
| Número de acciones emitidas                                | 12.989              | 859               | 4.979                     |
| Número de acciones recompradas                             | (8.027)             | (10.649)          | (17.481)                  |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 50.152              | 18.328            | 14.042                    |

### Estadísticas

|                                                     | USD      | USD      | EUR      |
|-----------------------------------------------------|----------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción<br>30 de junio de 2021 | 3.326,38 | 1.574,01 | 1.591,04 |
| 31 de diciembre de 2020                             | 3.322,76 | 1.647,89 | 1.596,55 |
| 31 de diciembre de 2019                             | 3.269,25 | 1.716,30 | 1.604,92 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Emerging Markets<br>Corporate |                   |                     |                    |
|------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------|-------------------|---------------------|--------------------|
|                                                            | C<br>Capitalización                             | C<br>Distribución | I<br>Capitalización | I*<br>Distribución |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 10                                              | 4.335             | 341                 | 50                 |
| Número de acciones emitidas                                | 0                                               | 0                 | 3.041               | 0                  |
| Número de acciones recompradas                             | 0                                               | (635)             | 0                   | (50)               |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 10                                              | 3.700             | 3.382               | 0                  |

### Estadísticas

|                              |             |        |          |          |
|------------------------------|-------------|--------|----------|----------|
| Valor activo neto global     | USD         |        |          |          |
| 30 de junio de 2021          | 158.135.668 |        |          |          |
| 31 de diciembre de 2020      | 160.943.678 |        |          |          |
| 31 de diciembre de 2019      | 98.455.965  |        |          |          |
| Valor activo neto por acción | USD         | USD    | USD      | USD      |
| 30 de junio de 2021          | 157,83      | 150,71 | 1.598,01 | -        |
| 31 de diciembre de 2020      | 158,36      | 156,77 | 1.597,21 | 1.554,09 |
| 31 de diciembre de 2019      | 151,71      | 150,16 | 1.517,97 | -        |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Emerging Markets Corporate

|                                                            | I EUR H<br>Capitalización | I2<br>Capitalización | R<br>Capitalización | R2<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|---------------------------|----------------------|---------------------|----------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 9.376                     | 1                    | 1                   | 180                  |
| Número de acciones emitidas                                | 92                        | 0                    | 0                   | 0                    |
| Número de acciones recompradas                             | (2.796)                   | 0                    | 0                   | 0                    |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 6.672                     | 1                    | 1                   | 180                  |

### Estadísticas

| Valor activo neto por acción | EUR      | USD      | USD    | USD    |
|------------------------------|----------|----------|--------|--------|
| 30 de junio de 2021          | 1.549,03 | 1.576,00 | 160,25 | 158,15 |
| 31 de diciembre de 2020      | 1.544,01 | 1.576,67 | 159,95 | 157,98 |
| 31 de diciembre de 2019      | 1.511,01 | 1.500,34 | 151,76 | 149,99 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Emerging Markets<br>Corporate |                     |                   | Candriam Bonds<br>Emerging Markets<br>Total Return |  |
|------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------|---------------------|-------------------|----------------------------------------------------|--|
|                                                            | R2<br>Distribución                              | Z<br>Capitalización | Z<br>Distribución | C<br>Capitalización                                |  |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 178.403                                         | 70.522              | 173               | 71                                                 |  |
| Número de acciones emitidas                                | 13.486                                          | 3.882               | 202               | 0                                                  |  |
| Número de acciones recompradas                             | (7.673)                                         | (5.506)             | 0                 | 0                                                  |  |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 184.216                                         | 68.898              | 375               | 71                                                 |  |

### Estadísticas

|                              |             |          |          |        |
|------------------------------|-------------|----------|----------|--------|
| Valor activo neto global     | USD         |          |          |        |
| 30 de junio de 2021          | 70.274.503  |          |          |        |
| 31 de diciembre de 2020      | 87.097.922  |          |          |        |
| 31 de diciembre de 2019      | 118.108.979 |          |          |        |
| Valor activo neto por acción | USD         | USD      | USD      | USD    |
| 30 de junio de 2021          | 153,20      | 1.612,19 | 1.565,88 | 153,74 |
| 31 de diciembre de 2020      | 158,64      | 1.606,97 | 1.560,82 | 160,23 |
| 31 de diciembre de 2019      | 150,62      | 1.519,25 | -        | 152,58 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Emerging Markets Total Return

|                                                            | C EUR H*<br>Capitalización | I<br>Capitalización | I EUR H<br>Capitalización | R<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|----------------------------|---------------------|---------------------------|---------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 70                         | 13                  | 2.500                     | 112                 |
| Número de acciones emitidas                                | 0                          | 0                   | 0                         | 113                 |
| Número de acciones recompradas                             | (70)                       | (12)                | (1.000)                   | 0                   |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 0                          | 1                   | 1.500                     | 225                 |

### Estadísticas

|                              | EUR    | USD      | EUR      | USD    |
|------------------------------|--------|----------|----------|--------|
| Valor activo neto por acción |        |          |          |        |
| 30 de junio de 2021          | -      | 1.587,29 | 1.471,90 | 159,05 |
| 31 de diciembre de 2020      | 153,74 | 1.644,22 | 1.536,06 | 165,35 |
| 31 de diciembre de 2019      | 148,82 | 1.556,82 | 1.475,77 | 156,61 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Emerging Markets<br>Total Return | Candriam Bonds<br>Euro |                   |                     |
|------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|------------------------|-------------------|---------------------|
|                                                            | Z<br>Capitalización                                | C<br>Capitalización    | C<br>Distribución | I<br>Capitalización |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 48.840                                             | 44.880                 | 36.474            | 17.480              |
| Número de acciones emitidas                                | 1.723                                              | 235                    | 1.361             | 983                 |
| Número de acciones recompradas                             | (9.007)                                            | (5.224)                | (3.542)           | (9.427)             |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 41.556                                             | 39.891                 | 34.293            | 9.037               |

### Estadísticas

|                              |          |             |        |          |
|------------------------------|----------|-------------|--------|----------|
| Valor activo neto global     |          | EUR         |        |          |
| 30 de junio de 2021          |          | 545.236.682 |        |          |
| 31 de diciembre de 2020      |          | 570.227.013 |        |          |
| 31 de diciembre de 2019      |          | 472.069.156 |        |          |
| Valor activo neto por acción | USD      | EUR         | EUR    | EUR      |
| 30 de junio de 2021          | 1.626,91 | 1.237,64    | 286,04 | 1.353,77 |
| 31 de diciembre de 2020      | 1.685,82 | 1.267,07    | 294,46 | 1.382,82 |
| 31 de diciembre de 2019      | 1.587,39 | 1.230,01    | 288,82 | 1.334,47 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Euro

|                                                            | R<br>Capitalización | R2<br>Capitalización | V<br>Capitalización | Z<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|---------------------|----------------------|---------------------|---------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 15.646              | 250                  | 34.500              | 220.786             |
| Número de acciones emitidas                                | 46                  | 0                    | 1.300               | 23.589              |
| Número de acciones recompradas                             | (776)               | 0                    | (4.700)             | (18.524)            |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 14.916              | 250                  | 31.100              | 225.851             |

### Estadísticas

|                              | EUR    | EUR    | EUR      | EUR      |
|------------------------------|--------|--------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción |        |        |          |          |
| 30 de junio de 2021          | 124,63 | 160,52 | 1.625,85 | 1.403,50 |
| 31 de diciembre de 2020      | 127,34 | 163,92 | 1.660,22 | 1.431,45 |
| 31 de diciembre de 2019      | 123,15 | 158,31 | 1.600,51 | 1.379,22 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Euro | Candriam Bonds<br>Euro Corporate |                   |                     |
|------------------------------------------------------------|------------------------|----------------------------------|-------------------|---------------------|
|                                                            | Z<br>Distribución      | C<br>Capitalización              | C<br>Distribución | I<br>Capitalización |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 62.630                 | 1.846                            | 43                | 18.024              |
| Número de acciones emitidas                                | 3.867                  | 78                               | 23                | 493                 |
| Número de acciones recompradas                             | (1.469)                | (400)                            | (20)              | (3.029)             |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 65.028                 | 1.524                            | 45                | 15.488              |

### Estadísticas

|                              |             |          |          |          |
|------------------------------|-------------|----------|----------|----------|
| Valor activo neto global     | EUR         |          |          |          |
| 30 de junio de 2021          | 894.901.342 |          |          |          |
| 31 de diciembre de 2020      | 955.924.643 |          |          |          |
| 31 de diciembre de 2019      | 787.558.550 |          |          |          |
| Valor activo neto por acción | EUR         | EUR      | EUR      | EUR      |
| 30 de junio de 2021          | 1.605,13    | 7.915,50 | 5.665,83 | 8.398,26 |
| 31 de diciembre de 2020      | 1.646,06    | 7.957,40 | 5.736,51 | 8.428,55 |
| 31 de diciembre de 2019      | 1.602,37    | 7.740,84 | 5.669,00 | 8.174,49 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Euro Corporate

|                                                            | N<br>Capitalización | R<br>Capitalización | Z<br>Capitalización | Z<br>Distribución |
|------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------|---------------------|-------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 6.339               | 4.756               | 84.267              | 27.134            |
| Número de acciones emitidas                                | 69                  | 316                 | 6.906               | 2.194             |
| Número de acciones recompradas                             | (2.280)             | (1.279)             | (11.062)            | (825)             |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 4.128               | 3.793               | 80.111              | 28.503            |

### Estadísticas

|                              | EUR    | EUR    | EUR      | EUR      |
|------------------------------|--------|--------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción |        |        |          |          |
| 30 de junio de 2021          | 150,30 | 123,12 | 8.801,87 | 1.624,09 |
| 31 de diciembre de 2020      | 151,39 | 123,63 | 8.817,95 | 1.638,65 |
| 31 de diciembre de 2019      | 147,87 | 119,97 | 8.518,78 | 1.608,10 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Euro Corporate ex-<br>Financials* |                     |                       |                       |
|------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|---------------------|-----------------------|-----------------------|
|                                                            | C**<br>Capitalización                               | C**<br>Distribución | I**<br>Capitalización | Z**<br>Capitalización |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 9.147                                               | 854                 | 14.094                | 164.065               |
| Número de acciones emitidas                                | 591                                                 | 4                   | 142                   | 0                     |
| Número de acciones recompradas                             | (9.738)                                             | (859)               | (14.236)              | (164.065)             |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 0                                                   | 0                   | 0                     | 0                     |

### Estadísticas

|                              |            |        |        |        |
|------------------------------|------------|--------|--------|--------|
| Valor activo neto global     | EUR        |        |        |        |
| 30 de junio de 2021          | -          |        |        |        |
| 31 de diciembre de 2020      | 37.594.748 |        |        |        |
| 31 de diciembre de 2019      | 36.338.851 |        |        |        |
| Valor activo neto por acción | EUR        | EUR    | EUR    | EUR    |
| 30 de junio de 2021          | -          | -      | -      | -      |
| 31 de diciembre de 2020      | 182,03     | 120,54 | 195,62 | 201,56 |
| 31 de diciembre de 2019      | 177,74     | 119,55 | 190,26 | 195,46 |

\*Ver nota 1

\*\*Última valoración 29 de junio de 2021

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Euro Diversified |                   |                     |                     |
|------------------------------------------------------------|------------------------------------|-------------------|---------------------|---------------------|
|                                                            | C<br>Capitalización                | C<br>Distribución | I<br>Capitalización | R<br>Capitalización |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 40.922                             | 5.348             | 9.567               | 8.400               |
| Número de acciones emitidas                                | 195                                | 5                 | 4                   | 0                   |
| Número de acciones recompradas                             | (2.433)                            | (152)             | (134)               | (900)               |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 38.685                             | 5.201             | 9.436               | 7.500               |

### Estadísticas

|                              |             |        |          |        |
|------------------------------|-------------|--------|----------|--------|
| Valor activo neto global     | EUR         |        |          |        |
| 30 de junio de 2021          | 630.018.409 |        |          |        |
| 31 de diciembre de 2020      | 628.476.315 |        |          |        |
| 31 de diciembre de 2019      | 472.247.737 |        |          |        |
| Valor activo neto por acción | EUR         | EUR    | EUR      | EUR    |
| 30 de junio de 2021          | 1.038,92    | 317,82 | 1.132,36 | 155,07 |
| 31 de diciembre de 2020      | 1.047,04    | 320,72 | 1.138,98 | 156,02 |
| 31 de diciembre de 2019      | 1.031,87    | 317,87 | 1.117,12 | 153,24 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Euro Diversified |                     |                   | Candriam Bonds<br>Euro Government |  |
|------------------------------------------------------------|------------------------------------|---------------------|-------------------|-----------------------------------|--|
|                                                            | R2<br>Distribución                 | Z<br>Capitalización | Z<br>Distribución | C<br>Capitalización               |  |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 1.000                              | 612.917             | 0                 | 10.664                            |  |
| Número de acciones emitidas                                | 0                                  | 60.723              | 0                 | 2.629                             |  |
| Número de acciones recompradas                             | 0                                  | (53.097)            | 0                 | (2.215)                           |  |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 1.000                              | 620.543             | 0                 | 11.078                            |  |

### Estadísticas

|                              |        |        |          |             |
|------------------------------|--------|--------|----------|-------------|
| Valor activo neto global     |        |        |          | EUR         |
| 30 de junio de 2021          |        |        |          | 827.485.043 |
| 31 de diciembre de 2020      |        |        |          | 776.149.490 |
| 31 de diciembre de 2019      |        |        |          | 916.202.346 |
| Valor activo neto por acción | EUR    | EUR    | EUR      | EUR         |
| 30 de junio de 2021          | 152,77 | 928,50 | -        | 2.491,10    |
| 31 de diciembre de 2020      | 153,62 | 932,51 | -        | 2.573,93    |
| 31 de diciembre de 2019      | -      | 912,60 | 1.539,18 | 2.462,98    |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Euro Government

|                                                            | C<br>Distribución | I<br>Capitalización | I<br>Distribución | N<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|-------------------|---------------------|-------------------|---------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 15.800            | 167.519             | 2.574             | 1.483               |
| Número de acciones emitidas                                | 103               | 35.912              | 12                | 255                 |
| Número de acciones recompradas                             | (2.757)           | (15.706)            | (1.129)           | (243)               |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 13.146            | 187.725             | 1.457             | 1.495               |

### Estadísticas

|                                                     | EUR      | EUR      | EUR      | EUR      |
|-----------------------------------------------------|----------|----------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción<br>30 de junio de 2021 | 1.210,25 | 2.724,17 | 1.492,85 | 2.343,02 |
| 31 de diciembre de 2020                             | 1.257,76 | 2.807,98 | 1.547,39 | 2.422,84 |
| 31 de diciembre de 2019                             | 1.218,91 | 2.672,48 | -        | 2.322,24 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Euro Government

|                                                            | R<br>Capitalización | R2*<br>Distribución | Z<br>Capitalización | Z<br>Distribución |
|------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------|---------------------|-------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 33.439              | 156                 | 74.677              | 17.799            |
| Número de acciones emitidas                                | 115.521             | 0                   | 15.017              | 131               |
| Número de acciones recompradas                             | (7.576)             | (156)               | (12.603)            | (885)             |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 141.383             | 0                   | 77.091              | 17.045            |

### Estadísticas

|                              | EUR    | EUR    | EUR      | EUR      |
|------------------------------|--------|--------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción |        |        |          |          |
| 30 de junio de 2021          | 165,31 | -      | 2.806,62 | 1.593,78 |
| 31 de diciembre de 2020      | 170,52 | 164,96 | 2.889,31 | 1.649,94 |
| 31 de diciembre de 2019      | 162,57 | 159,02 | 2.744,50 | 1.586,56 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Euro High Yield |                   |                           |                    |
|------------------------------------------------------------|-----------------------------------|-------------------|---------------------------|--------------------|
|                                                            | C<br>Capitalización               | C<br>Distribución | C USD H<br>Capitalización | CQ<br>Distribución |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 188.079                           | 1.168.496         | 11.659                    | 25.280             |
| Número de acciones emitidas                                | 37.181                            | 144.669           | 355                       | 10.113             |
| Número de acciones recompradas                             | (35.449)                          | (153.074)         | (6.540)                   | (2.321)            |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 189.811                           | 1.160.091         | 5.474                     | 33.072             |

### Estadísticas

|                              |               |        |        |        |
|------------------------------|---------------|--------|--------|--------|
| Valor activo neto global     | EUR           |        |        |        |
| 30 de junio de 2021          | 3.251.113.029 |        |        |        |
| 31 de diciembre de 2020      | 3.109.660.440 |        |        |        |
| 31 de diciembre de 2019      | 2.892.211.934 |        |        |        |
| Valor activo neto por acción | EUR           | EUR    | USD    | EUR    |
| 30 de junio de 2021          | 1.271,42      | 190,27 | 213,08 | 163,11 |
| 31 de diciembre de 2020      | 1.255,97      | 193,74 | 209,74 | 163,47 |
| 31 de diciembre de 2019      | 1.208,19      | 194,75 | 198,75 | 162,00 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Euro High Yield

|                                                            | I<br>Capitalización | I<br>Distribución | I GBP<br>Capitalización | I USD H<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|---------------------|-------------------|-------------------------|---------------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 512.080             | 92.506            | 7                       | 2.133                     |
| Número de acciones emitidas                                | 108.066             | 8.421             | 0                       | 11                        |
| Número de acciones recompradas                             | (195.514)           | (12.646)          | (6)                     | (1.199)                   |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 424.632             | 88.280            | 1                       | 946                       |

### Estadísticas

|                              | EUR      | EUR      | GBP      | USD      |
|------------------------------|----------|----------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción |          |          |          |          |
| 30 de junio de 2021          | 1.375,81 | 1.649,49 | 2.154,80 | 1.740,77 |
| 31 de diciembre de 2020      | 1.353,64 | 1.672,62 | 2.213,22 | 1.709,10 |
| 31 de diciembre de 2019      | 1.302,66 | 1.681,56 | 2.020,87 | 1.534,06 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Euro High Yield

|                                                            | L<br>Capitalización | N<br>Capitalización | R<br>Capitalización | R CHF H<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 9.013               | 22.705              | 699.893             | 47.083                    |
| Número de acciones emitidas                                | 101                 | 5.871               | 306.286             | 6.269                     |
| Número de acciones recompradas                             | (1.614)             | (4.259)             | (282.232)           | (540)                     |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 7.501               | 24.317              | 723.947             | 52.812                    |

### Estadísticas

|                                                     | EUR      | EUR      | EUR    | CHF    |
|-----------------------------------------------------|----------|----------|--------|--------|
| Valor activo neto por acción<br>30 de junio de 2021 | 1.254,09 | 1.152,75 | 144,49 | 168,49 |
| 31 de diciembre de 2020                             | 1.239,52 | 1.140,88 | 142,44 | 166,35 |
| 31 de diciembre de 2019                             | 1.193,53 | 1.101,58 | 136,44 | 160,12 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Euro High Yield

|                                                            | R GBP<br>Capitalización | RQ<br>Distribución | RQ GBP H<br>Distribución | R2<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|-------------------------|--------------------|--------------------------|----------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 4                       | 3.517              | 2.006                    | 1.148                |
| Número de acciones emitidas                                | 0                       | 2.258              | 915                      | 0                    |
| Número de acciones recompradas                             | 0                       | 0                  | 0                        | 0                    |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 4                       | 5.775              | 2.921                    | 1.148                |

### Estadísticas

|                              | GBP    | EUR    | GBP    | EUR    |
|------------------------------|--------|--------|--------|--------|
| Valor activo neto por acción |        |        |        |        |
| 30 de junio de 2021          | 217,54 | 157,17 | 163,18 | 174,07 |
| 31 de diciembre de 2020      | 223,53 | 157,22 | 162,66 | 171,29 |
| 31 de diciembre de 2019      | 202,59 | 155,16 | 160,57 | 163,53 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Euro High Yield

|                                                            | R2<br>Distribución | S<br>Capitalización | S<br>Distribución | S CHF H<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|---------------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 73.857             | 75.687              | 138.519           | 693                       |
| Número de acciones emitidas                                | 5.537              | 84.705              | 3.307             | 256                       |
| Número de acciones recompradas                             | (12.832)           | (15.889)            | (19.381)          | (141)                     |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 66.562             | 144.503             | 122.445           | 807                       |

### Estadísticas

|                                                     | EUR    | EUR      | EUR      | CHF      |
|-----------------------------------------------------|--------|----------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción<br>30 de junio de 2021 | 158,42 | 1.641,52 | 1.657,68 | 1.635,47 |
| 31 de diciembre de 2020                             | 160,62 | 1.614,99 | 1.655,26 | 1.611,56 |
| 31 de diciembre de 2019                             | 160,10 | -        | 1.645,79 | -        |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Euro High Yield

|                                                            | S GBP H<br>Capitalización | S USD H<br>Capitalización | S USD H<br>Distribución | S2<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|---------------------------|---------------------------|-------------------------|----------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 380                       | 38.526                    | 4.560                   | 80.979               |
| Número de acciones emitidas                                | 21                        | 6.961                     | 70                      | 0                    |
| Número de acciones recompradas                             | (9)                       | (6.088)                   | 0                       | 0                    |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 392                       | 39.399                    | 4.630                   | 80.979               |

### Estadísticas

|                                                     | GBP      | USD      | USD      | EUR      |
|-----------------------------------------------------|----------|----------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción<br>30 de junio de 2021 | 1.648,62 | 1.654,76 | 1.606,26 | 1.756,30 |
| 31 de diciembre de 2020                             | 1.617,83 | 1.622,63 | 1.622,64 | 1.726,75 |
| 31 de diciembre de 2019                             | -        | -        | -        | 1.645,46 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Euro High Yield |                     |                     | Candriam Bonds<br>Euro Long Term |
|------------------------------------------------------------|-----------------------------------|---------------------|---------------------|----------------------------------|
|                                                            | S4<br>Capitalización              | V<br>Capitalización | Z<br>Capitalización | C<br>Capitalización              |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 49.184                            | 423.877             | 493.165             | 1.513                            |
| Número de acciones emitidas                                | 0                                 | 124.221             | 47.865              | 88                               |
| Número de acciones recompradas                             | 0                                 | (52.393)            | (96.738)            | (578)                            |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 49.184                            | 495.705             | 444.292             | 1.023                            |

### Estadísticas

|                              |          |          |        |             |
|------------------------------|----------|----------|--------|-------------|
| Valor activo neto global     |          |          |        | EUR         |
| 30 de junio de 2021          |          |          |        | 102.535.851 |
| 31 de diciembre de 2020      |          |          |        | 137.723.569 |
| 31 de diciembre de 2019      |          |          |        | 70.726.961  |
| Valor activo neto por acción | EUR      | EUR      | EUR    | EUR         |
| 30 de junio de 2021          | 1.585,17 | 2.130,12 | 246,69 | 9.615,46    |
| 31 de diciembre de 2020      | 1.559,34 | 2.091,76 | 242,29 | 10.091,33   |
| 31 de diciembre de 2019      | -        | 2.008,46 | 230,41 | 9.403,36    |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Euro Long Term |                     |                     | Candriam Bonds<br>Euro Short Term |
|------------------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------|---------------------|-----------------------------------|
|                                                            | C<br>Distribución                | I<br>Capitalización | Z<br>Capitalización | C<br>Capitalización               |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 711                              | 2.621               | 390.636             | 58.358                            |
| Número de acciones emitidas                                | 58                               | 64                  | 30.872              | 6.407                             |
| Número de acciones recompradas                             | (91)                             | (2.639)             | (17.219)            | (18.807)                          |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 678                              | 46                  | 404.289             | 45.959                            |

### Estadísticas

|                              |          |           |        |               |
|------------------------------|----------|-----------|--------|---------------|
| Valor activo neto global     |          |           |        | EUR           |
| 30 de junio de 2021          |          |           |        | 1.450.384.829 |
| 31 de diciembre de 2020      |          |           |        | 1.640.766.142 |
| 31 de diciembre de 2019      |          |           |        | 1.887.573.647 |
| Valor activo neto por acción | EUR      | EUR       | EUR    | EUR           |
| 30 de junio de 2021          | 5.141,34 | 10.537,12 | 219,47 | 2.075,17      |
| 31 de diciembre de 2020      | 5.454,31 | 11.034,53 | 229,53 | 2.081,98      |
| 31 de diciembre de 2019      | 5.163,51 | 10.231,13 | 212,39 | 2.088,23      |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Euro Short Term

|                                                            | C<br>Distribución | I<br>Capitalización | I<br>Distribución | N<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|-------------------|---------------------|-------------------|---------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 2.645             | 168.740             | 16.486            | 1.216               |
| Número de acciones emitidas                                | 8.929             | 28.852              | 0                 | 13                  |
| Número de acciones recompradas                             | (1.083)           | (54.684)            | (15.512)          | (279)               |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 10.491            | 142.908             | 973               | 950                 |

### Estadísticas

|                              | EUR      | EUR      | EUR      | EUR      |
|------------------------------|----------|----------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción |          |          |          |          |
| 30 de junio de 2021          | 1.390,26 | 2.192,86 | 1.500,73 | 1.920,61 |
| 31 de diciembre de 2020      | 1.395,99 | 2.197,01 | 1.503,54 | 1.930,72 |
| 31 de diciembre de 2019      | 1.401,78 | 2.196,76 | 1.503,62 | 1.944,22 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Euro Short Term

|                                                            | R<br>Capitalización | R2<br>Distribución | S<br>Capitalización | Z<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|---------------------|--------------------|---------------------|---------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 907.147             | 2.385              | 500.819             | 96.277              |
| Número de acciones emitidas                                | 38.276              | 0                  | 162.078             | 9.460               |
| Número de acciones recompradas                             | (710.990)           | (450)              | (144.924)           | (17.626)            |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 234.434             | 1.935              | 517.974             | 88.111              |

### Estadísticas

|                              | EUR    | EUR    | EUR      | EUR      |
|------------------------------|--------|--------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción |        |        |          |          |
| 30 de junio de 2021          | 149,18 | 149,90 | 1.528,57 | 2.232,86 |
| 31 de diciembre de 2020      | 149,52 | 150,16 | 1.530,64 | 2.234,65 |
| 31 de diciembre de 2019      | 149,72 | 150,16 | 1.529,40 | 2.230,40 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Floating Rate Notes |                     |                     |                       |
|------------------------------------------------------------|---------------------------------------|---------------------|---------------------|-----------------------|
|                                                            | BF<br>Capitalización                  | C<br>Capitalización | I<br>Capitalización | PI*<br>Capitalización |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 254.200                               | 7                   | 18.513              | 0                     |
| Número de acciones emitidas                                | 2.700                                 | 0                   | 53.194              | 18.647                |
| Número de acciones recompradas                             | (56.900)                              | 0                   | (667)               | 0                     |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 200.000                               | 7                   | 71.040              | 18.647                |

### Estadísticas

|                              |             |        |          |          |
|------------------------------|-------------|--------|----------|----------|
| Valor activo neto global     | EUR         |        |          |          |
| 30 de junio de 2021          | 549.687.723 |        |          |          |
| 31 de diciembre de 2020      | 478.704.230 |        |          |          |
| 31 de diciembre de 2019      | 217.747.658 |        |          |          |
| Valor activo neto por acción | EUR         | EUR    | EUR      | EUR      |
| 30 de junio de 2021          | 1.502,66    | 149,32 | 1.500,24 | 1.500,66 |
| 31 de diciembre de 2020      | 1.501,52    | 149,49 | 1.500,46 | -        |
| 31 de diciembre de 2019      | -           | 149,27 | 1.495,59 | -        |

\*Primera valoración el 21 de mayo de 2021

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Floating Rate Notes

|                                                            | R<br>Capitalización | R2<br>Distribución | V<br>Capitalización | Z<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|---------------------|--------------------|---------------------|---------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 3.810               | 70.835             | 25.316              | 13.294              |
| Número de acciones emitidas                                | 0                   | 165.421            | 7.400               | 22.114              |
| Número de acciones recompradas                             | 0                   | 0                  | (7.266)             | (8.618)             |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 3.810               | 236.256            | 25.450              | 26.790              |

### Estadísticas

|                              | EUR    | EUR    | EUR      | EUR      |
|------------------------------|--------|--------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción |        |        |          |          |
| 30 de junio de 2021          | 149,87 | 149,95 | 1.502,33 | 1.506,62 |
| 31 de diciembre de 2020      | 149,92 | 149,96 | 1.502,15 | 1.505,71 |
| 31 de diciembre de 2019      | 149,49 | -      | 1.496,58 | 1.498,60 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Global Government |                   |                     |                        |
|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|-------------------|---------------------|------------------------|
|                                                            | C<br>Capitalización                 | C<br>Distribución | I<br>Capitalización | I AH<br>Capitalización |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 171.214                             | 74.156            | 570.010             | 24.355                 |
| Número de acciones emitidas                                | 6.076                               | 3.045             | 131.124             | 23.361                 |
| Número de acciones recompradas                             | (95.588)                            | (24.627)          | (97.513)            | (42.759)               |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 81.702                              | 52.574            | 603.622             | 4.957                  |

### Estadísticas

|                              |             |       |        |        |
|------------------------------|-------------|-------|--------|--------|
| Valor activo neto global     | EUR         |       |        |        |
| 30 de junio de 2021          | 131.521.174 |       |        |        |
| 31 de diciembre de 2020      | 145.028.067 |       |        |        |
| 31 de diciembre de 2019      | 207.745.143 |       |        |        |
| Valor activo neto por acción | EUR         | EUR   | EUR    | EUR    |
| 30 de junio de 2021          | 145,27      | 37,86 | 157,71 | 147,96 |
| 31 de diciembre de 2020      | 147,96      | 38,99 | 160,23 | 152,20 |
| 31 de diciembre de 2019      | 147,58      | 39,49 | 159,01 | 144,97 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Global Government |                     |                        | Candriam Bonds<br>Global High Yield |
|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|---------------------|------------------------|-------------------------------------|
|                                                            | R<br>Capitalización                 | Z<br>Capitalización | Z AH<br>Capitalización | C<br>Capitalización                 |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 4                                   | 15.733              | 0                      | 272.390                             |
| Número de acciones emitidas                                | 0                                   | 209                 | 0                      | 174.768                             |
| Número de acciones recompradas                             | 0                                   | 0                   | 0                      | (37.587)                            |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 4                                   | 15.942              | 0                      | 409.571                             |

### Estadísticas

|                              |        |          |          |             |
|------------------------------|--------|----------|----------|-------------|
| Valor activo neto global     |        |          |          | EUR         |
| 30 de junio de 2021          |        |          |          | 309.543.959 |
| 31 de diciembre de 2020      |        |          |          | 254.476.909 |
| 31 de diciembre de 2019      |        |          |          | 264.163.693 |
| Valor activo neto por acción | EUR    | EUR      | EUR      | EUR         |
| 30 de junio de 2021          | 146,65 | 1.362,96 | -        | 246,76      |
| 31 de diciembre de 2020      | 148,88 | 1.383,34 | -        | 241,29      |
| 31 de diciembre de 2019      | 147,61 | 1.370,04 | 1.506,12 | 223,43      |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Global High Yield

|                                                            | C<br>Distribución | CQ<br>Distribución | I<br>Capitalización | I USD H<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|-------------------|--------------------|---------------------|---------------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 100.233           | 32.278             | 285.653             | 1                         |
| Número de acciones emitidas                                | 124.511           | 24.056             | 64.507              | 0                         |
| Número de acciones recompradas                             | (9.565)           | (2.519)            | (70.037)            | 0                         |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 215.178           | 53.816             | 280.123             | 1                         |

### Estadísticas

|                              | EUR    | EUR    | EUR    | USD      |
|------------------------------|--------|--------|--------|----------|
| Valor activo neto por acción |        |        |        |          |
| 30 de junio de 2021          | 101,46 | 164,39 | 258,63 | 1.830,37 |
| 31 de diciembre de 2020      | 103,83 | 163,57 | 252,43 | 1.779,67 |
| 31 de diciembre de 2019      | 100,84 | 157,51 | 234,36 | 1.638,50 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Global High Yield

|                                                            | N<br>Capitalización | R<br>Capitalización | RQ GBP<br>Distribución | RQ GBP H<br>Distribución |
|------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------|------------------------|--------------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 47.939              | 22.357              | 6                      | 1.546                    |
| Número de acciones emitidas                                | 27.693              | 31.521              | 0                      | 130                      |
| Número de acciones recompradas                             | (12.527)            | (1.250)             | 0                      | (48)                     |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 63.105              | 52.628              | 6                      | 1.628                    |

### Estadísticas

|                                                     | EUR    | EUR    | GBP    | GBP    |
|-----------------------------------------------------|--------|--------|--------|--------|
| Valor activo neto por acción<br>30 de junio de 2021 | 223,93 | 201,54 | 163,84 | 165,46 |
| 31 de diciembre de 2020                             | 219,62 | 196,69 | 169,68 | 163,77 |
| 31 de diciembre de 2019                             | 204,57 | 181,42 | 154,02 | 156,93 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Global High Yield

|                                                            | R2<br>Capitalización | R2<br>Distribución | V<br>Capitalización | Z<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|----------------------|--------------------|---------------------|---------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 623                  | 143.789            | 1                   | 234.890             |
| Número de acciones emitidas                                | 0                    | 12.486             | 115.546             | 10.031              |
| Número de acciones recompradas                             | 0                    | (7.689)            | 0                   | (152.623)           |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 623                  | 148.586            | 115.547             | 92.298              |

### Estadísticas

|                              | EUR    | EUR    | EUR    | EUR    |
|------------------------------|--------|--------|--------|--------|
| Valor activo neto por acción |        |        |        |        |
| 30 de junio de 2021          | 180,44 | 157,06 | 273,00 | 274,14 |
| 31 de diciembre de 2020      | 175,79 | 160,13 | 266,09 | 266,55 |
| 31 de diciembre de 2019      | 161,56 | 154,35 | 244,09 | 244,05 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Global Inflation<br>Short Duration |                   |                     |                     |
|------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------|---------------------|---------------------|
|                                                            | C<br>Capitalización                                  | C<br>Distribución | I<br>Capitalización | R<br>Capitalización |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 50.195                                               | 14.336            | 19.344              | 1.052               |
| Número de acciones emitidas                                | 46.083                                               | 4.779             | 792.277             | 3.456               |
| Número de acciones recompradas                             | (11.885)                                             | (1.152)           | (269.056)           | (3.522)             |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 84.393                                               | 17.964            | 542.565             | 986                 |

### Estadísticas

|                              |             |        |        |        |
|------------------------------|-------------|--------|--------|--------|
| Valor activo neto global     | EUR         |        |        |        |
| 30 de junio de 2021          | 254.654.009 |        |        |        |
| 31 de diciembre de 2020      | 160.787.989 |        |        |        |
| 31 de diciembre de 2019      | 224.816.751 |        |        |        |
| Valor activo neto por acción | EUR         | EUR    | EUR    | EUR    |
| 30 de junio de 2021          | 141,97      | 111,51 | 153,20 | 107,07 |
| 31 de diciembre de 2020      | 139,76      | 110,36 | 150,47 | 105,19 |
| 31 de diciembre de 2019      | 137,63      | 109,87 | 147,47 | 103,21 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Global Inflation<br>Short Duration |                    |                     | Candriam Bonds<br>International |
|------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|--------------------|---------------------|---------------------------------|
|                                                            | R2<br>Capitalización                                 | R2<br>Distribución | Z<br>Capitalización | C<br>Capitalización             |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 3.374                                                | 175.423            | 928.610             | 58.149                          |
| Número de acciones emitidas                                | 0                                                    | 11.539             | 189.335             | 392                             |
| Número de acciones recompradas                             | 0                                                    | (51.290)           | (103.433)           | (7.876)                         |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 3.374                                                | 135.672            | 1.014.512           | 50.665                          |

### Estadísticas

|                              |        |        |        |             |
|------------------------------|--------|--------|--------|-------------|
| Valor activo neto global     |        |        |        | EUR         |
| 30 de junio de 2021          |        |        |        | 109.589.956 |
| 31 de diciembre de 2020      |        |        |        | 154.518.002 |
| 31 de diciembre de 2019      |        |        |        | 273.807.278 |
| Valor activo neto por acción | EUR    | EUR    | EUR    | EUR         |
| 30 de junio de 2021          | 154,95 | 151,81 | 134,37 | 1.029,47    |
| 31 de diciembre de 2020      | 152,18 | 149,83 | 131,78 | 1.050,04    |
| 31 de diciembre de 2019      | 149,19 | 148,39 | 128,82 | 1.019,65    |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds International

|                                                            | C<br>Distribución | I<br>Capitalización | R<br>Capitalización | R2<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|-------------------|---------------------|---------------------|----------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 62.382            | 4.217               | 697                 | 10.523               |
| Número de acciones emitidas                                | 491               | 994                 | 56                  | 0                    |
| Número de acciones recompradas                             | (15.782)          | (562)               | (494)               | (110)                |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 47.092            | 4.650               | 260                 | 10.413               |

### Estadísticas

|                              | EUR    | EUR      | EUR    | EUR    |
|------------------------------|--------|----------|--------|--------|
| Valor activo neto por acción |        |          |        |        |
| 30 de junio de 2021          | 226,25 | 1.115,90 | 155,03 | 157,15 |
| 31 de diciembre de 2020      | 234,31 | 1.136,02 | 157,91 | 159,91 |
| 31 de diciembre de 2019      | 232,12 | 1.098,08 | 152,93 | 154,55 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>International | Candriam Bonds<br>Total Return |                   |                           |
|------------------------------------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|-------------------|---------------------------|
|                                                            | Z<br>Capitalización             | C<br>Capitalización            | C<br>Distribución | C USD H<br>Capitalización |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 62.214                          | 476.605                        | 339.299           | 1.012                     |
| Número de acciones emitidas                                | 11.837                          | 23.927                         | 177               | 60                        |
| Número de acciones recompradas                             | (39.133)                        | (124.689)                      | (43.322)          | (263)                     |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 34.918                          | 375.843                        | 296.153           | 809                       |

### Estadísticas

|                              |          |               |        |        |
|------------------------------|----------|---------------|--------|--------|
| Valor activo neto global     |          | EUR           |        |        |
| 30 de junio de 2021          |          | 975.291.837   |        |        |
| 31 de diciembre de 2020      |          | 1.076.545.716 |        |        |
| 31 de diciembre de 2019      |          | 1.593.830.914 |        |        |
| Valor activo neto por acción | EUR      | EUR           | EUR    | USD    |
| 30 de junio de 2021          | 1.143,05 | 136,55        | 123,50 | 162,50 |
| 31 de diciembre de 2020      | 1.161,46 | 136,62        | 125,48 | 162,00 |
| 31 de diciembre de 2019      | 1.119,36 | 134,47        | 125,69 | 157,42 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Total Return

|                                                            | CQ<br>Distribución | I<br>Capitalización | I<br>Distribución | I USD H<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|---------------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 31.602             | 237.723             | 27.952            | 5.271                     |
| Número de acciones emitidas                                | 2.557              | 18.080              | 0                 | 168                       |
| Número de acciones recompradas                             | (3.404)            | (4.821)             | (257)             | (351)                     |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 30.755             | 250.983             | 27.695            | 5.088                     |

### Estadísticas

|                              | EUR    | EUR      | EUR      | USD      |
|------------------------------|--------|----------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción |        |          |          |          |
| 30 de junio de 2021          | 139,02 | 1.432,79 | 1.324,09 | 1.645,74 |
| 31 de diciembre de 2020      | 140,06 | 1.429,53 | 1.342,34 | 1.635,93 |
| 31 de diciembre de 2019      | 140,28 | 1.402,88 | 1.338,42 | 1.586,52 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Total Return

|                                                            | N<br>Capitalización | R<br>Capitalización | R GBP H<br>Capitalización | R2<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------|---------------------------|----------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 9.170               | 8.614               | 652                       | 2.700                |
| Número de acciones emitidas                                | 63                  | 1.012               | 355                       | 0                    |
| Número de acciones recompradas                             | (640)               | (2.339)             | (225)                     | (2.640)              |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 8.593               | 7.288               | 782                       | 60                   |

### Estadísticas

|                              |        |        |        |        |
|------------------------------|--------|--------|--------|--------|
| Valor activo neto por acción | EUR    | EUR    | GBP    | EUR    |
| 30 de junio de 2021          | 126,57 | 149,86 | 157,93 | 151,97 |
| 31 de diciembre de 2020      | 126,84 | 149,63 | 157,31 | 151,60 |
| 31 de diciembre de 2019      | 125,23 | 146,61 | 153,67 | 148,35 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

### Candriam Bonds Total Return

|                                                            | R2<br>Distribución | S<br>Capitalización | S<br>Distribución | S GBP H<br>Capitalización |
|------------------------------------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|---------------------------|
| Número de acciones en circulación al principio del período | 303.718            | 25.423              | 91.011            | 105.603                   |
| Número de acciones emitidas                                | 434                | 0                   | 11.751            | 13.751                    |
| Número de acciones recompradas                             | (245.743)          | (3.598)             | (3.292)           | (37.702)                  |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 58.410             | 21.825              | 99.470            | 81.653                    |

### Estadísticas

|                              | EUR    | EUR      | EUR      | GBP      |
|------------------------------|--------|----------|----------|----------|
| Valor activo neto por acción |        |          |          |          |
| 30 de junio de 2021          | 145,25 | 1.525,45 | 1.445,69 | 1.553,79 |
| 31 de diciembre de 2020      | 147,09 | 1.522,43 | 1.464,80 | 1.546,92 |
| 31 de diciembre de 2019      | 146,41 | 1.490,73 | 1.459,29 | 1.508,25 |

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Total Return |                     |                           | Candriam Bonds<br>Total Return<br>Defensive* |
|------------------------------------------------------------|--------------------------------|---------------------|---------------------------|----------------------------------------------|
|                                                            | V<br>Capitalización            | Z<br>Capitalización | Z USD H<br>Capitalización | C**<br>Capitalización                        |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 0                              | 110.161             | 4.350                     | 1                                            |
| Número de acciones emitidas                                | 0                              | 2.845               | 0                         | 0                                            |
| Número de acciones recompradas                             | 0                              | (23.759)            | (1.350)                   | (1)                                          |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 0                              | 89.247              | 3.000                     | 0                                            |

### Estadísticas

|                              |          |          |          |            |
|------------------------------|----------|----------|----------|------------|
| Valor activo neto global     |          |          |          | EUR        |
| 30 de junio de 2021          |          |          |          | -          |
| 31 de diciembre de 2020      |          |          |          | 62.356.262 |
| 31 de diciembre de 2019      |          |          |          | 76.982.358 |
| Valor activo neto por acción | EUR      | EUR      | USD      | EUR        |
| 30 de junio de 2021          | -        | 1.564,74 | 1.706,85 | -          |
| 31 de diciembre de 2020      | -        | 1.558,62 | 1.693,32 | 148,74     |
| 31 de diciembre de 2019      | 1.492,40 | 1.520,51 | 1.631,05 | 147,73     |

\*Ver nota 1

\*\*Última valoración 29 de junio de 2021

## Candriam Bonds

Movimiento del número de acciones para el período cerrado al 30 de junio de 2021

|                                                            | Candriam Bonds<br>Total Return<br>Defensive* |                       |                       |
|------------------------------------------------------------|----------------------------------------------|-----------------------|-----------------------|
|                                                            | I**<br>Capitalización                        | R**<br>Capitalización | Z**<br>Capitalización |
| Número de acciones en circulación al principio del período | 19.647                                       | 1                     | 21.850                |
| Número de acciones emitidas                                | 0                                            | 0                     | 0                     |
| Número de acciones recompradas                             | (19.647)                                     | (1)                   | (21.850)              |
| Número de acciones en circulación al final del período     | 0                                            | 0                     | 0                     |

### Estadísticas

|                                                     | EUR      | EUR    | EUR      |
|-----------------------------------------------------|----------|--------|----------|
| Valor activo neto por acción<br>30 de junio de 2021 | -        | -      | -        |
| 31 de diciembre de 2020                             | 1.493,28 | 151,44 | 1.511,13 |
| 31 de diciembre de 2019                             | 1.486,56 | 149,87 | 1.498,79 |

\*Ver nota 1

\*\*Última valoración 15 de junio de 2021

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Capital Securities

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |           |        | <b>47.898.949</b>            | <b>96,75</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |           |        | <b>13.822.906</b>            | <b>27,92</b>     |
| <b>Francia</b>                                                                                                                  |           |        | <b>6.069.486</b>             | <b>12,26</b>     |
| BFCM 1.875 19-29 18/06A                                                                                                         | 800.000   | EUR    | 861.960                      | 1,74             |
| BNP PARIBAS 2.0000 21-31 24/05A                                                                                                 | 100.000   | GBP    | 117.551                      | 0,24             |
| BNP PARIBAS 4.625 21-99 31/12S                                                                                                  | 240.000   | USD    | 210.672                      | 0,43             |
| CREDIT AGRICOLE 2.70 15-25 14/04Q                                                                                               | 200.000   | EUR    | 216.443                      | 0,44             |
| CREDIT AGRICOLE 2.8110 21-41 11/01S                                                                                             | 397.000   | USD    | 317.881                      | 0,64             |
| CREDIT AGRICOLE ASSURANCE 2.00 20-30 17/07A                                                                                     | 400.000   | EUR    | 419.766                      | 0,85             |
| CREDIT AGRICOLE SA 2.0000 19-29 25/03A                                                                                          | 300.000   | EUR    | 324.086                      | 0,65             |
| CREDIT MUTUEL ARKEA 3.50 17-29 09/02A                                                                                           | 800.000   | EUR    | 957.212                      | 1,93             |
| GROUPAMA SA 2.125 19-29 16/09A                                                                                                  | 200.000   | EUR    | 210.314                      | 0,43             |
| GROUPAMA SA SUB 6.00 17-27 23/01A                                                                                               | 500.000   | EUR    | 629.912                      | 1,27             |
| MUTUELLE AS 21-49 31/12S                                                                                                        | 100.000   | EUR    | 100.744                      | 0,20             |
| MUTUELLE ASSURA 2.1250 21-52 21/06A                                                                                             | 200.000   | EUR    | 201.993                      | 0,41             |
| SOCIETE GENERALE 1.125 21-31 30/06A                                                                                             | 1.500.000 | EUR    | 1.500.952                    | 3,03             |
| <b>Reino Unido</b>                                                                                                              |           |        | <b>1.993.192</b>             | <b>4,03</b>      |
| AVIVA PLC 3.375 15-45 04/12A                                                                                                    | 400.000   | EUR    | 447.218                      | 0,90             |
| HSBC HOLDINGS PLC 4.00 21-99 31/12S                                                                                             | 312.000   | USD    | 268.311                      | 0,54             |
| LLOYDS BANKING 1.9850 21-31 15/12S                                                                                              | 291.000   | GBP    | 341.222                      | 0,69             |
| NATWEST GROUP P 2.1050 21-31 28/11S                                                                                             | 200.000   | GBP    | 234.362                      | 0,48             |
| STANDARD CHARTE 1.2000 21-31 23/09A                                                                                             | 700.000   | EUR    | 702.079                      | 1,42             |
| <b>Italia</b>                                                                                                                   |           |        | <b>1.815.727</b>             | <b>3,67</b>      |
| ASSICURAZIONI GENERALI 1.7130 21-32 30/06A                                                                                      | 384.000   | EUR    | 384.555                      | 0,78             |
| ASSICURAZIONI GENERALI 2.429 20-31 14/07A                                                                                       | 1.000.000 | EUR    | 1.079.095                    | 2,18             |
| ASSICURAZIONI GENERALI 4.125 14-26 04/05A                                                                                       | 300.000   | EUR    | 352.077                      | 0,71             |
| <b>España</b>                                                                                                                   |           |        | <b>1.453.476</b>             | <b>2,93</b>      |
| BANCO BILBAO VIZCAYA 3.50 17-27 10/02A                                                                                          | 400.000   | EUR    | 462.672                      | 0,93             |
| BANCO DE SABADELL SA 2.5 21-31 15/04A                                                                                           | 200.000   | EUR    | 201.652                      | 0,41             |
| BANCO SANTANDER SA 3.25 16-26 04/04A                                                                                            | 700.000   | EUR    | 789.152                      | 1,59             |
| <b>Países Bajos</b>                                                                                                             |           |        | <b>1.159.446</b>             | <b>2,34</b>      |
| COOPERATIEVE RA 3.1000 21-XX XX/XXS                                                                                             | 400.000   | EUR    | 405.372                      | 0,82             |
| ING GROEP N.V./ING BAN 5.75 19-XX XX/XXS                                                                                        | 700.000   | USD    | 653.988                      | 1,32             |
| ING GROEP NV 0.8750 21-32 09/06A                                                                                                | 100.000   | EUR    | 100.086                      | 0,20             |
| <b>Estados Unidos de América</b>                                                                                                |           |        | <b>301.045</b>               | <b>0,61</b>      |
| DEUTSCHE BANK AG NY 3.729 21-32 14/01S                                                                                          | 350.000   | USD    | 301.045                      | 0,61             |
| <b>Irlanda</b>                                                                                                                  |           |        | <b>250.941</b>               | <b>0,51</b>      |
| ZURICH FINANCE IRELAND 3.00 21-51 19/04A                                                                                        | 300.000   | USD    | 250.941                      | 0,51             |
| <b>Alemania</b>                                                                                                                 |           |        | <b>201.387</b>               | <b>0,41</b>      |
| DEUTSCHE BANK A 0.7500 21-27 17/02A                                                                                             | 200.000   | EUR    | 201.387                      | 0,41             |
| <b>Finlandia</b>                                                                                                                |           |        | <b>199.660</b>               | <b>0,40</b>      |
| NORDEA BANK AB 0.625 21-31 18/08A                                                                                               | 200.000   | EUR    | 199.660                      | 0,40             |
| <b>Austria</b>                                                                                                                  |           |        | <b>199.567</b>               | <b>0,40</b>      |
| RAIFFEISEN BANK 1.3750 21-33 17/06A                                                                                             | 200.000   | EUR    | 199.567                      | 0,40             |
| <b>Noruega</b>                                                                                                                  |           |        | <b>178.979</b>               | <b>0,36</b>      |
| DNB BANK ASA 4.875 19-XX 11/12A                                                                                                 | 200.000   | USD    | 178.979                      | 0,36             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Capital Securities

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                            | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|-----------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>    |           |        | <b>34.076.043</b>            | <b>68,83</b>     |
| <b>Francia</b>                          |           |        | <b>9.597.517</b>             | <b>19,39</b>     |
| AXA SA FL.R 14-XX 07/11A                | 800.000   | EUR    | 888.320                      | 1,79             |
| AXA SA FL.R 16-47 06/07A                | 900.000   | EUR    | 1.031.427                    | 2,08             |
| AXA SA FL.R 21-41 07/10A                | 200.000   | EUR    | 200.067                      | 0,40             |
| BNP PARIBAS FL.R 19-99 31/12S           | 500.000   | USD    | 462.840                      | 0,94             |
| BNP PARIBAS FL.R 20-32 15/01A           | 900.000   | EUR    | 908.739                      | 1,84             |
| BNP PARIBAS REGS SUB FL.R 17-XX 15/11S  | 300.000   | USD    | 271.734                      | 0,55             |
| CNP ASSURANCES FL.R 14-XX 18/11A        | 500.000   | EUR    | 556.395                      | 1,12             |
| CNP ASSURANCES FL.R 19-50 27/07A        | 500.000   | EUR    | 520.478                      | 1,05             |
| CREDIT AGRICOLE ASSUR FL.R 16-48 27/09A | 300.000   | EUR    | 366.861                      | 0,74             |
| CREDIT AGRICOLE SA FL.R 19-XX 23/03S    | 500.000   | USD    | 473.508                      | 0,96             |
| CREDIT AGRICOLE SA FL.R 20-30 05/06A    | 200.000   | EUR    | 207.937                      | 0,42             |
| EDF FL.R 18-99 04/10A                   | 400.000   | EUR    | 428.990                      | 0,87             |
| GROUPAMA SA FL.R 14-XX 28/05A           | 200.000   | EUR    | 231.164                      | 0,47             |
| LA BANQUE POSTALE FL.R 20-31 26/01A     | 600.000   | EUR    | 602.010                      | 1,22             |
| LA MONDIALE REGS SUB FL.R 14-XX 17/12A  | 600.000   | EUR    | 699.303                      | 1,41             |
| SCOR SUB FL.R 14-XX 01/10A              | 600.000   | EUR    | 684.522                      | 1,38             |
| SOCIETE GENERALE SA FL.R 21-99 31/12S   | 255.000   | USD    | 222.887                      | 0,45             |
| SOCIETE GENERAL REGS FL.R 13-XX 18/12S  | 200.000   | USD    | 188.915                      | 0,38             |
| SOGECAP SA FL.R 14-49 29/12A            | 400.000   | EUR    | 452.932                      | 0,92             |
| UNIBAIL RODAMCO FL.R 18-XX 25/10A       | 200.000   | EUR    | 198.488                      | 0,40             |
| <b>España</b>                           |           |        | <b>5.415.409</b>             | <b>10,94</b>     |
| BANCO BILBAO FL.R 20-XX XX/XXQ          | 400.000   | EUR    | 457.838                      | 0,93             |
| BANCO BILBAO VIZCAYA FL.R 18-XX 24/03Q  | 400.000   | EUR    | 432.818                      | 0,87             |
| BANCO BILBAO VIZCAYA FL.R 20-30 16/01A  | 500.000   | EUR    | 503.208                      | 1,02             |
| BANCO DE SABADELL SA FL.R 18-28 12/12A  | 300.000   | EUR    | 328.875                      | 0,67             |
| BANCO SANTANDER SA FL.R 19-24 02/08Q    | 400.000   | USD    | 372.495                      | 0,75             |
| BANCO SANTANDER SA FL.R 20-XX 14/01A    | 600.000   | EUR    | 620.901                      | 1,25             |
| BANCO SANT REGS SUB FL.R 14-XX 11/09Q   | 200.000   | EUR    | 202.388                      | 0,41             |
| BBVA S5 REGS FL.R 17-XX 24/08Q          | 400.000   | EUR    | 417.026                      | 0,84             |
| CAIXABANK SA FL.R 17-28 14/07A          | 1.000.000 | EUR    | 1.044.770                    | 2,11             |
| CAIXABANK SA FL.R 20-49 31/12Q          | 200.000   | EUR    | 229.402                      | 0,46             |
| CAIXABANK SA FL.R 21-31 18/06A          | 800.000   | EUR    | 805.688                      | 1,63             |
| <b>Reino Unido</b>                      |           |        | <b>5.100.711</b>             | <b>10,30</b>     |
| BARCLAYS PERP FL.R 18-XX XX/XXQ         | 200.000   | USD    | 185.787                      | 0,38             |
| BARCLAYS PLC FL.R 20-XX XX/XXQ          | 200.000   | USD    | 187.612                      | 0,38             |
| BARCLAYS PLC SUB FL.R 17-XX 15/03Q      | 600.000   | GBP    | 755.869                      | 1,53             |
| HSBC HLDGS FL.R 14-XX 16/09S            | 500.000   | EUR    | 524.077                      | 1,06             |
| HSBC HLDGS FL.R 14-XX 17/09S            | 400.000   | USD    | 373.379                      | 0,75             |
| HSBC HOLDING PLC FL.R 18-XX XX/XXS      | 500.000   | USD    | 484.316                      | 0,98             |
| LLOYDS BANK GR FL.R 14-XX 27/06Q        | 200.000   | USD    | 192.253                      | 0,39             |
| LLOYDS BANKING GR FL.R 14-XX 27/06Q     | 600.000   | EUR    | 663.285                      | 1,34             |
| LLOYDS BK GRP REGS FL.R 14-XX 27/06Q    | 300.000   | GBP    | 383.322                      | 0,77             |
| NATWEST GROUP PLC FL.R 20-XX XX/XXQ     | 256.000   | GBP    | 321.857                      | 0,65             |
| NATWEST GROUP PLC FL.R 21-99 31/12Q     | 349.000   | GBP    | 418.396                      | 0,84             |
| STANDARD CHARTERED 3.265 20-36 18/02S   | 200.000   | USD    | 169.386                      | 0,34             |
| SWISS RE FINANCE (UK) FL.R 20-52 04/06A | 400.000   | EUR    | 441.172                      | 0,89             |
| <b>Países Bajos</b>                     |           |        | <b>3.697.734</b>             | <b>7,47</b>      |
| ABN AMRO BANK FL.R 17-49 01/12S         | 400.000   | EUR    | 442.320                      | 0,89             |
| ARGENTUM NETHLD FL.R 15-XX 16/06A       | 500.000   | EUR    | 565.920                      | 1,14             |
| ARGENTUM NETHLD FL.R 16-46 01/10A       | 500.000   | EUR    | 570.585                      | 1,15             |
| COOPERATIEVE RABOBANK FL.R 20-XX XX-XXS | 800.000   | EUR    | 888.432                      | 1,80             |
| ING GROUP NV FL.R 19-30 13/11A          | 1.000.000 | EUR    | 1.014.150                    | 2,05             |
| VOLKSWAGEN INTER FIN FL.R 20-XX 17/06A  | 200.000   | EUR    | 216.327                      | 0,44             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Capital Securities

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                           | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Alemania</b>                                        |           |        | <b>2.923.632</b>             | <b>5,90</b>      |
| ALLIANZ SE FL.R 17-47 06/07A                           | 400.000   | EUR    | 455.026                      | 0,92             |
| ALLIANZ SE FL.R 20-49 31/12A                           | 200.000   | EUR    | 202.044                      | 0,41             |
| ALLIANZ SE FL.R 20-50 08/07A                           | 300.000   | EUR    | 322.014                      | 0,65             |
| ALLIANZ SE FL.R 20-XX XX/XXA                           | 200.000   | USD    | 174.687                      | 0,35             |
| COMMERZBANK AG FL.R 20-30 05/12A                       | 100.000   | EUR    | 111.006                      | 0,22             |
| COMMERZBANK AG FL.R 20-99 31/12A                       | 200.000   | EUR    | 220.928                      | 0,45             |
| COMMERZBANK AG FL.R 20-XX XX/XXA                       | 200.000   | EUR    | 235.766                      | 0,47             |
| DEUTSCHE BK FL.R 21-99 31/12A                          | 400.000   | EUR    | 416.510                      | 0,84             |
| MUNICH RE EMTN FL.R 18-49 26/05A                       | 500.000   | EUR    | 582.375                      | 1,18             |
| MUNICH RE FLR 20-41 26/05A                             | 200.000   | EUR    | 203.276                      | 0,41             |
| <b>Italia</b>                                          |           |        | <b>2.603.555</b>             | <b>5,26</b>      |
| ASSICURAZ GENERALI FL.R 15-47 27/10A                   | 300.000   | EUR    | 370.490                      | 0,75             |
| ENI S.P.A. FL.R 21-99 31/12A                           | 184.000   | EUR    | 184.151                      | 0,37             |
| INTESA SANPAOLO FL.R 20-49 31/12S                      | 900.000   | EUR    | 992.322                      | 2,01             |
| INTESA SANPAOLO SP FL.R 15-49 17/03S                   | 200.000   | USD    | 193.796                      | 0,39             |
| UNICREDIT SPA FL.R 17-49 03/12S                        | 800.000   | EUR    | 862.796                      | 1,74             |
| <b>Suiza</b>                                           |           |        | <b>2.448.876</b>             | <b>4,95</b>      |
| CREDIT SUISSE GROUP FL.R 17-XX 29/07S                  | 400.000   | USD    | 352.989                      | 0,71             |
| CS GROUP FL.R 19-XX XX/XXS                             | 1.000.000 | USD    | 937.841                      | 1,90             |
| UBS GROUP AG FL.R 15-XX 07/08S                         | 1.000.000 | USD    | 962.252                      | 1,94             |
| UBS GROUP AG FL.R 20-XX XX/XXA                         | 213.000   | USD    | 195.794                      | 0,40             |
| <b>Bélgica</b>                                         |           |        | <b>1.144.095</b>             | <b>2,31</b>      |
| BELFIUS BANK SA FL.R 18-XX XX/XXS                      | 200.000   | EUR    | 198.254                      | 0,40             |
| KBC GROUP NV FL.R 17-29 18/09A                         | 500.000   | EUR    | 520.447                      | 1,05             |
| KBC GROUP NV FL.R 18-XX XX/XXS                         | 400.000   | EUR    | 425.394                      | 0,86             |
| <b>Dinamarca</b>                                       |           |        | <b>426.393</b>               | <b>0,86</b>      |
| DANSKE BANK FL.R 21-99 31/12S                          | 500.000   | USD    | 426.393                      | 0,86             |
| <b>Finlandia</b>                                       |           |        | <b>262.461</b>               | <b>0,53</b>      |
| SAMPO PLC FL.R 20-52 03/09A                            | 247.000   | EUR    | 262.461                      | 0,53             |
| <b>Suecia</b>                                          |           |        | <b>186.145</b>               | <b>0,38</b>      |
| SHB 6.25 19-XX 01/03A                                  | 200.000   | USD    | 186.145                      | 0,38             |
| <b>Australia</b>                                       |           |        | <b>165.876</b>               | <b>0,33</b>      |
| WESTPAC BANKING CORP FL.R 20-35 15/11S                 | 200.000   | USD    | 165.876                      | 0,33             |
| <b>Austria</b>                                         |           |        | <b>103.639</b>               | <b>0,21</b>      |
| ERSTE GROUP BAN FL.R 20-31 08/09A                      | 100.000   | EUR    | 103.639                      | 0,21             |
| <b>Organismos de Inversión Colectiva</b>               |           |        | <b>296.582</b>               | <b>0,60</b>      |
| <b>Acciones/Participaciones en fondos de inversión</b> |           |        | <b>296.582</b>               | <b>0,60</b>      |
| <b>Francia</b>                                         |           |        | <b>296.582</b>               | <b>0,60</b>      |
| CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV Z EUR C                       | 200       | EUR    | 296.582                      | 0,60             |
| <b>Total de la cartera de valores</b>                  |           |        | <b>48.195.531</b>            | <b>97,35</b>     |
| Coste de adquisición                                   |           |        | 47.118.489                   |                  |

# Candriam Bonds

---

## Candriam Bonds Capital Securities

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

### Distribución geográfica (en % activo neto)

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| Francia                   | 32,25        |
| Reino Unido               | 14,33        |
| España                    | 13,87        |
| Países Bajos              | 9,81         |
| Italia                    | 8,93         |
| Alemania                  | 6,31         |
| Suiza                     | 4,95         |
| Bélgica                   | 2,31         |
| Finlandia                 | 0,93         |
| Dinamarca                 | 0,86         |
| Austria                   | 0,61         |
| Estados Unidos de América | 0,61         |
| Irlanda                   | 0,51         |
| Suecia                    | 0,38         |
| Noruega                   | 0,36         |
| Australia                 | 0,33         |
|                           | <b>97,35</b> |

### Distribución económica (en % activo neto)

|                                      |              |
|--------------------------------------|--------------|
| Bancos y otras entidades financieras | 66,29        |
| Seguros                              | 24,30        |
| Holdings y entidades financieras     | 4,52         |
| Energía y servicio de aguas          | 0,87         |
| Fondos de inversión                  | 0,60         |
| Sociedades inmobiliarias             | 0,40         |
| Petróleo                             | 0,37         |
|                                      | <b>97,35</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Convertible Defensive

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |            |        | <b>271.423.081</b>           | <b>90,28</b>     |
| <b>Obligaciones convertibles</b>                                                                                            |            |        | <b>271.423.081</b>           | <b>90,28</b>     |
| <b>Francia</b>                                                                                                              |            |        | <b>86.802.102</b>            | <b>28,87</b>     |
| ACCOR SA-DY 0.70 20-27 07/12S                                                                                               | 25.000     | EUR    | 1.305.458                    | 0,43             |
| CARREFOUR SA CV 0.00 18-24 27/03U                                                                                           | 10.000.000 | USD    | 8.769.373                    | 2,92             |
| EDENRED SA CV 0.00 19-24 06/09U                                                                                             | 65.329     | EUR    | 4.109.063                    | 1,37             |
| EDF SA CV 0.00 20-24 14/09U                                                                                                 | 259.296    | EUR    | 3.949.986                    | 1,31             |
| ELIS SA CV 0.00 17-23 06/10U                                                                                                | 70.000     | EUR    | 2.188.200                    | 0,73             |
| ENGIE SA CV 0.00 21-24 02/06U                                                                                               | 32.585     | EUR    | 2.695.790                    | 0,90             |
| KERING CV 0.00 19-22 30/09U                                                                                                 | 6.600.000  | EUR    | 7.614.618                    | 2,53             |
| KORIAN SA CV 0.875 20-27 06/03A                                                                                             | 20.768     | EUR    | 1.188.688                    | 0,40             |
| MICHELIN CV 0.00 17-22 10/01U                                                                                               | 7.000.000  | USD    | 6.343.031                    | 2,11             |
| NEXITY SA CV 0.25 18-25 02/03S                                                                                              | 20.000     | EUR    | 1.346.321                    | 0,45             |
| ORPEA SA CV 0.375 19-27 17/05A                                                                                              | 16.000     | EUR    | 2.381.692                    | 0,79             |
| SAFRAN SA CV 0.00 21-28 01/04U                                                                                              | 32.464     | EUR    | 5.938.542                    | 1,97             |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE CV 20-26 15/06A                                                                                       | 29.384     | EUR    | 5.763.863                    | 1,92             |
| TOTAL SA CV 0.50 15-22 02/12S                                                                                               | 8.000.000  | USD    | 6.861.084                    | 2,28             |
| UBISOFT ENTERTAIN CV 0.0 19-24 24/09U                                                                                       | 45.000     | EUR    | 5.128.043                    | 1,71             |
| VEOLIA ENV CV 0.00 19-25 01/01U                                                                                             | 151.295    | EUR    | 4.879.188                    | 1,62             |
| VINCI SA CV 0.375 17-22 16/02S                                                                                              | 6.000.000  | USD    | 5.722.236                    | 1,90             |
| WORLDLINE SA DIRTY CV 0.00 19-26 30/07U                                                                                     | 93.000     | EUR    | 10.616.926                   | 3,53             |
| <b>Estados Unidos de América</b>                                                                                            |            |        | <b>51.850.693</b>            | <b>17,25</b>     |
| AIRBNB INC CV 0.00 21-26 15/03U                                                                                             | 2.000.000  | USD    | 1.574.509                    | 0,52             |
| DOCUSIGN INC 0.00 21-24 15/01U                                                                                              | 3.500.000  | USD    | 3.059.187                    | 1,02             |
| EXPEDIA GROUP INC CV 0.0 21-26 15/02U                                                                                       | 2.000.000  | USD    | 1.833.089                    | 0,61             |
| FORD MOTOR CREDIT CO 0.00 21-26 15/03U                                                                                      | 1.000.000  | USD    | 939.219                      | 0,31             |
| FORTIVE CORP CV 0.875 19-22 15/02S                                                                                          | 10.000.000 | USD    | 8.452.399                    | 2,81             |
| ILLUMINA INC CV 0.00 18-23 15/08U                                                                                           | 2.000.000  | USD    | 2.150.004                    | 0,72             |
| JPMORGAN CHASE BANK 0.00 20-23 28/11U                                                                                       | 3.100.000  | USD    | 2.658.056                    | 0,88             |
| JPMORGAN CHASE BANK CV 0.00 21-24 18/02U                                                                                    | 2.100.000  | EUR    | 2.306.367                    | 0,77             |
| JPMORGAN CHASE BK CV 0.125 20-23 01/01S                                                                                     | 1.000.000  | USD    | 943.402                      | 0,31             |
| JPMORGAN CHASE FIN CV 0.25 18-23 01/05S                                                                                     | 2.000.000  | USD    | 1.828.350                    | 0,61             |
| MORGAN STANLEY FIN 0.00 18-21 17/12U                                                                                        | 8.000.000  | EUR    | 8.023.440                    | 2,67             |
| PRICELINE GROUP CV 0.90 15-21 15/09A                                                                                        | 7.000.000  | USD    | 6.434.168                    | 2,14             |
| SNAP INC CV 0.0 21-27 01/05U                                                                                                | 1.000.000  | USD    | 903.811                      | 0,30             |
| SPLUNK INC 1.125 20-27 15/06S                                                                                               | 2.000.000  | USD    | 1.643.292                    | 0,55             |
| TWITTER INC CV 0.00 21-26 15/03U                                                                                            | 2.500.000  | USD    | 2.013.365                    | 0,67             |
| TWITTER INC CV 1.00 14-21 15/09S                                                                                            | 3.000.000  | USD    | 2.580.256                    | 0,86             |
| WESTERN DIGITAL CORP CV 1.5 18-24 01/02S                                                                                    | 5.000.000  | USD    | 4.507.779                    | 1,50             |
| <b>Países Bajos</b>                                                                                                         |            |        | <b>28.729.439</b>            | <b>9,56</b>      |
| AMERICA MOVIL 21-24 02/03U                                                                                                  | 6.000.000  | EUR    | 6.178.320                    | 2,06             |
| BRENNTAG FINANCE CV 1.875 15-22 02/12S                                                                                      | 8.500.000  | USD    | 8.481.974                    | 2,82             |
| IBERDROLA INTL CV 0.00 15-22 11/11A                                                                                         | 1.000.000  | EUR    | 1.231.275                    | 0,41             |
| QIAGEN NV CV 0.00 20-27 17/12U                                                                                              | 5.000.000  | USD    | 4.090.058                    | 1,36             |
| STMICROELECTRON CV 0.0000 20-25 04/08A                                                                                      | 5.400.000  | USD    | 5.494.667                    | 1,83             |
| STMICROELECTRONIC CV 0.0001 17-27 04/08S                                                                                    | 3.200.000  | USD    | 3.253.145                    | 1,08             |
| <b>Alemania</b>                                                                                                             |            |        | <b>26.885.577</b>            | <b>8,94</b>      |
| BASF CV 0.925 17-23 09/03S                                                                                                  | 6.000.000  | USD    | 5.075.360                    | 1,69             |
| DEUTSCHE POST AG CV 0.05 17-25 30/06A                                                                                       | 7.000.000  | EUR    | 8.550.920                    | 2,84             |
| FRESENIUS SE REGS CV 0.00 17-24 31/01U                                                                                      | 6.000.000  | EUR    | 5.971.440                    | 1,99             |
| LEG IMMOBILIEN AG CV 0.40 20-28 30/06S                                                                                      | 1.800.000  | EUR    | 1.878.867                    | 0,62             |
| RAG-STIFTUNG CV 0.00 18-24 02/10U                                                                                           | 4.000.000  | EUR    | 4.083.840                    | 1,36             |
| ZALANDO SE CV 0.05 20-25 06/08A                                                                                             | 1.000.000  | EUR    | 1.325.150                    | 0,44             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Convertible Defensive

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad    | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|-------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Italia</b>                            |             |        | <b>20.350.559</b>            | <b>6,77</b>      |
| DIASORIN SPA CV 0.00 21-28 05/05U        | 2.100.000   | EUR    | 2.161.960                    | 0,72             |
| NEXI SPA CV 1.75 20-27 24/04S            | 1.000.000   | EUR    | 1.234.425                    | 0,41             |
| PIRELLI & C SPA CV 0.00 20-25 22/12U     | 2.800.000   | EUR    | 2.890.804                    | 0,96             |
| PRYSMIAN SPA CV 0.0 21-26 02/02U         | 4.000.000   | EUR    | 4.042.920                    | 1,35             |
| SNAM CV 0.00 17-22 20/03U                | 6.800.000   | EUR    | 7.210.720                    | 2,40             |
| TELECOM ITALIA CV 1.125 15-22 26/03S     | 2.800.000   | EUR    | 2.809.730                    | 0,93             |
| <b>Luxemburgo</b>                        |             |        | <b>13.221.433</b>            | <b>4,40</b>      |
| CITIGROUP GLB MKTS 0.00 20-24 25/07U     | 30.000.000  | HKD    | 3.557.441                    | 1,18             |
| GRAND CITY PRO CV 0.25 16-22 02/03S      | 2.600.000   | EUR    | 2.687.412                    | 0,90             |
| OLVER CAPITAL SARL CV 0.0 20-23 29/10U   | 6.500.000   | EUR    | 6.976.580                    | 2,32             |
| <b>España</b>                            |             |        | <b>13.172.171</b>            | <b>4,38</b>      |
| AMADEUS IT GROUP SA CV 1.50 20-25 09/04S | 1.000.000   | EUR    | 1.353.895                    | 0,45             |
| CELLNEX TELECOM CV 0.75 20-31 20/11A     | 5.000.000   | EUR    | 4.923.425                    | 1,64             |
| CRITERIA CAIXAHOLDI CV 0.00 21-25 22/06U | 5.100.000   | EUR    | 5.264.118                    | 1,75             |
| INTL CONSOLIDATED CV 1.125 21-28 18/05S  | 1.700.000   | EUR    | 1.630.733                    | 0,54             |
| <b>Islas Caimán</b>                      |             |        | <b>10.268.663</b>            | <b>3,42</b>      |
| MEITUAN CV 0.00 21-27 27/04U             | 8.000.000   | USD    | 7.328.645                    | 2,44             |
| WEIBO CORP CV 1.25 17-22 15/11S          | 2.000.000   | USD    | 1.642.440                    | 0,55             |
| ZHONGSHENG GROUP CV 0.0 20-25 21/05U     | 8.000.000   | HKD    | 1.297.578                    | 0,43             |
| <b>Islas Vírgenes Británicas</b>         |             |        | <b>6.951.530</b>             | <b>2,31</b>      |
| ADM AG CV 0.00 20-23 26/08U              | 2.000.000   | USD    | 1.802.572                    | 0,60             |
| SHANGHAI PORT GRP BVI 0.00 17-22 09/08U  | 2.000.000   | USD    | 1.843.941                    | 0,61             |
| THE LINK REIT CV 1.6 19-24 03/04S        | 30.000.000  | HKD    | 3.305.017                    | 1,10             |
| <b>Japón</b>                             |             |        | <b>6.506.915</b>             | <b>2,16</b>      |
| MITSUBISHI CHEM CV 0.00 17-24 29/03U     | 400.000.000 | JPY    | 3.206.353                    | 1,07             |
| ROHM CO LTD 19-24 05/12U                 | 300.000.000 | JPY    | 2.475.296                    | 0,82             |
| SONY CORP CV 0.00 15-22 30/09U           | 50.000.000  | JPY    | 825.266                      | 0,27             |
| <b>Suiza</b>                             |             |        | <b>2.930.679</b>             | <b>0,98</b>      |
| SIKA CV 0.15 18-25 05/06A                | 2.000.000   | CHF    | 2.930.679                    | 0,98             |
| <b>Bélgica</b>                           |             |        | <b>1.478.590</b>             | <b>0,49</b>      |
| DENMARK CV 0.187 16-21 15/09A            | 10.000      | EUR    | 1.478.590                    | 0,49             |
| <b>Bermuda</b>                           |             |        | <b>929.821</b>               | <b>0,31</b>      |
| JAZZ INVST I CV 1.50 18-24 15/08S        | 1.000.000   | USD    | 929.821                      | 0,31             |
| <b>China</b>                             |             |        | <b>794.527</b>               | <b>0,26</b>      |
| HANSOH PHARMACEUTICA CV 0.0 21-26 22/01U | 1.000.000   | USD    | 794.527                      | 0,26             |
| <b>Canadá</b>                            |             |        | <b>550.382</b>               | <b>0,18</b>      |
| SHOPIFY INC CV 0.1250 20-25 01/11S       | 500.000     | USD    | 550.382                      | 0,18             |
| <b>Otros valores mobiliarios</b>         |             |        | <b>10.664.044</b>            | <b>3,54</b>      |
| <b>Obligaciones convertibles</b>         |             |        | <b>10.664.044</b>            | <b>3,54</b>      |
| <b>Italia</b>                            |             |        | <b>5.046.015</b>             | <b>1,67</b>      |
| ENI SPA CV 0.00 16-22 13/04U             | 3.000.000   | EUR    | 3.004.725                    | 1,00             |
| NEXI SPA CV 0.00 21-28 24/02U            | 2.000.000   | EUR    | 2.041.290                    | 0,67             |
| <b>Bélgica</b>                           |             |        | <b>4.026.740</b>             | <b>1,34</b>      |
| SAGERPARCV 0.0 21-26 01/04U              | 4.000.000   | EUR    | 4.026.740                    | 1,34             |
| <b>Estados Unidos de América</b>         |             |        | <b>1.591.289</b>             | <b>0,53</b>      |
| SPOTIFY USA IN 21-26 15/03U              | 2.000.000   | USD    | 1.591.289                    | 0,53             |

## Candriam Bonds

---

### Candriam Bonds Convertible Defensive

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                          | Cantidad | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------|----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Total de la cartera de valores</b> |          |        | <b>282.087.125</b>           | <b>93,82</b>     |
| Coste de adquisición                  |          |        | 274.450.086                  |                  |

# Candriam Bonds

---

## Candriam Bonds Convertible Defensive

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

### Distribución geográfica (en % activo neto)

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| Francia                   | 28,87        |
| Estados Unidos de América | 17,78        |
| Países Bajos              | 9,56         |
| Alemania                  | 8,94         |
| Italia                    | 8,45         |
| Luxemburgo                | 4,40         |
| España                    | 4,38         |
| Islas Caimán              | 3,42         |
| Islas Vírgenes Británicas | 2,31         |
| Japón                     | 2,16         |
| Bélgica                   | 1,83         |
| Suiza                     | 0,97         |
| Bermuda                   | 0,31         |
| China                     | 0,26         |
| Canadá                    | 0,18         |
|                           | <b>93,82</b> |

### Distribución económica (en % activo neto)

|                                         |              |
|-----------------------------------------|--------------|
| Holdings y entidades financieras        | 17,88        |
| Internet y servicios de Internet        | 11,16        |
| Electrónica y semiconductores           | 6,82         |
| Energía y servicio de aguas             | 6,23         |
| Telecomunicaciones                      | 5,97         |
| Comercio minorista y grandes almacenes  | 5,45         |
| Servicios varios                        | 4,06         |
| Farmacia y cosméticos                   | 3,69         |
| Química                                 | 3,62         |
| Sociedades inmobiliarias                | 3,56         |
| Petróleo                                | 3,28         |
| Bancos y otras entidades financieras    | 2,88         |
| Transporte                              | 2,84         |
| Industria aeronáutica y espacial        | 2,52         |
| Electrotecnia y electrónica             | 2,33         |
| Caucho y neumáticos                     | 2,11         |
| Construcción, material de construcción  | 1,90         |
| Artículos de oficina y ordenadores      | 1,50         |
| Biotechnología                          | 1,36         |
| Minas                                   | 1,36         |
| Servicios sociales y de sanidad pública | 0,79         |
| Industria automovilística               | 0,74         |
| Fondos de inversión                     | 0,60         |
| Textiles y vestido                      | 0,44         |
| Restaurantes, hoteles                   | 0,43         |
| Artes gráficas y editoriales            | 0,30         |
|                                         | <b>93,82</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Credit Alpha

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |            |        | <b>61.620.828</b>            | <b>60,42</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                         |            |        | <b>53.405.615</b>            | <b>52,37</b>     |
| <b>Alemania</b>                                                                                                             |            |        | <b>12.990.770</b>            | <b>12,74</b>     |
| CECONOMY AG 1.75 21-26 24/06A                                                                                               | 2.000.000  | EUR    | 1.988.240                    | 1,95             |
| GERMANY 3.25 11-21 04/07A                                                                                                   | 11.000.000 | EUR    | 11.002.530                   | 10,79            |
| <b>Países Bajos</b>                                                                                                         |            |        | <b>12.005.691</b>            | <b>11,77</b>     |
| ASHLAND SERVICES BV 2.00 20-28 30/01S                                                                                       | 3.000.000  | EUR    | 3.048.300                    | 2,99             |
| ENERGIZER GAMMA 3.5000 21-29 30/06S                                                                                         | 3.000.000  | EUR    | 2.994.120                    | 2,93             |
| REPSOL INTL FINANCE 2.5000 21-XX XX/XXA                                                                                     | 1.000.000  | EUR    | 1.007.495                    | 0,99             |
| STARFRUIT FINCO 6.5 18-26 01/10S                                                                                            | 4.728.000  | EUR    | 4.955.776                    | 4,86             |
| <b>Estados Unidos de América</b>                                                                                            |            |        | <b>11.931.794</b>            | <b>11,70</b>     |
| ALLIED UNI HLD LLC 3.625 21-28 01/06S                                                                                       | 2.000.000  | EUR    | 1.987.770                    | 1,95             |
| BERRY GLOBAL IN 1.5000 20-27 15/01S                                                                                         | 3.900.000  | EUR    | 3.977.399                    | 3,90             |
| KRAFT FOODS 6.50 12-40 09/02S                                                                                               | 2.000.000  | USD    | 2.347.875                    | 2,30             |
| NETFLIX INC 3.8750 19-29 15/11S                                                                                             | 3.000.000  | EUR    | 3.618.750                    | 3,55             |
| <b>Luxemburgo</b>                                                                                                           |            |        | <b>4.462.833</b>             | <b>4,38</b>      |
| BK LC LUX FINCO1 5.25 21-29 30/04S                                                                                          | 2.370.000  | EUR    | 2.429.961                    | 2,38             |
| FLAMINGO LUX II SCA 5.0 21-29 31/03S                                                                                        | 2.042.000  | EUR    | 2.032.872                    | 2,00             |
| <b>Italia</b>                                                                                                               |            |        | <b>3.104.699</b>             | <b>3,04</b>      |
| AUTOSTRADA 1.75 15-26 26/06A                                                                                                | 1.600.000  | EUR    | 1.658.285                    | 1,62             |
| AUTOSTRADA PER ITALIA 1.75 16-27 01/02A                                                                                     | 1.400.000  | EUR    | 1.446.414                    | 1,42             |
| <b>Suecia</b>                                                                                                               |            |        | <b>2.987.000</b>             | <b>2,93</b>      |
| VERISURE MIDHOL 5.2500 21-29 15/02S                                                                                         | 2.900.000  | EUR    | 2.987.000                    | 2,93             |
| <b>Reino Unido</b>                                                                                                          |            |        | <b>2.860.088</b>             | <b>2,80</b>      |
| TI AUTOMOTIVE F 3.7500 21-29 15/04S                                                                                         | 2.800.000  | EUR    | 2.860.088                    | 2,80             |
| <b>Antillas Neerlandesas</b>                                                                                                |            |        | <b>2.759.841</b>             | <b>2,71</b>      |
| TEVA PHARMA 1.875 15-27 31/03A                                                                                              | 3.000.000  | EUR    | 2.759.841                    | 2,71             |
| <b>Francia</b>                                                                                                              |            |        | <b>302.899</b>               | <b>0,30</b>      |
| ALTICE FRANCE SA 7.375 16-26 01/05S                                                                                         | 345.000    | USD    | 302.899                      | 0,30             |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>                                                                                        |            |        | <b>8.215.213</b>             | <b>8,05</b>      |
| <b>Países Bajos</b>                                                                                                         |            |        | <b>8.215.213</b>             | <b>8,05</b>      |
| REPSOL INTL FINANCE FL.R 20-XX 11/12A                                                                                       | 1.500.000  | EUR    | 1.653.805                    | 1,62             |
| TELEFONICA EUROPE BV FL.R 19-XX 24/09A                                                                                      | 4.600.000  | EUR    | 4.731.726                    | 4,64             |
| VOLKSWAGEN INTL FIN FL.R 15-XX 20/03A                                                                                       | 1.800.000  | EUR    | 1.829.682                    | 1,79             |
| <b>Otros valores mobiliarios</b>                                                                                            |            |        | <b>4.868.680</b>             | <b>4,77</b>      |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                         |            |        | <b>4.868.680</b>             | <b>4,77</b>      |
| <b>Estados Unidos de América</b>                                                                                            |            |        | <b>4.868.680</b>             | <b>4,77</b>      |
| VALEANT PHAR. 8.5 18-27 01/06S                                                                                              | 5.300.000  | USD    | 4.868.680                    | 4,77             |
| <b>Organismos de Inversión Colectiva</b>                                                                                    |            |        | <b>2.585.138</b>             | <b>2,54</b>      |
| <b>Acciones/Participaciones en fondos de inversión</b>                                                                      |            |        | <b>2.585.138</b>             | <b>2,54</b>      |
| <b>Francia</b>                                                                                                              |            |        | <b>2.585.138</b>             | <b>2,54</b>      |
| CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV V EUR C                                                                                            | 26         | EUR    | 2.585.138                    | 2,54             |

## Candriam Bonds

---

### Candriam Bonds Credit Alpha

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                          | Cantidad | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------|----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Total de la cartera de valores</b> |          |        | <b>69.074.646</b>            | <b>67,73</b>     |
| Coste de adquisición                  |          |        | 68.894.126                   |                  |

## Candriam Bonds

---

### Candriam Bonds Credit Alpha

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

**Distribución geográfica (en % activo neto)**

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| Países Bajos              | 19,83        |
| Estados Unidos de América | 16,47        |
| Alemania                  | 12,74        |
| Luxemburgo                | 4,38         |
| Italia                    | 3,04         |
| Suecia                    | 2,93         |
| Francia                   | 2,83         |
| Reino Unido               | 2,80         |
| Antillas Neerlandesas     | 2,71         |
|                           | <b>67,73</b> |

**Distribución económica (en % activo neto)**

|                                                                |              |
|----------------------------------------------------------------|--------------|
| Holdings y entidades financieras                               | 33,85        |
| Obligaciones del Estado, de las provincias y de los municipios | 10,79        |
| Telecomunicaciones                                             | 4,94         |
| Farmacia y cosméticos                                          | 4,77         |
| Internet y servicios de Internet                               | 3,55         |
| Transporte                                                     | 3,04         |
| Fondos de inversión                                            | 2,54         |
| Industrias agro-alimentarias                                   | 2,30         |
| Comercio minorista y grandes almacenes                         | 1,95         |
|                                                                | <b>67,73</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Credit Opportunities

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |            |        | <b>1.374.065.532</b>         | <b>87,41</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |            |        | <b>1.367.009.087</b>         | <b>86,96</b>     |
| <b>Estados Unidos de América</b>                                                                                                |            |        | <b>427.574.288</b>           | <b>27,20</b>     |
| ALBERTSONS COMPANIES 4.625 19-27 15/01S                                                                                         | 3.265.000  | USD    | 2.879.004                    | 0,18             |
| ALBERTSONS COS 7.5 19-26 05/02S                                                                                                 | 11.909.000 | USD    | 11.021.273                   | 0,70             |
| ARDAGH METAL PA 2.0000 21-28 01/09S                                                                                             | 8.500.000  | EUR    | 8.519.720                    | 0,54             |
| AVANTOR FUNDING INC 2.62520-25 01/11S                                                                                           | 16.844.000 | EUR    | 17.235.791                   | 1,10             |
| AVANTOR FUNDING INC 3.875 20-28 15/07S                                                                                          | 27.352.000 | EUR    | 28.821.185                   | 1,83             |
| AXALTA COATING 3.3750 20-29 15/02S                                                                                              | 8.477.000  | USD    | 6.987.324                    | 0,45             |
| BERRY GLOBAL IN 1.5000 20-27 15/01S                                                                                             | 5.852.000  | EUR    | 5.954.410                    | 0,38             |
| BERRY GLOBAL INC 1.00 20-25 15/01S                                                                                              | 16.119.000 | EUR    | 16.260.041                   | 1,03             |
| CATALENT PHARMA 2.375 20-28 01/03S                                                                                              | 37.436.000 | EUR    | 37.510.872                   | 2,39             |
| CCO HLDG LLC/CAPITAL 5.75 16-26 15/02S                                                                                          | 12.406.000 | USD    | 10.812.333                   | 0,69             |
| CCO HOLDINGS 144A 5.00 17-28 01/02S                                                                                             | 4.500.000  | USD    | 3.981.430                    | 0,25             |
| CHENIERE ENERGY PART 5.625 19-26 01/10S                                                                                         | 12.182.000 | USD    | 10.657.581                   | 0,68             |
| COLFAX CORP 3.25 17-25 15/05S                                                                                                   | 9.650.000  | EUR    | 9.723.533                    | 0,62             |
| CSC HOLDINGS LLC 4.5 21-31 15/11S                                                                                               | 12.071.000 | USD    | 10.241.265                   | 0,65             |
| HILL ROM 4.3750 19-27 15/09S                                                                                                    | 10.333.000 | USD    | 9.076.380                    | 0,58             |
| HOLOGIC INC 3.2500 20-29 15/02S                                                                                                 | 25.214.000 | USD    | 21.075.451                   | 1,34             |
| IQVIA INC 2.25 19-28 15/01A                                                                                                     | 22.885.000 | EUR    | 23.019.381                   | 1,46             |
| IQVIA INC 2.25 21-29 15/03S                                                                                                     | 7.814.000  | EUR    | 7.792.121                    | 0,50             |
| NETFLIX INC 3.625 17-27 05/02S                                                                                                  | 17.830.000 | EUR    | 20.501.576                   | 1,30             |
| PRIMO WATER COR 3.8750 20-28 31/10S                                                                                             | 10.126.000 | EUR    | 10.313.635                   | 0,66             |
| SERVICE CORPORATION 3.375 20-30 15/08U                                                                                          | 5.403.000  | USD    | 4.464.002                    | 0,28             |
| SILGAN HOLDING INC 3.25 17-25 15/03S                                                                                            | 59.500.000 | EUR    | 59.946.250                   | 3,81             |
| SIRIUS XM HOLDINGS 4.625 19-24 15/07S                                                                                           | 1.464.000  | USD    | 1.267.096                    | 0,08             |
| SIRIUS XM RADIO 144A 5.00 17-27 01/08S                                                                                          | 4.959.000  | USD    | 4.381.307                    | 0,28             |
| SPRINT CORP 7.875 14-23 15/09S                                                                                                  | 12.250.000 | USD    | 11.735.333                   | 0,75             |
| STANDARD INDUST 2.2500 19-26 21/11A                                                                                             | 18.660.000 | EUR    | 18.560.043                   | 1,18             |
| TELEFLEX INC 4.25 20-28 01/06S                                                                                                  | 9.636.000  | USD    | 8.471.376                    | 0,54             |
| UGI INTERNATIONAL 3.2500 18-25 01/11S                                                                                           | 20.452.000 | EUR    | 20.883.537                   | 1,33             |
| WMG ACQ. 3.625 18-26 09/10S                                                                                                     | 19.000.000 | EUR    | 19.473.974                   | 1,24             |
| WMG ACQUISITION 2.75 20-28 15/07S                                                                                               | 5.870.000  | EUR    | 6.007.064                    | 0,38             |
| <b>Francia</b>                                                                                                                  |            |        | <b>268.811.463</b>           | <b>17,10</b>     |
| CAB 3.3750 21-28 01/02S                                                                                                         | 24.218.000 | EUR    | 24.096.910                   | 1,53             |
| CROWN EURO HOLDINGS 0.75 19-23 15/02S                                                                                           | 9.800.000  | EUR    | 9.824.500                    | 0,63             |
| CROWN EURO HOLDINGS 2.625 16-24 30/09S                                                                                          | 9.594.000  | EUR    | 10.038.202                   | 0,64             |
| DERICHEBOURG 2.2500 21-28 15/07S                                                                                                | 10.062.000 | EUR    | 10.225.709                   | 0,65             |
| ELIS SA 1.0 19-25 03/04A                                                                                                        | 6.800.000  | EUR    | 6.758.316                    | 0,43             |
| ELIS SA 1.625 19-28 03/04A                                                                                                      | 6.700.000  | EUR    | 6.633.000                    | 0,42             |
| ELIS SA 1.875 18-23 15/02A                                                                                                      | 9.200.000  | EUR    | 9.370.126                    | 0,60             |
| FAURECIA 2.625 18-25 15/06S                                                                                                     | 17.864.000 | EUR    | 18.094.231                   | 1,15             |
| FONCIA MANAGEMENT 3.375 21-28 31/03S                                                                                            | 7.275.000  | EUR    | 7.231.161                    | 0,46             |
| ORANO EMTN 4.875 09-24 23/09A                                                                                                   | 26.700.000 | EUR    | 30.205.390                   | 1,92             |
| ORANO SA 2.75 20-28 08/03A                                                                                                      | 300.000    | EUR    | 313.200                      | 0,02             |
| ORANO SA 3.375 19-26 23/04A                                                                                                     | 11.300.000 | EUR    | 12.237.900                   | 0,78             |
| REXEL SA 2.125 21-28 15/06S                                                                                                     | 16.100.000 | EUR    | 16.439.871                   | 1,05             |
| REXEL SA 2.75 19-26 15/06S                                                                                                      | 34.789.000 | EUR    | 35.699.428                   | 2,27             |
| SPCM SA 2.6250 20-29 01/02S                                                                                                     | 25.000.000 | EUR    | 25.656.250                   | 1,63             |
| SPIE SA 2.625 19-26 18/06A                                                                                                      | 19.300.000 | EUR    | 19.973.879                   | 1,27             |
| SPIE SA 3.125 17-24 22/03A                                                                                                      | 18.800.000 | EUR    | 19.649.760                   | 1,25             |
| VERALLIA SA 1.6250 21-28 14/05A                                                                                                 | 6.300.000  | EUR    | 6.363.630                    | 0,40             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Credit Opportunities

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Alemania</b>                          |            |        | <b>168.543.860</b>           | <b>10,72</b>     |
| CECONOMY AG 1.75 21-26 24/06A            | 7.800.000  | EUR    | 7.754.136                    | 0,49             |
| NIDDA HEALTHCAR 3.50 17-24 30/09S        | 31.170.000 | EUR    | 31.084.532                   | 1,98             |
| PROGROUP AG 3.00 18-26 31/03S            | 44.400.000 | EUR    | 44.844.000                   | 2,85             |
| TECHEM VERWALTUNGSGES 2.00 20-25 15/07S  | 27.973.000 | EUR    | 27.684.878                   | 1,76             |
| VERTICAL MIDCO 4.3750 20-27 15/07S       | 31.400.000 | EUR    | 32.791.334                   | 2,09             |
| ZF FINANCE GMBH 2.0000 21-27 06/05A      | 9.500.000  | EUR    | 9.547.500                    | 0,61             |
| ZF FINANCE GMBH 3.0000 20-25 21/09A      | 14.000.000 | EUR    | 14.837.480                   | 0,94             |
| <b>Países Bajos</b>                      |            |        | <b>133.271.799</b>           | <b>8,48</b>      |
| AXALTA COATING 3.75 16-25 15/01S         | 16.471.000 | EUR    | 16.752.654                   | 1,07             |
| DARLING GLOBAL FIN 3.625 18-26 15/05S    | 57.662.000 | EUR    | 58.564.064                   | 3,73             |
| ENERGIZER GAMMA 3.5000 21-29 30/06S      | 8.795.000  | EUR    | 8.777.762                    | 0,56             |
| ENERGIZER GAMMA 4.6250 18-26 15/07S      | 31.241.000 | EUR    | 31.962.667                   | 2,03             |
| NOBEL BIDCO BV 3.125 21-28 15/06S        | 9.000.000  | EUR    | 9.021.015                    | 0,57             |
| Q PARK HOLDING BV 2.0 20-27 01/03S       | 8.614.000  | EUR    | 8.193.637                    | 0,52             |
| <b>Italia</b>                            |            |        | <b>77.250.551</b>            | <b>4,91</b>      |
| AUTOSTRADA 1.75 15-26 26/06A             | 5.028.000  | EUR    | 5.195.835                    | 0,33             |
| AUTOSTRADA ITALIA SPA 2.000 21-30 15/01A | 4.250.000  | EUR    | 4.388.125                    | 0,28             |
| AUTOSTRADA PER L'ITAL 2.65 20-28 08/03A  | 7.000.000  | EUR    | 7.283.500                    | 0,46             |
| INFRASTRUTTURE 1.7500 21-31 19/04A       | 2.727.000  | EUR    | 2.719.424                    | 0,17             |
| INFRASTRUTTURE 1.8750 20-26 08/07A       | 3.350.000  | EUR    | 3.499.631                    | 0,22             |
| NEXI SPA 1.6250 21-26 30/04S             | 11.466.000 | EUR    | 11.407.753                   | 0,73             |
| NEXI SPA 1.7500 19-24 31/10S             | 20.900.000 | EUR    | 21.313.569                   | 1,36             |
| NEXI SPA 2.1250 21-29 30/04S             | 11.616.000 | EUR    | 11.495.194                   | 0,73             |
| SOFIMA HOLDING S.P.A. 3.75 20-28 15/01S  | 9.900.000  | EUR    | 9.947.520                    | 0,63             |
| <b>Irlanda</b>                           |            |        | <b>72.170.509</b>            | <b>4,59</b>      |
| ARDAGH PACKAGING FIN 2.125 20-26 15/08S  | 6.709.000  | EUR    | 6.709.000                    | 0,43             |
| EIRCOM FINA 3.5000 19-26 15/05U          | 32.159.000 | EUR    | 32.913.193                   | 2,09             |
| EIRCOM FINANCE DESIGN 2.625 19-27 15/02A | 8.400.000  | EUR    | 8.347.701                    | 0,53             |
| JAMES HARDIE INTL 3.625 18-26 01/10S     | 23.666.000 | EUR    | 24.200.615                   | 1,54             |
| <b>España</b>                            |            |        | <b>51.989.754</b>            | <b>3,31</b>      |
| GRIFOLS SA 2.25 19-27 15/11S             | 6.300.000  | EUR    | 6.410.074                    | 0,41             |
| GRIFOLS SA 3.20 17-25 01/05S             | 45.200.000 | EUR    | 45.579.680                   | 2,90             |
| <b>Luxemburgo</b>                        |            |        | <b>46.735.954</b>            | <b>2,97</b>      |
| ARAMARK INTL FINANCE 3.125 17-25 01/04S  | 26.367.000 | EUR    | 26.659.674                   | 1,69             |
| ARENA LUXEMBOURG 1.875 20-28 01/02S      | 2.800.000  | EUR    | 2.644.600                    | 0,17             |
| TELENET INT FIN REGS 3.50 17-28 01/03S   | 16.800.000 | EUR    | 17.431.680                   | 1,11             |
| <b>México</b>                            |            |        | <b>42.727.726</b>            | <b>2,72</b>      |
| CEMEX SAB DE CV 2.75 17-24 05/12S        | 36.300.000 | EUR    | 36.757.380                   | 2,34             |
| CEMEX SAB DE CV 3.1250 19-26 19/03S      | 1.182.000  | EUR    | 1.214.718                    | 0,08             |
| CEMEX SAB DE CV 7.375 20-27 05/06S       | 5.000.000  | USD    | 4.755.628                    | 0,30             |
| <b>Polonia</b>                           |            |        | <b>22.261.207</b>            | <b>1,41</b>      |
| CANPACK SA 2.375 20-27 01/11S            | 21.798.000 | EUR    | 22.261.207                   | 1,41             |
| <b>Suecia</b>                            |            |        | <b>19.123.764</b>            | <b>1,22</b>      |
| VERISURE HOLDING AB 3.25 21-27 15/02S    | 10.838.000 | EUR    | 10.839.951                   | 0,69             |
| VERISURE HOLDING AB 3.875 20-26 15/07S   | 8.107.000  | EUR    | 8.283.813                    | 0,53             |
| <b>Reino Unido</b>                       |            |        | <b>16.160.240</b>            | <b>1,03</b>      |
| NOMAD FOODS BON 2.5000 21-28 24/06S      | 16.000.000 | EUR    | 16.160.240                   | 1,03             |
| <b>Noruega</b>                           |            |        | <b>13.626.306</b>            | <b>0,87</b>      |
| ADEVINTA ASA 2.625 20-25 25/11A          | 13.281.000 | EUR    | 13.626.306                   | 0,87             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Credit Opportunities

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                           | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Canadá</b>                                          |            |        | <b>6.761.666</b>             | <b>0,43</b>      |
| BAUSCH HEALTH CPANIES 9.00 17-25 15/12S                | 7.478.000  | USD    | 6.761.666                    | 0,43             |
| <b>Obligaciones convertibles</b>                       |            |        | <b>1.806.255</b>             | <b>0,12</b>      |
| <b>Italia</b>                                          |            |        | <b>1.806.255</b>             | <b>0,12</b>      |
| TELECOM ITALIA CV 1.125 15-22 26/03S                   | 1.800.000  | EUR    | 1.806.255                    | 0,12             |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>                   |            |        | <b>5.250.190</b>             | <b>0,33</b>      |
| <b>Países Bajos</b>                                    |            |        | <b>5.250.190</b>             | <b>0,33</b>      |
| GAS NAT FENOSA REGS FL.R 14-XX 30/11A                  | 5.000.000  | EUR    | 5.250.190                    | 0,33             |
| <b>Otros valores mobiliarios</b>                       |            |        | <b>47.538.643</b>            | <b>3,02</b>      |
| <b>Obligaciones</b>                                    |            |        | <b>47.538.643</b>            | <b>3,02</b>      |
| <b>Estados Unidos de América</b>                       |            |        | <b>47.538.643</b>            | <b>3,02</b>      |
| SIRIUS SATELLITE 4.00 21-28 15/07S                     | 14.000.000 | USD    | 12.192.833                   | 0,77             |
| VALEANT PHAR. 8.5 18-27 01/06S                         | 11.000.000 | USD    | 10.081.710                   | 0,64             |
| VALEANT PHARMA 9.25 18-26 01/04S                       | 27.545.000 | USD    | 25.264.100                   | 1,61             |
| <b>Organismos de Inversión Colectiva</b>               |            |        | <b>60.056.627</b>            | <b>3,82</b>      |
| <b>Acciones/Participaciones en fondos de inversión</b> |            |        | <b>60.056.627</b>            | <b>3,82</b>      |
| <b>Francia</b>                                         |            |        | <b>39.991.852</b>            | <b>2,54</b>      |
| CANDRIAM LONG SHORT CREDIT R EUR C                     | 350.000    | EUR    | 37.009.000                   | 2,35             |
| CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV V EUR C                       | 30         | EUR    | 2.982.852                    | 0,19             |
| <b>Luxemburgo</b>                                      |            |        | <b>20.064.775</b>            | <b>1,28</b>      |
| CANDRIAM BONDS CREDIT ALPHA Z EUR C                    | 3.334      | EUR    | 5.041.475                    | 0,32             |
| CANDRIAM BONDS FLOATING RATE NOTES V EUR C             | 10.000     | EUR    | 15.023.300                   | 0,96             |
| <b>Total de la cartera de valores</b>                  |            |        | <b>1.481.660.802</b>         | <b>94,25</b>     |
| Coste de adquisición                                   |            |        | 1.479.369.328                |                  |

# Candriam Bonds

---

## Candriam Bonds Credit Opportunities

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

### Distribución geográfica (en % activo neto)

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| Estados Unidos de América | 30,22        |
| Francia                   | 19,64        |
| Alemania                  | 10,72        |
| Países Bajos              | 8,81         |
| Italia                    | 5,03         |
| Irlanda                   | 4,59         |
| Luxemburgo                | 4,25         |
| España                    | 3,31         |
| México                    | 2,72         |
| Polonia                   | 1,41         |
| Suecia                    | 1,22         |
| Reino Unido               | 1,03         |
| Noruega                   | 0,87         |
| Canadá                    | 0,43         |
|                           | <b>94,25</b> |

### Distribución económica (en % activo neto)

|                                               |              |
|-----------------------------------------------|--------------|
| Holdings y entidades financieras              | 31,77        |
| Farmacia y cosméticos                         | 6,94         |
| Industria del embalaje                        | 6,45         |
| Telecomunicaciones                            | 5,88         |
| Servicios sociales y de sanidad pública       | 5,75         |
| Energía y servicio de aguas                   | 4,71         |
| Construcción, material de construcción        | 3,99         |
| Fondos de inversión                           | 3,82         |
| Electrotecnia y electrónica                   | 3,32         |
| Biotecnología                                 | 3,31         |
| Química                                       | 3,14         |
| Papel y madera                                | 2,85         |
| Instituciones clasificables / no clasificadas | 2,67         |
| Internet y servicios de Internet              | 2,17         |
| Bienes de consumo diversos                    | 1,62         |
| Textiles y vestido                            | 1,18         |
| Industria automovilística                     | 1,15         |
| Transporte                                    | 1,07         |
| Industrias agro-alimentarias                  | 0,70         |
| Servicios del medio ambiente & reciclado      | 0,65         |
| Construcción de máquinas y aparatos           | 0,62         |
| Comercio minorista y grandes almacenes        | 0,49         |
|                                               | <b>94,25</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad        | Divisa | Valor de mercado<br>(en USD) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |                 |        | <b>272.151.204</b>           | <b>84,87</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |                 |        | <b>270.533.151</b>           | <b>84,37</b>     |
| <b>Indonesia</b>                                                                                                                |                 |        | <b>41.419.472</b>            | <b>12,92</b>     |
| INDONESIA 6.125 12-28 15/05M                                                                                                    | 100.000.000.000 | IDR    | 6.901.136                    | 2,15             |
| INDONESIA 6.625 12-33 15/05S                                                                                                    | 71.000.000.000  | IDR    | 4.884.162                    | 1,52             |
| INDONESIA 7.00 19-30 15/09S                                                                                                     | 35.000.000.000  | IDR    | 2.497.117                    | 0,78             |
| INDONESIA 7.50 19-35 15/06S                                                                                                     | 20.000.000.000  | IDR    | 1.427.979                    | 0,45             |
| INDONESIA 7.5 16-32 15/08A                                                                                                      | 105.300.000.000 | IDR    | 7.656.143                    | 2,39             |
| INDONESIA 8.25 16-36 15/05S                                                                                                     | 54.050.000.000  | IDR    | 4.096.150                    | 1,28             |
| INDONESIA 8.25 18-29 27/09S                                                                                                     | 25.000.000.000  | IDR    | 1.923.629                    | 0,60             |
| INDONESIA 8.375 13-34 15/03S                                                                                                    | 126.235.000.000 | IDR    | 9.634.253                    | 3,00             |
| INDONESIA 9.00 13-29 15/03S                                                                                                     | 30.000.000.000  | IDR    | 2.398.903                    | 0,75             |
| <b>Sudáfrica</b>                                                                                                                |                 |        | <b>34.455.591</b>            | <b>10,75</b>     |
| SOUTH AFRICA 10.50 98-26 21/12S                                                                                                 | 37.377.589      | ZAR    | 2.974.598                    | 0,93             |
| SOUTH AFRICA 8.00 13-30 31/01S                                                                                                  | 200.000.000     | ZAR    | 13.280.744                   | 4,14             |
| SOUTH AFRICA 8.25 14-32 31/03S                                                                                                  | 46.795.215      | ZAR    | 2.990.942                    | 0,93             |
| SOUTH AFRICA 8.50 13-37 31/01S                                                                                                  | 54.000.000      | ZAR    | 3.251.731                    | 1,01             |
| SOUTH AFRICA 8.75 12-48 28/02S                                                                                                  | 129.553.265     | ZAR    | 7.677.456                    | 2,40             |
| SOUTH AFRICA 8.75 14-44 31/01S                                                                                                  | 70.000.000      | ZAR    | 4.152.971                    | 1,30             |
| SOUTH AFRICA 8.875 15-35 28/02S                                                                                                 | 2.000.000       | ZAR    | 127.149                      | 0,04             |
| <b>Colombia</b>                                                                                                                 |                 |        | <b>24.964.377</b>            | <b>7,79</b>      |
| COLOMBIA 10.00 08-24 24/07A                                                                                                     | 17.500.000.000  | COP    | 5.342.749                    | 1,67             |
| COLOMBIA 4.375 12-23 21/03A                                                                                                     | 3.149.000.000   | COP    | 845.705                      | 0,26             |
| COLOMBIA 5.75 20-27 03/11A                                                                                                      | 13.000.000.000  | COP    | 3.336.272                    | 1,04             |
| COLOMBIA 6.00 12-28 28/04A                                                                                                      | 12.000.000.000  | COP    | 3.090.626                    | 0,96             |
| COLOMBIA 7.0 16-32 30/06A                                                                                                       | 12.000.000.000  | COP    | 3.166.374                    | 0,99             |
| COLOMBIA 7.25 19-34 18/10A                                                                                                      | 16.800.000.000  | COP    | 4.408.987                    | 1,38             |
| COLOMBIA 7.50 11-26 26/08A                                                                                                      | 7.000.000.000   | COP    | 1.984.296                    | 0,62             |
| TITULOS DE TESORERIA 7.75 15-30 18/09A                                                                                          | 10.000.000.000  | COP    | 2.789.368                    | 0,87             |
| <b>Brasil</b>                                                                                                                   |                 |        | <b>24.408.252</b>            | <b>7,61</b>      |
| BRAZIL 0.00 -23 01/07U                                                                                                          | 45.000          | BRL    | 7.734.195                    | 2,41             |
| BRAZIL -22 01/07U                                                                                                               | 10.000          | BRL    | 1.868.052                    | 0,58             |
| BRAZIL -DY- 10.00 10-23 01/01S                                                                                                  | 59.500          | BRL    | 11.715.687                   | 3,65             |
| BRAZIL -DY- 10.00 14-25 01/01S                                                                                                  | 10.400          | BRL    | 2.083.595                    | 0,65             |
| BRAZIL -DY- 10.00 16-27 01/01S                                                                                                  | 5.000           | BRL    | 1.006.723                    | 0,32             |
| <b>Polonia</b>                                                                                                                  |                 |        | <b>19.185.250</b>            | <b>5,98</b>      |
| POLAND 2.25 16-22 25/04A                                                                                                        | 36.000.000      | PLN    | 9.635.258                    | 3,00             |
| POLAND 5.75 01-22 23/09A                                                                                                        | 34.000.000      | PLN    | 9.549.992                    | 2,98             |
| <b>Malasia</b>                                                                                                                  |                 |        | <b>18.723.503</b>            | <b>5,84</b>      |
| MALAYSIA 3.62 16-21 30/11S                                                                                                      | 15.000.000      | MYR    | 3.640.838                    | 1,14             |
| MALAYSIA 3.733 13-28 15/06S                                                                                                     | 31.000.000      | MYR    | 7.807.850                    | 2,43             |
| MALAYSIA 3.90 16-26 30/11S                                                                                                      | 11.000.000      | MYR    | 2.821.043                    | 0,88             |
| MALAYSIA 4.498 10-30 15/04S                                                                                                     | 10.000.000      | MYR    | 2.628.946                    | 0,82             |
| MALAYSIA 4.893 18-38 08/06S                                                                                                     | 7.000.000       | MYR    | 1.824.826                    | 0,57             |
| <b>México</b>                                                                                                                   |                 |        | <b>18.515.496</b>            | <b>5,77</b>      |
| MEXICAN BONOS 7.75 11-31 29/05S                                                                                                 | 110.200         | MXN    | 584.477                      | 0,18             |
| MEXICAN BONOS 7.75 13-34 23/11S                                                                                                 | 730.000         | MXN    | 3.868.722                    | 1,21             |
| MEXICAN BONOS DESARR FIX 10.00 05-24 05/12S                                                                                     | 150.000         | MXN    | 842.270                      | 0,26             |
| MEXICO 8.00 17-47 07/11S                                                                                                        | 2.223.000       | MXN    | 11.747.110                   | 3,66             |
| MEXICO 8.50 09-38 18/11S                                                                                                        | 266.000         | MXN    | 1.472.917                    | 0,46             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                               | Cantidad       | Divisa | Valor de mercado<br>(en USD) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------|----------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Tailandia</b>                           |                |        | <b>16.560.219</b>            | <b>5,16</b>      |
| THAILAND 0.95 20-25 17/06S                 | 170.000.000    | THB    | 5.362.876                    | 1,67             |
| THAILAND 2.125 16-26 17/12S                | 80.000.000     | THB    | 2.657.398                    | 0,83             |
| THAILAND 2.875 18-28 17/12S                | 80.000.000     | THB    | 2.764.243                    | 0,86             |
| THAILAND 3.65 10-31 20/06S                 | 61.000.000     | THB    | 2.232.723                    | 0,70             |
| THAILAND 3.85 10-25 12/12S                 | 100.000.000    | THB    | 3.542.979                    | 1,10             |
| <b>Rusia</b>                               |                |        | <b>15.142.077</b>            | <b>4,72</b>      |
| RUSSIA 7.00 13-23 16/08S                   | 25.000.000     | RUB    | 344.188                      | 0,11             |
| RUSSIA 7.05 13-28 19/01S                   | 180.000.000    | RUB    | 2.480.238                    | 0,77             |
| RUSSIA 7.4 19-24 17/07S                    | 232.000.000    | RUB    | 3.227.747                    | 1,01             |
| RUSSIA 7.60 12-22 20/07S                   | 25.000.000     | RUB    | 347.138                      | 0,11             |
| RUSSIA 7.65 19-30 10/04S                   | 210.000.000    | RUB    | 2.993.719                    | 0,93             |
| RUSSIA 7.70 17-33 23/03S                   | 250.000.000    | RUB    | 3.590.455                    | 1,12             |
| RUSSIA 8.50 16-31 17/09S                   | 143.000.000    | RUB    | 2.158.592                    | 0,67             |
| <b>Perú</b>                                |                |        | <b>10.388.129</b>            | <b>3,24</b>      |
| PERU 5.94 18-29 12/02S                     | 3.315.000      | PEN    | 947.682                      | 0,30             |
| PERU 6.15 17-32 12/08S                     | 21.500.000     | PEN    | 5.890.033                    | 1,84             |
| PERU 6.90 07-37 12/08S                     | 7.000.000      | PEN    | 1.938.325                    | 0,60             |
| PERU 6.95 08-31 12/08S                     | 5.500.000      | PEN    | 1.612.089                    | 0,50             |
| <b>Turquía</b>                             |                |        | <b>10.370.474</b>            | <b>3,23</b>      |
| TURKEY 10.50 17-27 11/08S                  | 92.500.000     | TRY    | 7.969.219                    | 2,48             |
| TURKEY 11.7 20-30 13/11S                   | 10.000.000     | TRY    | 885.808                      | 0,28             |
| TURKEY 12.4 18-28 21/03S                   | 16.000.000     | TRY    | 1.515.447                    | 0,47             |
| <b>Chile</b>                               |                |        | <b>6.705.934</b>             | <b>2,09</b>      |
| CHILE 4.50 15-26 01/03S                    | 2.500.000.000  | CLP    | 3.594.394                    | 1,12             |
| CHILE 4.70 18-30 01/09S                    | 750.000.000    | CLP    | 1.041.956                    | 0,32             |
| CHILE 5.00 15-35 01/03S                    | 1.500.000.000  | CLP    | 2.069.584                    | 0,65             |
| <b>Rumanía</b>                             |                |        | <b>6.644.755</b>             | <b>2,07</b>      |
| ROMANIA 4.98 18-29 12/02A                  | 2.000.000      | RON    | 539.867                      | 0,17             |
| ROMANIA 5.80 11-27 26/07A                  | 21.810.000     | RON    | 6.103.849                    | 1,90             |
| ROMANIA 6.75 12-22 07/02S                  | 1.000          | USD    | 1.039                        | 0,00             |
| <b>Reino Unido</b>                         |                |        | <b>5.019.645</b>             | <b>1,57</b>      |
| EUROPEAN BANK FOR RECONS 4.60 20-25 09/12A | 75.000.000.000 | IDR    | 5.019.645                    | 1,57             |
| <b>República Dominicana</b>                |                |        | <b>4.972.927</b>             | <b>1,55</b>      |
| DOMINICAN REPUBLIC 9.75 19-26 05/06S       | 250.000.000    | DOP    | 4.972.927                    | 1,55             |
| <b>República checa</b>                     |                |        | <b>4.733.745</b>             | <b>1,48</b>      |
| CZECH REPUBLIC 0.95 15-30 15/05A           | 32.000.000     | CZK    | 1.388.351                    | 0,43             |
| CZECH REPUBLIC 2.00 17-33 13/10A           | 50.000.000     | CZK    | 2.369.220                    | 0,74             |
| CZECH REPUBLIC 2.50 13-28 25/08A           | 20.000.000     | CZK    | 976.174                      | 0,31             |
| <b>Filipinas</b>                           |                |        | <b>2.913.411</b>             | <b>0,91</b>      |
| ASIAN DEVELOPMENT 6.15 20-30 25/02S        | 214.500.000    | INR    | 2.913.411                    | 0,91             |
| <b>Islas Caimán</b>                        |                |        | <b>2.820.163</b>             | <b>0,88</b>      |
| QNB FINANCE LTD 6.90 20-25 23/01A          | 40.100.000.000 | IDR    | 2.820.163                    | 0,88             |
| <b>Ucrania</b>                             |                |        | <b>1.618.257</b>             | <b>0,51</b>      |
| UKRAINE 11.6700 19-23 22/11                | 30.000.000     | UAH    | 1.092.764                    | 0,34             |
| UKRAINE 15.84 19-25 26/02S                 | 13.000.000     | UAH    | 525.493                      | 0,17             |
| <b>Hungría</b>                             |                |        | <b>971.474</b>               | <b>0,30</b>      |
| HUNGARY 3.00 19-30 21/08A                  | 275.000.000    | HUF    | 971.474                      | 0,30             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                           | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en USD) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>                   |            |        | <b>1.618.053</b>             | <b>0,50</b>      |
| <b>Argentina</b>                                       |            |        | <b>1.618.053</b>             | <b>0,50</b>      |
| ARGENTINA-DY- 2.50 16-21 22/07S                        | 30.000.000 | ARS    | 1.618.053                    | 0,50             |
| <b>Otros valores mobiliarios</b>                       |            |        | <b>5.603.953</b>             | <b>1,75</b>      |
| <b>Obligaciones</b>                                    |            |        | <b>5.603.953</b>             | <b>1,75</b>      |
| <b>Venezuela</b>                                       |            |        | <b>3.339.876</b>             | <b>1,04</b>      |
| CORPORACION ANDINA 8.50 18-28 08/03S                   | 64.000.000 | MXN    | 3.339.876                    | 1,04             |
| <b>Reino Unido</b>                                     |            |        | <b>1.978.476</b>             | <b>0,62</b>      |
| EUROPEAN BANK FOR RECONS 19-26 15/10U                  | 40.000.000 | TRY    | 1.978.476                    | 0,62             |
| <b>Perú</b>                                            |            |        | <b>285.601</b>               | <b>0,09</b>      |
| PERU 5.94 18-29 12/02S                                 | 1.000.000  | PEN    | 285.601                      | 0,09             |
| <b>Organismos de Inversión Colectiva</b>               |            |        | <b>16.604.941</b>            | <b>5,18</b>      |
| <b>Acciones/Participaciones en fondos de inversión</b> |            |        | <b>16.604.941</b>            | <b>5,18</b>      |
| <b>Irlanda</b>                                         |            |        | <b>16.600.800</b>            | <b>5,18</b>      |
| ISHARES CHINA CNY BOND UCITS ETF USD                   | 3.000.000  | USD    | 16.600.800                   | 5,18             |
| <b>Luxemburgo</b>                                      |            |        | <b>4.141</b>                 | <b>0,00</b>      |
| CANDRIAM MONEY MARKET USD Z USD C                      | 4          | USD    | 4.141                        | 0,00             |
| <b>Total de la cartera de valores</b>                  |            |        | <b>294.360.098</b>           | <b>91,80</b>     |
| Coste de adquisición                                   |            |        | 305.594.328                  |                  |

## Candriam Bonds

---

### Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

**Distribución geográfica (en % activo neto)**

|                      |              |
|----------------------|--------------|
| Indonesia            | 12,92        |
| Sudáfrica            | 10,75        |
| Colombia             | 7,79         |
| Brasil               | 7,61         |
| Polonia              | 5,98         |
| Malasia              | 5,84         |
| México               | 5,77         |
| Irlanda              | 5,18         |
| Tailandia            | 5,16         |
| Rusia                | 4,72         |
| Perú                 | 3,33         |
| Turquía              | 3,23         |
| Reino Unido          | 2,18         |
| Chile                | 2,09         |
| Rumanía              | 2,07         |
| República Dominicana | 1,55         |
| República checa      | 1,48         |
| Venezuela            | 1,04         |
| Filipinas            | 0,91         |
| Islas Caimán         | 0,88         |
| Ucrania              | 0,51         |
| Argentina            | 0,51         |
| Hungría              | 0,30         |
| Luxemburgo           | 0,00         |
|                      | <b>91,80</b> |

**Distribución económica (en % activo neto)**

|                                                                |              |
|----------------------------------------------------------------|--------------|
| Obligaciones del Estado, de las provincias y de los municipios | 80,68        |
| Fondos de inversión                                            | 5,18         |
| Organizaciones supranacionales                                 | 3,09         |
| Holdings y entidades financieras                               | 1,81         |
| Bancos y otras entidades financieras                           | 1,04         |
|                                                                | <b>91,80</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Emerging Markets

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad       | Divisa | Valor de mercado<br>(en USD) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |                |        | <b>1.092.808.489</b>         | <b>91,50</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |                |        | <b>1.036.171.275</b>         | <b>86,76</b>     |
| <b>Colombia</b>                                                                                                                 |                |        | <b>60.376.316</b>            | <b>5,06</b>      |
| COLOMBIA 3.0 20-30 30/01Q                                                                                                       | 7.000.000      | USD    | 6.869.940                    | 0,57             |
| COLOMBIA 3.125 20-31 15/04S                                                                                                     | 4.000.000      | USD    | 3.917.920                    | 0,33             |
| COLOMBIA 4.125 20-51 15/05S                                                                                                     | 5.000.000      | USD    | 4.745.950                    | 0,40             |
| COLOMBIA 5.2 19-49 15/05S                                                                                                       | 5.000.000      | USD    | 5.474.950                    | 0,46             |
| COLOMBIA 6.125 09-41 18/01S                                                                                                     | 7.000.000      | USD    | 8.309.910                    | 0,70             |
| COLOMBIA 7.0 16-32 30/06A                                                                                                       | 63.000.000.000 | COP    | 16.623.461                   | 1,39             |
| COLOMBIA 7.25 19-34 18/10A                                                                                                      | 55.000.000.000 | COP    | 14.434.185                   | 1,21             |
| <b>Egipto</b>                                                                                                                   |                |        | <b>49.872.795</b>            | <b>4,18</b>      |
| EGYPT 3.875 21-26 16/02                                                                                                         | 8.000.000      | USD    | 7.886.520                    | 0,66             |
| EGYPT 5.875 21-31 16/02S                                                                                                        | 10.400.000     | USD    | 10.106.044                   | 0,85             |
| EGYPT 7.053 19-32 15/01S                                                                                                        | 5.000.000      | USD    | 5.138.750                    | 0,43             |
| EGYPT 7.50 17-27 31/01S                                                                                                         | 5.000.000      | USD    | 5.629.250                    | 0,47             |
| EGYPT 7.5 21-60 16/02S                                                                                                          | 4.550.000      | USD    | 4.273.451                    | 0,36             |
| EGYPT 8.50 17-47 31/01S                                                                                                         | 7.000.000      | USD    | 7.314.440                    | 0,61             |
| EGYPT 8.7002 19-49 01/03S                                                                                                       | 9.000.000      | USD    | 9.524.340                    | 0,80             |
| <b>México</b>                                                                                                                   |                |        | <b>49.307.275</b>            | <b>4,13</b>      |
| CEMEX SAB DE CV 3.875 21-31 11/07S                                                                                              | 15.000.000     | USD    | 15.217.425                   | 1,28             |
| CEMEX SAB DE CV REGS 5.2 20-30 17/09S                                                                                           | 5.000.000      | USD    | 5.492.825                    | 0,46             |
| INDUSTRIAS PENOLES SA 4.75 20-50 06/08S                                                                                         | 11.000.000     | USD    | 11.923.285                   | 1,00             |
| MEXICO 3.75 21-71 19/04S                                                                                                        | 8.000.000      | USD    | 7.333.840                    | 0,61             |
| MEXICO 3.771 20-61 24/05S                                                                                                       | 10.000.000     | USD    | 9.339.900                    | 0,78             |
| <b>Omán</b>                                                                                                                     |                |        | <b>48.347.585</b>            | <b>4,05</b>      |
| OMAN 4.875 19-25 01/02S                                                                                                         | 10.000.000     | USD    | 10.500.600                   | 0,88             |
| OMAN 6.2500 21-31 25/01S                                                                                                        | 17.000.000     | USD    | 18.307.385                   | 1,53             |
| OMAN 7.00 21-51 25/01S                                                                                                          | 13.000.000     | USD    | 13.270.660                   | 1,11             |
| OMAN SOVEREIGN SUKUK 4.875 21-30 15/06S                                                                                         | 6.100.000      | USD    | 6.268.940                    | 0,53             |
| <b>Argentina</b>                                                                                                                |                |        | <b>47.565.879</b>            | <b>3,98</b>      |
| ARGENTINA 0.125 20-35 09/07S                                                                                                    | 20.000.000     | USD    | 6.365.800                    | 0,53             |
| ARGENTINA 1.00 20-29 09/07SS                                                                                                    | 1.772.597      | USD    | 675.510                      | 0,06             |
| ARGENTINA IN DEFAULT 8.75 98-03 04/02A                                                                                          | 720.000        | EUR    | 0                            | 0,00             |
| BUENOS AIRES 10.875 11-21 26/01S                                                                                                | 1.033.333      | USD    | 506.132                      | 0,04             |
| BUENOS AIRES 7.875 16-27 15/06S                                                                                                 | 59.700.000     | USD    | 26.856.642                   | 2,25             |
| BUENOS AIRES 9.95 15-21 09/06S                                                                                                  | 29.000.000     | USD    | 13.161.795                   | 1,10             |
| <b>Sudáfrica</b>                                                                                                                |                |        | <b>46.645.252</b>            | <b>3,91</b>      |
| SOUTH AFRICA 4.85 19-29 30/09S                                                                                                  | 10.000.000     | USD    | 10.638.750                   | 0,89             |
| SOUTH AFRICA 5.375 14-44 24/07S                                                                                                 | 4.000.000      | USD    | 4.026.620                    | 0,34             |
| SOUTH AFRICA 5.65 17-47 27/09S                                                                                                  | 4.000.000      | USD    | 4.090.320                    | 0,34             |
| SOUTH AFRICA 8.00 13-30 31/01S                                                                                                  | 420.000.000    | ZAR    | 27.889.562                   | 2,34             |
| <b>República Dominicana</b>                                                                                                     |                |        | <b>45.664.239</b>            | <b>3,82</b>      |
| DOMINICAN REPUBLIC 4.5 20-30 30/01S                                                                                             | 11.150.000     | USD    | 11.402.101                   | 0,95             |
| DOMINICAN REPUBLIC 4.875 20-32 23/09S                                                                                           | 9.150.000      | USD    | 9.486.583                    | 0,79             |
| DOMINICAN REPUBLIC 5.875 20-60 30/01S                                                                                           | 11.000.000     | USD    | 11.015.015                   | 0,92             |
| DOMINICAN REPUBLIC 6.85 15-45 27/01S                                                                                            | 7.000.000      | USD    | 7.944.790                    | 0,67             |
| DOMINICAN REPUBLIC 6.875 16-26 29/01S                                                                                           | 5.000.000      | USD    | 5.815.750                    | 0,49             |
| <b>Ghana</b>                                                                                                                    |                |        | <b>40.981.897</b>            | <b>3,43</b>      |
| GHANA 7.75 21-29 07/04S                                                                                                         | 12.850.000     | USD    | 13.166.881                   | 1,10             |
| GHANA 7.875 20-35 11/02S                                                                                                        | 10.000.000     | USD    | 9.884.000                    | 0,83             |
| GHANA 8.125 19-32 26/03S                                                                                                        | 2.000.000      | USD    | 2.034.840                    | 0,17             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Emerging Markets

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                          | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en USD) | % activo<br>neto |
|-------------------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| GHANA 8.625 21-34 07/04S                              | 4.550.000  | USD    | 4.706.201                    | 0,39             |
| GHANA 8.6270 18-49 16/06S                             | 6.000.000  | USD    | 5.794.650                    | 0,49             |
| GHANA REGS 8.125 14-26 18/01S                         | 5.000.000  | USD    | 5.395.325                    | 0,45             |
| <b>Bahrein</b>                                        |            |        | <b>32.605.874</b>            | <b>2,73</b>      |
| BAHRAIN 5.25 21-33 25/01S                             | 18.000.000 | USD    | 17.552.610                   | 1,47             |
| BAHRAIN 6.2500 21-51 25/01S                           | 10.850.000 | USD    | 10.343.088                   | 0,87             |
| KINGDOM OF BAHR 4.2500 21-28 25/01S                   | 4.700.000  | USD    | 4.710.176                    | 0,39             |
| <b>Arabia Saudita</b>                                 |            |        | <b>26.407.854</b>            | <b>2,21</b>      |
| SAUDI ARABIAN OIL 1.6250 20-25 24/11S                 | 2.900.000  | USD    | 2.928.884                    | 0,25             |
| SAUDI ARABIAN OIL 3.25 20-50 24/11S                   | 10.000.000 | USD    | 9.713.050                    | 0,81             |
| SAUDI ARABIAN OIL COMPANY 2.25 20-30 24/11S           | 14.000.000 | USD    | 13.765.920                   | 1,15             |
| <b>Emiratos Arabes Unidos</b>                         |            |        | <b>26.232.846</b>            | <b>2,20</b>      |
| EMIRATE OF SHARJAHDL 3.6250 21-33 10/03S              | 17.600.000 | USD    | 17.798.792                   | 1,49             |
| FINANCIAL DEPARTMENT GOVERNMENT 4.0000 20-50 28/07S   | 9.200.000  | USD    | 8.434.054                    | 0,71             |
| <b>Indonesia</b>                                      |            |        | <b>25.733.631</b>            | <b>2,15</b>      |
| INDONESIA 3.8500 20-30 15/10S                         | 4.000.000  | USD    | 4.460.620                    | 0,37             |
| PERTAMINA 6.00 12-42 03/05S                           | 5.000.000  | USD    | 6.139.275                    | 0,51             |
| PERTAMINA 6.45 14-44 30/05S                           | 5.000.000  | USD    | 6.527.050                    | 0,55             |
| PERUSAHAAN PENERBIT 2.55 21-31 09/06S                 | 4.400.000  | USD    | 4.411.726                    | 0,37             |
| PERUSAHAAN PENERBIT 3.80 20-50 23/06S                 | 4.000.000  | USD    | 4.194.960                    | 0,35             |
| <b>Azerbaiyán</b>                                     |            |        | <b>24.747.568</b>            | <b>2,07</b>      |
| SOUTHERN GAS CORRIDOR 6.875 16-26 24/03S              | 8.000.000  | USD    | 9.580.480                    | 0,80             |
| STATE OIL COMPANY OF THE AZERBAIJAN 6.95 15-30 18/03S | 12.000.000 | USD    | 15.167.088                   | 1,27             |
| <b>Kenia</b>                                          |            |        | <b>24.119.318</b>            | <b>2,02</b>      |
| KENYA 6.3 21-34 23/01S                                | 2.900.000  | USD    | 2.910.658                    | 0,24             |
| KENYA 6.875 14-24 24/06S                              | 5.000.000  | USD    | 5.511.350                    | 0,46             |
| KENYA 8.0 19-32 22/05S                                | 10.000.000 | USD    | 11.279.650                   | 0,95             |
| KENYA 8.25 18-48 28/02S                               | 4.000.000  | USD    | 4.417.660                    | 0,37             |
| <b>Rumanía</b>                                        |            |        | <b>24.044.797</b>            | <b>2,01</b>      |
| ROMANIA 3.0 20-31 14/02S                              | 7.000.000  | USD    | 7.267.155                    | 0,61             |
| ROMANIA 3.375 18-38 08/02A                            | 6.000.000  | EUR    | 7.820.678                    | 0,65             |
| ROMANIA 4.0000 20-51 14/02S                           | 5.000.000  | USD    | 5.272.375                    | 0,44             |
| ROMANIA 5.125 18-48 15/06S                            | 3.000.000  | USD    | 3.683.550                    | 0,31             |
| ROMANIA 6.75 12-22 07/02S                             | 1.000      | USD    | 1.039                        | 0,00             |
| <b>Ecuador</b>                                        |            |        | <b>23.078.704</b>            | <b>1,93</b>      |
| ECUADOR 0.00 20-30 31/07S                             | 4.899.800  | USD    | 2.727.694                    | 0,23             |
| ECUADOR 0.50 20-40 31/07S                             | 25.000.000 | USD    | 15.536.375                   | 1,30             |
| ECUADOR 0.5 20-35 31/07S                              | 7.000.000  | USD    | 4.814.635                    | 0,40             |
| <b>El Salvador</b>                                    |            |        | <b>22.872.415</b>            | <b>1,91</b>      |
| EL SALVADOR 6.375 14-27 18/01S                        | 14.000.000 | USD    | 12.748.470                   | 1,06             |
| EL SALVADOR REG S 7.625 11-41 01/02S                  | 6.000.000  | USD    | 5.349.270                    | 0,45             |
| EL SALVADOR REG-S 8.25 02-32 10/04S                   | 5.000.000  | USD    | 4.774.675                    | 0,40             |
| <b>Turquía</b>                                        |            |        | <b>21.756.315</b>            | <b>1,82</b>      |
| TURKEY 5.75 17-47 11/05S                              | 13.000.000 | USD    | 11.139.765                   | 0,93             |
| TURKEY 6.00 11-41 14/01S                              | 5.000.000  | USD    | 4.540.200                    | 0,38             |
| TURKEY 6.875 06-36 17/03S                             | 6.000.000  | USD    | 6.076.350                    | 0,51             |
| <b>Panamá</b>                                         |            |        | <b>21.594.485</b>            | <b>1,81</b>      |
| AEROPUERTO INTERNACIONAL 6.00 18-48 18/11S            | 16.766.138 | USD    | 18.184.805                   | 1,52             |
| PANAMA 4.50 20-56 01/04S                              | 3.000.000  | USD    | 3.409.680                    | 0,29             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Emerging Markets

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en USD) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Pakistán</b>                          |            |        | <b>20.946.880</b>            | <b>1,75</b>      |
| ISLAMIC REP OF 7.3750 21-31 08/04S       | 12.000.000 | USD    | 12.354.300                   | 1,03             |
| PAKISTAN GOVERNMENT I 8.875 21-51 08/04S | 6.000.000  | USD    | 6.374.730                    | 0,53             |
| PAKISTAN REGS 8.25 15-25 30/09S          | 2.000.000  | USD    | 2.217.850                    | 0,19             |
| <b>Nigeria</b>                           |            |        | <b>18.966.495</b>            | <b>1,59</b>      |
| NIGERIA 6.50 17-27 28/11S                | 5.000.000  | USD    | 5.314.425                    | 0,45             |
| NIGERIA 7.625 17-47 28/11S               | 5.000.000  | USD    | 5.013.350                    | 0,42             |
| NIGERIA 7.875 17-32 16/02S               | 8.000.000  | USD    | 8.638.720                    | 0,72             |
| <b>Bahamas</b>                           |            |        | <b>18.393.570</b>            | <b>1,54</b>      |
| BAHAMAS REGS 6.00 17-28 21/11S           | 18.000.000 | USD    | 18.393.570                   | 1,54             |
| <b>Ucrania</b>                           |            |        | <b>18.197.088</b>            | <b>1,52</b>      |
| STATE ROAD AGENCY OF U 6.25 21-28 24/06S | 18.200.000 | USD    | 18.197.088                   | 1,52             |
| <b>Costa Rica</b>                        |            |        | <b>15.684.250</b>            | <b>1,31</b>      |
| COSTA RICA 6.1250 19-31 19/02S           | 5.000.000  | USD    | 5.309.150                    | 0,44             |
| COSTA RICA 7.008 14-44 04/04S            | 10.000.000 | USD    | 10.375.100                   | 0,87             |
| <b>Micronesia</b>                        |            |        | <b>15.399.775</b>            | <b>1,29</b>      |
| KAZMUNAYGAS 5.75 17-47 19/04S            | 7.000.000  | USD    | 8.761.725                    | 0,73             |
| KAZMUNAYGAS 6.375 18-48 24/04S           | 5.000.000  | USD    | 6.638.050                    | 0,56             |
| <b>Países Bajos</b>                      |            |        | <b>13.611.975</b>            | <b>1,14</b>      |
| BRASKEM NETHERLANDS 4.5 19-30 31/01S     | 13.000.000 | USD    | 13.611.975                   | 1,14             |
| <b>Marruecos</b>                         |            |        | <b>13.536.302</b>            | <b>1,13</b>      |
| OCP 5.125 21-51 23/06S                   | 12.000.000 | USD    | 12.168.300                   | 1,02             |
| OFFICE CHERIFIE 3.7500 21-31 23/06S      | 1.350.000  | USD    | 1.368.002                    | 0,11             |
| <b>Perú</b>                              |            |        | <b>13.359.321</b>            | <b>1,12</b>      |
| PERU 1.862 20-32 01/12S                  | 2.000.000  | USD    | 1.865.840                    | 0,16             |
| PERU 2.78 20-60 01/12S                   | 5.000.000  | USD    | 4.465.725                    | 0,37             |
| PERU 8.75 03-33 21/11S                   | 4.470.000  | USD    | 7.027.756                    | 0,59             |
| <b>Filipinas</b>                         |            |        | <b>13.329.250</b>            | <b>1,12</b>      |
| PHILIPPINES 3.70 16-41 01/03S            | 5.000.000  | USD    | 5.407.000                    | 0,45             |
| PHILIPPINES 9.50 05-30 02/02S            | 5.000.000  | USD    | 7.922.250                    | 0,67             |
| <b>Luxemburgo</b>                        |            |        | <b>13.320.905</b>            | <b>1,12</b>      |
| REDE D OR FIN SARL 4.5 20-30 22/01S      | 13.000.000 | USD    | 13.320.905                   | 1,12             |
| <b>Brasil</b>                            |            |        | <b>13.320.098</b>            | <b>1,12</b>      |
| BRAZIL 12.25 00-30 06/03S                | 1.000.000  | USD    | 1.671.750                    | 0,14             |
| LIGHT SERVICOS DE EL 4.375 21-26 18/06S  | 11.550.000 | USD    | 11.648.348                   | 0,98             |
| <b>Costa de Marfil</b>                   |            |        | <b>13.137.887</b>            | <b>1,10</b>      |
| IVORY COAST 4.8750 20-32 30/01A          | 2.150.000  | EUR    | 2.554.287                    | 0,21             |
| IVORY COAST 6.125 17-33 15/06S           | 10.000.000 | USD    | 10.583.600                   | 0,89             |
| <b>Senegal</b>                           |            |        | <b>13.127.847</b>            | <b>1,10</b>      |
| SENEGAL 5.375 21-37 08/06A               | 4.100.000  | EUR    | 4.801.802                    | 0,40             |
| SENEGAL 6.25 17-33 23/05S                | 5.000.000  | USD    | 5.285.950                    | 0,44             |
| SENEGAL 6.75 18-48 13/03S                | 3.000.000  | USD    | 3.040.095                    | 0,26             |
| <b>Belarús</b>                           |            |        | <b>12.923.170</b>            | <b>1,08</b>      |
| BELARUS 6.875 17-23 28/02S               | 13.000.000 | USD    | 12.923.170                   | 1,08             |
| <b>Túnez</b>                             |            |        | <b>12.107.181</b>            | <b>1,01</b>      |
| CENTRAL BANK TUNISIA 5.625 17-24 17/02A  | 5.000.000  | EUR    | 5.552.591                    | 0,46             |
| CENTRAL BANK TUNISIA 5.75 15-25 30/01S   | 7.000.000  | USD    | 6.554.590                    | 0,55             |
| <b>Irak</b>                              |            |        | <b>10.249.500</b>            | <b>0,86</b>      |
| IRAQ 6.75 17-23 03/09S                   | 10.000.000 | USD    | 10.249.500                   | 0,86             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Emerging Markets

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                           | Cantidad    | Divisa | Valor de mercado<br>(en USD) | % activo<br>neto |
|----------------------------------------|-------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Venezuela</b>                       |             |        | <b>9.693.600</b>             | <b>0,81</b>      |
| PETROLEOS VENEZUELA 6.00 13-26 15/11S  | 105.000.000 | USD    | 4.896.150                    | 0,41             |
| PETROLEOS VENEZUELA 6.00 14-24 16/05S  | 105.000.000 | USD    | 4.797.450                    | 0,40             |
| <b>Zambia</b>                          |             |        | <b>9.517.520</b>             | <b>0,80</b>      |
| ZAMBIA 5.375 12-22 20/09S              | 2.000.000   | USD    | 1.268.500                    | 0,11             |
| ZAMBIA 8.97 15-27 30/07S               | 13.000.000  | USD    | 8.249.020                    | 0,69             |
| <b>Mongolia</b>                        |             |        | <b>9.515.035</b>             | <b>0,80</b>      |
| MONGOLIA 3.5 21-27 07/07S              | 1.000.000   | USD    | 992.500                      | 0,08             |
| MONGOLIA 5.125 20-26 07/04S            | 5.000.000   | USD    | 5.347.350                    | 0,45             |
| MONGOLIA 5.625 17-23 01/05S            | 3.000.000   | USD    | 3.175.185                    | 0,27             |
| <b>Sri Lanka</b>                       |             |        | <b>8.716.594</b>             | <b>0,73</b>      |
| SRI LANKA 6.20 17-27 11/05S            | 2.922.000   | USD    | 1.839.691                    | 0,15             |
| SRI LANKA 6.75 18-28 18/04S            | 3.750.000   | USD    | 2.364.638                    | 0,20             |
| SRI LANKA 6.85 15-25 03/11S            | 2.000.000   | USD    | 1.352.130                    | 0,11             |
| SRI LANKA 7.5500 19-30 28/03S          | 2.054.000   | USD    | 1.309.805                    | 0,11             |
| SRI LANKA 7.8500 19-29 14/03S          | 2.900.000   | USD    | 1.850.330                    | 0,16             |
| <b>Paraguay</b>                        |             |        | <b>8.558.922</b>             | <b>0,72</b>      |
| PARAGUAY 5.40 19-50 30/03S             | 7.300.000   | USD    | 8.558.922                    | 0,72             |
| <b>Jamaica</b>                         |             |        | <b>8.405.880</b>             | <b>0,70</b>      |
| JAMAICA 7.875 15-45 28/07S             | 6.000.000   | USD    | 8.405.880                    | 0,70             |
| <b>Uruguay</b>                         |             |        | <b>7.766.130</b>             | <b>0,65</b>      |
| URUGUAY 4.975 18-55 20/04S             | 6.000.000   | USD    | 7.766.130                    | 0,65             |
| <b>Mozambique</b>                      |             |        | <b>7.651.395</b>             | <b>0,64</b>      |
| MOZAMBIQUE 5.0 19-31 15/09S            | 9.000.000   | USD    | 7.651.395                    | 0,64             |
| <b>Jordania</b>                        |             |        | <b>7.371.385</b>             | <b>0,62</b>      |
| JORDAN 7.375 17-47 10/10S              | 7.000.000   | USD    | 7.371.385                    | 0,62             |
| <b>Georgia</b>                         |             |        | <b>7.322.174</b>             | <b>0,61</b>      |
| GEORGIAN RAILWAY 4 21-28 17/06S        | 7.250.000   | USD    | 7.322.174                    | 0,61             |
| <b>Armenia</b>                         |             |        | <b>6.929.020</b>             | <b>0,58</b>      |
| ARMENIA 3.9500 19-29 26/09S            | 7.000.000   | USD    | 6.929.020                    | 0,58             |
| <b>Honduras</b>                        |             |        | <b>6.296.430</b>             | <b>0,53</b>      |
| HONDURAS 5.625 20-30 24/06S            | 6.000.000   | USD    | 6.296.430                    | 0,53             |
| <b>Chile</b>                           |             |        | <b>5.840.071</b>             | <b>0,49</b>      |
| CHILE 3.5 21-53 15/05S4                | 5.550.000   | USD    | 5.840.071                    | 0,49             |
| <b>Islas Caimán</b>                    |             |        | <b>5.586.032</b>             | <b>0,47</b>      |
| SA GLOBAL SUKUK 2.6940 21-31 17/06S    | 3.450.000   | USD    | 3.486.725                    | 0,29             |
| SA GLOBAL SUKUK LTD 1.602 21-26 17/06S | 2.100.000   | USD    | 2.099.307                    | 0,18             |
| <b>Kazajstán</b>                       |             |        | <b>4.453.760</b>             | <b>0,37</b>      |
| KAZTRANSYGAS JSC 4.375 17-27 26/09S    | 4.000.000   | USD    | 4.453.760                    | 0,37             |
| <b>Serbia</b>                          |             |        | <b>3.798.820</b>             | <b>0,32</b>      |
| SERBIA 2.125 20-30 01/12S              | 4.000.000   | USD    | 3.798.820                    | 0,32             |
| <b>Líbano</b>                          |             |        | <b>3.232.489</b>             | <b>0,27</b>      |
| LEBANON -DEFAULTED 6.85 17-27 23/03S   | 13.000.000  | USD    | 1.694.355                    | 0,14             |
| LIBAN REGS DEFAULT 6.65 16-24 22/04S   | 11.737.000  | USD    | 1.538.134                    | 0,13             |
| <b>Uzbekistán</b>                      |             |        | <b>2.993.625</b>             | <b>0,25</b>      |
| UZBEKISTAN 3.7000 20-30 25/11S         | 3.000.000   | USD    | 2.993.625                    | 0,25             |
| <b>Estados Unidos de América</b>       |             |        | <b>955.854</b>               | <b>0,08</b>      |
| BIOCEANICO SOVEREIGN 0.00 19-34 05/06U | 0           | USD    | 0                            | 0,00             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Emerging Markets

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                           | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en USD) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| BRAZIL LOAN 1 REGS 5.477 13-23 24/07S                  | 920.533    | USD    | 955.854                      | 0,08             |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>                   |            |        | <b>56.637.214</b>            | <b>4,74</b>      |
| <b>Ucrania</b>                                         |            |        | <b>17.832.075</b>            | <b>1,49</b>      |
| UKRAINE FL.R 15-40 31/05A                              | 15.000.000 | USD    | 17.832.075                   | 1,49             |
| <b>Costa de Marfil</b>                                 |            |        | <b>13.023.683</b>            | <b>1,09</b>      |
| IVORY COAST FL.R 10-32 31/12S                          | 12.956.955 | USD    | 13.023.683                   | 1,09             |
| <b>Congo</b>                                           |            |        | <b>8.762.652</b>             | <b>0,73</b>      |
| CONGO 6.00 07-29 30/06S                                | 11.438.000 | USD    | 8.762.652                    | 0,73             |
| <b>Irak</b>                                            |            |        | <b>6.797.175</b>             | <b>0,57</b>      |
| IRAQ FL.R 06-28 15/01S                                 | 7.000.000  | USD    | 6.797.175                    | 0,57             |
| <b>Argentina</b>                                       |            |        | <b>5.378.025</b>             | <b>0,45</b>      |
| ARGENTINA FL.R 20-21 09/07S                            | 15.000.000 | USD    | 5.378.025                    | 0,45             |
| <b>Belice</b>                                          |            |        | <b>4.843.604</b>             | <b>0,41</b>      |
| BELIZE FL.R 13-38 20/02S                               | 11.751.900 | USD    | 4.843.604                    | 0,41             |
| <b>Otros valores mobiliarios</b>                       |            |        | <b>1.773.000</b>             | <b>0,15</b>      |
| <b>Obligaciones</b>                                    |            |        | <b>1.773.000</b>             | <b>0,15</b>      |
| <b>Mongolia</b>                                        |            |        | <b>1.773.000</b>             | <b>0,15</b>      |
| MONGOLIA 4.45 21-31 07/07S                             | 1.800.000  | USD    | 1.773.000                    | 0,15             |
| <b>Organismos de Inversión Colectiva</b>               |            |        | <b>33.837.380</b>            | <b>2,83</b>      |
| <b>Acciones/Participaciones en fondos de inversión</b> |            |        | <b>33.837.380</b>            | <b>2,83</b>      |
| <b>Luxemburgo</b>                                      |            |        | <b>33.837.380</b>            | <b>2,83</b>      |
| CANDRIAM BONDS EMERGING MARKET CORPORATE Z USD C       | 9.400      | USD    | 15.152.612                   | 1,27             |
| CANDRIAM BONDS EMERGING MARKET TOTAL RETURN Z USD C    | 10.700     | USD    | 17.429.658                   | 1,46             |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EMERGING MARKETS I USD C          | 1.000      | USD    | 1.255.110                    | 0,10             |
| <b>Total de la cartera de valores</b>                  |            |        | <b>1.128.418.869</b>         | <b>94,48</b>     |
| Coste de adquisición                                   |            |        | 1.193.982.811                |                  |

## Candriam Bonds

---

### Candriam Bonds Emerging Markets

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

**Distribución geográfica (en % activo neto)**

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| Colombia                  | 5,06         |
| Argentina                 | 4,43         |
| Egipto                    | 4,18         |
| México                    | 4,13         |
| Omán                      | 4,05         |
| Luxemburgo                | 3,95         |
| Sudáfrica                 | 3,91         |
| República Dominicana      | 3,82         |
| Ghana                     | 3,43         |
| Ucrania                   | 3,02         |
| Bahrein                   | 2,73         |
| Arabia Saudita            | 2,21         |
| Emiratos Arabes Unidos    | 2,20         |
| Costa de Marfil           | 2,19         |
| Indonesia                 | 2,15         |
| Azerbaiyán                | 2,07         |
| Kenia                     | 2,02         |
| Rumanía                   | 2,01         |
| Ecuador                   | 1,93         |
| El Salvador               | 1,91         |
| Turquía                   | 1,82         |
| Panamá                    | 1,81         |
| Pakistán                  | 1,75         |
| Nigeria                   | 1,59         |
| Bahamas                   | 1,54         |
| Irak                      | 1,43         |
| Costa Rica                | 1,31         |
| Micronesia                | 1,29         |
| Países Bajos              | 1,14         |
| Marruecos                 | 1,13         |
| Perú                      | 1,12         |
| Filipinas                 | 1,12         |
| Brasil                    | 1,12         |
| Senegal                   | 1,10         |
| Belarús                   | 1,08         |
| Túnez                     | 1,01         |
| Mongolia                  | 0,94         |
| Venezuela                 | 0,81         |
| Zambia                    | 0,80         |
| Sri Lanka                 | 0,73         |
| Congo                     | 0,73         |
| Paraguay                  | 0,72         |
| Jamaica                   | 0,70         |
| Uruguay                   | 0,65         |
| Mozambique                | 0,64         |
| Jordania                  | 0,62         |
| Georgia                   | 0,61         |
| Armenia                   | 0,58         |
| Honduras                  | 0,53         |
| Chile                     | 0,49         |
| Islas Caimán              | 0,47         |
| Belice                    | 0,41         |
| Kazajstán                 | 0,37         |
| Serbia                    | 0,32         |
| Líbano                    | 0,27         |
| Uzbekistán                | 0,25         |
| Estados Unidos de América | 0,08         |
|                           | <b>94,48</b> |

## Candriam Bonds

---

### Candriam Bonds Emerging Markets

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

**Distribución económica (en % activo neto)**

|                                                                |              |
|----------------------------------------------------------------|--------------|
| Obligaciones del Estado, de las provincias y de los municipios | 67,41        |
| Petróleo                                                       | 8,29         |
| Holdings y entidades financieras                               | 3,25         |
| Fondos de inversión                                            | 2,83         |
| Química                                                        | 2,27         |
| Construcción, material de construcción                         | 1,73         |
| Industria aeronáutica y espacial                               | 1,52         |
| Varios bienes de capital                                       | 1,52         |
| Servicios sociales y de sanidad pública                        | 1,39         |
| Bancos y otras entidades financieras                           | 1,19         |
| Metales y piedras preciosas                                    | 1,00         |
| Energía y servicio de aguas                                    | 0,98         |
| Transporte                                                     | 0,61         |
| Instituciones inclasificables / no clasificadas                | 0,49         |
|                                                                | <b>94,48</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Emerging Markets Corporate

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en USD) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |           |        | <b>153.618.841</b>           | <b>97,14</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |           |        | <b>147.589.196</b>           | <b>93,33</b>     |
| <b>Islas Caimán</b>                                                                                                             |           |        | <b>16.146.855</b>            | <b>10,21</b>     |
| ALIBABA GROUP 2.7000 21-41 09/02S                                                                                               | 1.600.000 | USD    | 1.531.736                    | 0,97             |
| DIB SUKUK LTD 2.9500 20-26 16/01S                                                                                               | 1.500.000 | USD    | 1.567.560                    | 0,99             |
| HONGKONG LAND FINANCE 2.875 20-30 27/05S                                                                                        | 200.000   | USD    | 209.387                      | 0,13             |
| INDUSTRIAL SR TR REGS 5.50 12-22 01/11S                                                                                         | 1.200.000 | USD    | 1.252.218                    | 0,79             |
| LIMA METRO LINE REGS 4.35 19-36 05/04Q                                                                                          | 1.200.000 | USD    | 1.245.420                    | 0,79             |
| MAF SUKUK LTD 3.9325 19-30 28/02S                                                                                               | 1.400.000 | USD    | 1.516.802                    | 0,96             |
| MELCO RESORTS FIN 5.25 19-26 26/04S                                                                                             | 1.000.000 | USD    | 1.040.440                    | 0,66             |
| MELCO RESORTS FINANCE 5.375 19-29 04/12S                                                                                        | 2.000.000 | USD    | 2.111.770                    | 1,34             |
| QNB FINANCE LTD 3.5000 19-24 28/03S                                                                                             | 1.100.000 | USD    | 1.174.173                    | 0,74             |
| QNB FINANCE LTD 5.10 20-27 12/02S                                                                                               | 1.300.000 | USD    | 1.361.028                    | 0,86             |
| SUN HUNG KAI PROP 5.875 20-30 21/01S                                                                                            | 1.500.000 | USD    | 1.566.413                    | 0,99             |
| WYNN MACAU LTD 5.625 20-28 26/08S                                                                                               | 1.500.000 | USD    | 1.569.908                    | 0,99             |
| <b>Luxemburgo</b>                                                                                                               |           |        | <b>13.677.016</b>            | <b>8,65</b>      |
| ALTICE FINANCING SA 5.00 20-28 15/01S                                                                                           | 1.500.000 | USD    | 1.483.125                    | 0,94             |
| ALTICE FINANCING SA 7.50 16-26 15/05S                                                                                           | 1.500.000 | USD    | 1.565.625                    | 0,99             |
| CABLE ONDA SA 4.5 19-30 30/01S                                                                                                  | 1.000.000 | USD    | 1.054.695                    | 0,67             |
| KENBOURNE INVEST SA 6.875 19-2 26/11S                                                                                           | 1.600.000 | USD    | 1.702.504                    | 1,08             |
| MILLICOM INTL CEL 6.25 19-29 25/03S                                                                                             | 1.080.000 | USD    | 1.183.345                    | 0,75             |
| REDE D OR FIN SARL 4.5 20-30 22/01S                                                                                             | 1.750.000 | USD    | 1.793.199                    | 1,13             |
| RUMO LUX SARL 5.875 18-25 18/01S                                                                                                | 1.000.000 | USD    | 1.050.175                    | 0,66             |
| TUPY OVERSEAS S 4.5000 21-31 16/02S                                                                                             | 1.000.000 | USD    | 998.080                      | 0,63             |
| VM HOLDING SA 6.5 20-28 18/01S                                                                                                  | 1.800.000 | USD    | 2.029.626                    | 1,28             |
| VOTORANTIM CIMENTOS 7.25 11-41 05/04S                                                                                           | 600.000   | USD    | 816.642                      | 0,52             |
| <b>México</b>                                                                                                                   |           |        | <b>9.194.579</b>             | <b>5,81</b>      |
| ALFA SAB REGS 5.25 14-24 25/03S                                                                                                 | 1.000.000 | USD    | 1.092.100                    | 0,69             |
| ALPEK SAB CV 4.2500 19-29 18/09S                                                                                                | 750.000   | USD    | 815.636                      | 0,52             |
| CEMEX SAB DE CV REGS 5.2 20-30 17/09S                                                                                           | 1.000.000 | USD    | 1.098.565                    | 0,69             |
| CYDSA REGS 6.25 17-27 04/10S                                                                                                    | 1.750.000 | USD    | 1.848.814                    | 1,17             |
| GACM REGS 5.50 17-47 31/07S                                                                                                     | 1.000.000 | USD    | 1.012.975                    | 0,64             |
| GRUPO KUO SAB DE CV 5.75 17-27 07/07S                                                                                           | 1.500.000 | USD    | 1.572.233                    | 0,99             |
| INDUSTRIAS PENOLES SA 4.15 19-29 12/09S                                                                                         | 950.000   | USD    | 1.032.246                    | 0,65             |
| INDUSTRIAS PENOLES SA 5.65 19-49 12/09S                                                                                         | 600.000   | USD    | 722.010                      | 0,46             |
| <b>Islas Vírgenes Británicas</b>                                                                                                |           |        | <b>8.377.546</b>             | <b>5,30</b>      |
| ARCOS DOR HDGS REGS 5.875 17-27 04/04S                                                                                          | 1.000.000 | USD    | 1.056.975                    | 0,67             |
| FRANSHION BRILLIANT 4.25 19-29 23/07S                                                                                           | 1.600.000 | USD    | 1.596.400                    | 1,01             |
| GERDAU TRADE 4.875 17-27 24/10S                                                                                                 | 1.000.000 | USD    | 1.125.140                    | 0,71             |
| GOLD FIELDS ORO 6.1250 19-29 15/05S                                                                                             | 800.000   | USD    | 948.976                      | 0,60             |
| NAN FUNG TREASURY 3.625 20-30 27/08S                                                                                            | 2.000.000 | USD    | 2.043.210                    | 1,29             |
| PCCW-HKTC CAPITAL 3.625 15-25 02/04S                                                                                            | 1.500.000 | USD    | 1.606.845                    | 1,02             |
| <b>Estados Unidos de América</b>                                                                                                |           |        | <b>8.339.386</b>             | <b>5,27</b>      |
| BBVA BANCOMER REGS 6.75 12-22 30/09S                                                                                            | 1.500.000 | USD    | 1.594.485                    | 1,01             |
| NBM US HOLDINGS INC 6.625 19-29 06/08S                                                                                          | 1.500.000 | USD    | 1.685.940                    | 1,07             |
| SASOL 6.5 18-28 27/09S                                                                                                          | 2.400.000 | USD    | 2.708.304                    | 1,71             |
| STILLWATER MINING 7.125 17-25 27/06S                                                                                            | 1.500.000 | USD    | 1.558.470                    | 0,98             |
| TELECOMMUNICATIONS SV 8.875 19-29 18/10S                                                                                        | 750.000   | USD    | 792.187                      | 0,50             |
| <b>Países Bajos</b>                                                                                                             |           |        | <b>7.439.895</b>             | <b>4,71</b>      |
| BRASKEM NETHERLANDS 4.5 19-30 31/01S                                                                                            | 750.000   | USD    | 785.306                      | 0,50             |
| BRASKEM NETHERLANDS 5.875 19-50 31/01S                                                                                          | 1.000.000 | USD    | 1.100.035                    | 0,70             |
| EQUATE PETROCHEMICAL 4.25 16-26 03/11S                                                                                          | 1.500.000 | USD    | 1.669.057                    | 1,05             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Emerging Markets Corporate

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en USD) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| METINVEST BV 7.75 19-29 17/10S           | 600.000   | USD    | 668.841                      | 0,42             |
| VEON HOLDINGS BV 3.375 20-27 25/11S      | 1.500.000 | USD    | 1.511.648                    | 0,96             |
| VTR FINANCE BV 6.3750 20-28 15/07S       | 1.600.000 | USD    | 1.705.008                    | 1,08             |
| <b>Turquía</b>                           |           |        | <b>6.206.797</b>             | <b>3,93</b>      |
| TURKCELL ILETISIM 5.75 15-25 15/10S      | 1.600.000 | USD    | 1.721.256                    | 1,09             |
| TURK GARANTI BK REGS 5.25 12-22 13/09S   | 800.000   | USD    | 826.616                      | 0,52             |
| TURKIYE SISE VE CAM6.95 19-26 14/03S     | 1.100.000 | USD    | 1.225.010                    | 0,78             |
| TURK TELEKOM 6.875 19-25 28/02S          | 2.200.000 | USD    | 2.433.915                    | 1,54             |
| <b>Bermuda</b>                           |           |        | <b>6.165.100</b>             | <b>3,90</b>      |
| GEOPARK LTD 5.5000 20-27 17/01S          | 1.500.000 | USD    | 1.525.012                    | 0,96             |
| INVESTMENT ENERG RES 6.25 21-29 26/04S   | 1.400.000 | USD    | 1.520.239                    | 0,96             |
| QTEL INTL FIN REGS 5.00 10-25 19/10S     | 1.750.000 | USD    | 2.016.254                    | 1,28             |
| STAR ENERGY GEOTHERMA 4.85 20-38 14/10S  | 1.000.000 | USD    | 1.103.595                    | 0,70             |
| <b>Hong Kong</b>                         |           |        | <b>5.789.242</b>             | <b>3,66</b>      |
| AIA GROUP LTD 3.125 13-23 13/0           | 2.000.000 | USD    | 2.076.160                    | 1,31             |
| BANGKOK BK PUB CO (HK)9.025 98-29 15/03S | 800.000   | USD    | 1.111.316                    | 0,70             |
| COUNTRY GARDEN 5.1250 20-27 14/01S       | 1.700.000 | USD    | 1.816.951                    | 1,15             |
| SWIRE PAC MTN HK 2.875 20-30 30/01S      | 750.000   | USD    | 784.815                      | 0,50             |
| <b>Colombia</b>                          |           |        | <b>5.715.410</b>             | <b>3,61</b>      |
| BANCO BOGOTA REGS 6.25 16-26 12/05S      | 1.200.000 | USD    | 1.318.914                    | 0,83             |
| COLOMBIA TELECOM 4.95 20-30 17/07S       | 750.000   | USD    | 779.880                      | 0,49             |
| ECOPETROL 5.875 14-45 28/05S             | 1.500.000 | USD    | 1.608.120                    | 1,02             |
| ECOPETROL SA 5.375 15-26 26/06S          | 1.000.000 | USD    | 1.103.640                    | 0,70             |
| ECOPETROL SA 6.8750 20-30 29/04S         | 750.000   | USD    | 904.856                      | 0,57             |
| <b>Emiratos Arabes Unidos</b>            |           |        | <b>5.033.920</b>             | <b>3,18</b>      |
| ACWA REGS 5.95 17-39 15/12S              | 749.198   | USD    | 898.100                      | 0,56             |
| EMIRATES TELECOM CORP 3.50 14-24 18/06S  | 700.000   | USD    | 756.795                      | 0,48             |
| KUWAIT PROJECTS 4.2290 19-26 29/10S      | 300.000   | USD    | 298.125                      | 0,19             |
| KUWAIT PROJECTS REGS 4.50 17-27 23/02S   | 1.700.000 | USD    | 1.690.538                    | 1,07             |
| OZTEL HOLDINGS 6.625 18-28 24/04S        | 1.250.000 | USD    | 1.390.362                    | 0,88             |
| <b>India</b>                             |           |        | <b>4.810.927</b>             | <b>3,04</b>      |
| BHARTI AIRTEL REGS 4.375 15-25 10/06S    | 1.200.000 | USD    | 1.310.784                    | 0,83             |
| GMR HYDERABAD INTL 5.375 19-24 10/04S    | 800.000   | USD    | 830.472                      | 0,52             |
| OIL AND NATURAL G 3.375 19-29 05/12S     | 900.000   | USD    | 921.735                      | 0,58             |
| RELIANCE INDUSTRIES 3.667 17-27 30/11S   | 1.600.000 | USD    | 1.747.936                    | 1,11             |
| <b>Chile</b>                             |           |        | <b>4.682.398</b>             | <b>2,96</b>      |
| CENCOSUD SA 6.625 15-45 12/02S           | 800.000   | USD    | 1.024.316                    | 0,65             |
| INVERSIONES CMP 3.8500 20-30 13/01S      | 500.000   | USD    | 534.072                      | 0,34             |
| INVERSIONES CMPC 4.75 14-24 15/09S       | 1.000.000 | USD    | 1.089.810                    | 0,69             |
| INVERSIONES LATIN AME 5.125 21-33 15/06S | 1.200.000 | USD    | 1.191.882                    | 0,75             |
| SOCIEDAD QUIMIC 4.2500 19-29 07/05S      | 750.000   | USD    | 842.318                      | 0,53             |
| <b>Indonesia</b>                         |           |        | <b>4.514.171</b>             | <b>2,85</b>      |
| PERTAMINA 3.1 20-30 21/01S               | 650.000   | USD    | 669.175                      | 0,42             |
| PERUSAHAAN GAS REG S 5.125 14-24 16/05S  | 1.400.000 | USD    | 1.554.210                    | 0,98             |
| STAR ENERGY 6.75 18-24 24/04S            | 798.030   | USD    | 915.763                      | 0,58             |
| TOWER BERSAMA I 4.2500 20-25 21/01S      | 1.300.000 | USD    | 1.375.023                    | 0,87             |
| <b>Singapur</b>                          |           |        | <b>3.729.794</b>             | <b>2,36</b>      |
| ABJA INVESTMENT CO 5.45 18-28 24/01S     | 2.100.000 | USD    | 2.263.064                    | 1,43             |
| SINGAPORE TELECOMMUN 7.375 01-31 01/1    | 1.000.000 | USD    | 1.466.730                    | 0,93             |
| <b>Canadá</b>                            |           |        | <b>3.091.505</b>             | <b>1,96</b>      |
| FIRST QUANTUM MINERAL 6.875 20-27 15/10S | 2.200.000 | USD    | 2.397.725                    | 1,52             |
| ST MARYS CEMENT INC 5.75 16-27 28/01S    | 600.000   | USD    | 693.780                      | 0,44             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Emerging Markets Corporate

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                 | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en USD) | % activo<br>neto |
|----------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Arabia Saudita</b>                        |           |        | <b>2.980.358</b>             | <b>1,88</b>      |
| SAUDI ARABIAN OIL 1.6250 20-25 24/11S        | 350.000   | USD    | 353.486                      | 0,22             |
| SAUDI ARABIAN OIL COMPANY 3.50 19-29 16/04S  | 2.000.000 | USD    | 2.166.690                    | 1,37             |
| SAUDI ARABIAN OIL COMPANY 4.375 19-49 16/04S | 400.000   | USD    | 460.182                      | 0,29             |
| <b>Brasil</b>                                |           |        | <b>2.606.352</b>             | <b>1,65</b>      |
| GLOBO COMMUNIC REGS 4.843 15-25 08/06S       | 750.000   | USD    | 791.025                      | 0,50             |
| LIGHT SERVICOS DE EL 4.375 21-26 18/06S      | 1.800.000 | USD    | 1.815.327                    | 1,15             |
| <b>Perú</b>                                  |           |        | <b>2.214.415</b>             | <b>1,40</b>      |
| CAMPOSOL SA 6.0000 20-27 03/02S              | 1.300.000 | USD    | 1.357.935                    | 0,86             |
| MINSUR REGS 6.25 14-24 07/02A                | 800.000   | USD    | 856.480                      | 0,54             |
| <b>Egipto</b>                                |           |        | <b>2.107.270</b>             | <b>1,33</b>      |
| AFRICAN EXPORT-IMP 3.994 19-29 21/09S        | 2.000.000 | USD    | 2.107.270                    | 1,33             |
| <b>Irlanda</b>                               |           |        | <b>2.099.960</b>             | <b>1,33</b>      |
| C&W SR FINANCIN 7.5000 18-26 15/10S          | 2.000.000 | USD    | 2.099.960                    | 1,33             |
| <b>República Dominicana</b>                  |           |        | <b>1.783.912</b>             | <b>1,13</b>      |
| AERODOM REGS 6.75 17-29 30/03Q               | 1.700.000 | USD    | 1.783.912                    | 1,13             |
| <b>Malasia</b>                               |           |        | <b>1.724.078</b>             | <b>1,09</b>      |
| AXIATA SPV2 BHD 2.1630 20-30 19/08S          | 500.000   | USD    | 493.733                      | 0,31             |
| TELEKOM MALAYSIA 7.875 95-25 01/08S          | 1.000.000 | USD    | 1.230.345                    | 0,78             |
| <b>Kenia</b>                                 |           |        | <b>1.498.290</b>             | <b>0,95</b>      |
| EASTERN AND SOUTHERN 4.125 21-28 30/06S      | 1.500.000 | USD    | 1.498.290                    | 0,95             |
| <b>Paraguay</b>                              |           |        | <b>1.476.958</b>             | <b>0,93</b>      |
| TELEFONICA CELULAR 5.875 19-27 15/04S        | 1.400.000 | USD    | 1.476.958                    | 0,93             |
| <b>Corea del Sur</b>                         |           |        | <b>1.463.987</b>             | <b>0,93</b>      |
| WOORI BANK 4.75 14-24 30/04S                 | 1.333.000 | USD    | 1.463.987                    | 0,93             |
| <b>Georgia</b>                               |           |        | <b>1.413.937</b>             | <b>0,89</b>      |
| GEORGIAN RAILWAY 4 21-28 17/06S              | 1.400.000 | USD    | 1.413.937                    | 0,89             |
| <b>Israel</b>                                |           |        | <b>1.378.125</b>             | <b>0,87</b>      |
| LEVIATHAN BOND LTD 6.125 20-25 30/06S        | 1.250.000 | USD    | 1.378.125                    | 0,87             |
| <b>Tailandia</b>                             |           |        | <b>1.371.839</b>             | <b>0,87</b>      |
| THAI OIL TRES 4.625 18-28 20/11S             | 800.000   | USD    | 911.164                      | 0,58             |
| THAI OIL TSY CENTER 3.50 19-49 17/10S        | 500.000   | USD    | 460.675                      | 0,29             |
| <b>Filipinas</b>                             |           |        | <b>1.365.225</b>             | <b>0,86</b>      |
| PHILIPPINE LONG DIS 2.50 20-31 23/01S        | 500.000   | USD    | 498.145                      | 0,31             |
| SM INVESTMENTS 4.875 14-24 10/06S            | 800.000   | USD    | 867.080                      | 0,55             |
| <b>Omán</b>                                  |           |        | <b>1.352.000</b>             | <b>0,86</b>      |
| BANK MUSCAT SAOG 4.75 21-26 17/03S           | 1.300.000 | USD    | 1.352.000                    | 0,86             |
| <b>Isla de Man</b>                           |           |        | <b>1.314.813</b>             | <b>0,83</b>      |
| GOHL CAPITAL 4.25 17-27 24/01S               | 1.250.000 | USD    | 1.314.813                    | 0,83             |
| <b>Mauricio</b>                              |           |        | <b>1.163.395</b>             | <b>0,74</b>      |
| MTN MAURITIUS INVEST 6.50 16-26 13/10S       | 1.000.000 | USD    | 1.163.395                    | 0,74             |
| <b>Panamá</b>                                |           |        | <b>1.069.694</b>             | <b>0,68</b>      |
| AEROPUERTO INTERNACIONAL 6.00 18-48 18/11S   | 986.243   | USD    | 1.069.694                    | 0,68             |
| <b>Marruecos</b>                             |           |        | <b>1.014.025</b>             | <b>0,64</b>      |
| OCP 5.125 21-51 23/06S                       | 1.000.000 | USD    | 1.014.025                    | 0,64             |
| <b>Chipre</b>                                |           |        | <b>979.466</b>               | <b>0,62</b>      |
| MHP SA 7.75 17-24 10/05S                     | 900.000   | USD    | 979.466                      | 0,62             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Emerging Markets Corporate

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en USD) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Argentina</b>                         |           |        | <b>820.731</b>               | <b>0,52</b>      |
| YPF REGS 7.00 17-47 15/12S               | 1.250.000 | USD    | 820.731                      | 0,52             |
| <b>Azerbaiyán</b>                        |           |        | <b>598.780</b>               | <b>0,38</b>      |
| SOUTHERN GAS CORRIDOR 6.875 16-26 24/03S | 500.000   | USD    | 598.780                      | 0,38             |
| <b>Guatemala</b>                         |           |        | <b>522.705</b>               | <b>0,33</b>      |
| BANCO INDUSTRIAL 4.875 21-31 29/01S      | 500.000   | USD    | 522.705                      | 0,33             |
| <b>Portugal</b>                          |           |        | <b>354.340</b>               | <b>0,22</b>      |
| HUARONG FINANCE II 4.875 16-26 22/11S    | 500.000   | USD    | 354.340                      | 0,22             |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>     |           |        | <b>6.029.645</b>             | <b>3,81</b>      |
| <b>Mauricio</b>                          |           |        | <b>1.925.262</b>             | <b>1,22</b>      |
| NETWORK I2I LTD FL.R 19-XX 15/04S        | 1.800.000 | USD    | 1.925.262                    | 1,22             |
| <b>Islas Caimán</b>                      |           |        | <b>1.548.945</b>             | <b>0,98</b>      |
| EMAAR SUKUK S3 REGS FL.R 16-26 15/09S    | 1.500.000 | USD    | 1.548.945                    | 0,98             |
| <b>Colombia</b>                          |           |        | <b>1.521.443</b>             | <b>0,96</b>      |
| BANCO GNB SUDAMERIS 7.50 21-31 16/04S    | 1.500.000 | USD    | 1.521.443                    | 0,96             |
| <b>México</b>                            |           |        | <b>1.033.995</b>             | <b>0,65</b>      |
| CEMEX SAB DE CV 5.125 21-99 31/12S       | 1.000.000 | USD    | 1.033.995                    | 0,65             |
| <b>Total de la cartera de valores</b>    |           |        | <b>153.618.841</b>           | <b>97,14</b>     |
| Coste de adquisición                     |           |        | 149.142.800                  |                  |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Emerging Markets Corporate

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

### Distribución geográfica (en % activo neto)

|                           |       |
|---------------------------|-------|
| Islas Caimán              | 11,19 |
| Luxemburgo                | 8,65  |
| México                    | 6,47  |
| Islas Vírgenes Británicas | 5,30  |
| Estados Unidos de América | 5,27  |
| Países Bajos              | 4,70  |
| Colombia                  | 4,58  |
| Turquía                   | 3,93  |
| Bermuda                   | 3,90  |
| Hong Kong                 | 3,66  |
| Emiratos Árabes Unidos    | 3,18  |
| India                     | 3,04  |
| Chile                     | 2,96  |
| Indonesia                 | 2,85  |
| Singapur                  | 2,36  |
| Canadá                    | 1,96  |
| Mauricio                  | 1,95  |
| Arabia Saudita            | 1,88  |
| Brasil                    | 1,65  |
| Perú                      | 1,40  |
| Egipto                    | 1,33  |
| Irlanda                   | 1,33  |
| República Dominicana      | 1,13  |
| Malasia                   | 1,09  |
| Kenia                     | 0,95  |
| Corea del Sur             | 0,93  |
| Paraguay                  | 0,93  |
| Georgia                   | 0,89  |
| Tailandia                 | 0,87  |
| Israel                    | 0,87  |
| Filipinas                 | 0,86  |
| Omán                      | 0,86  |
| Isla de Man               | 0,83  |
| Panamá                    | 0,68  |
| Marruecos                 | 0,64  |
| Chipre                    | 0,62  |
| Argentina                 | 0,52  |
| Azerbaiyán                | 0,38  |
| Guatemala                 | 0,33  |
| Portugal                  | 0,22  |
| <b>97,14</b>              |       |

### Distribución económica (en % activo neto)

|                                                 |       |
|-------------------------------------------------|-------|
| Holdings y entidades financieras                | 34,43 |
| Telecomunicaciones                              | 15,86 |
| Petróleo                                        | 8,80  |
| Bancos y otras entidades financieras            | 7,47  |
| Química                                         | 5,15  |
| Minas                                           | 3,91  |
| Transporte                                      | 3,19  |
| Sociedades inmobiliarias                        | 3,15  |
| Metales y piedras preciosas                     | 2,09  |
| Construcción, material de construcción          | 1,79  |
| Energía y servicio de aguas                     | 1,73  |
| Seguros                                         | 1,31  |
| Papel y madera                                  | 1,03  |
| Restaurantes, hoteles                           | 0,99  |
| Servicios varios                                | 0,97  |
| Instituciones inclasificables / no clasificadas | 0,95  |
| Agricultura y pesca                             | 0,86  |
| Bienes de consumo diversos                      | 0,77  |
| Electrotecnia y electrónica                     | 0,70  |
| Industria aeronáutica y espacial                | 0,67  |
| Servicios sociales y de sanidad pública         | 0,67  |
| Comercio minorista y grandes almacenes          | 0,65  |
| <b>97,14</b>                                    |       |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Emerging Markets Total Return

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad       | Divisa | Valor de mercado<br>(en USD) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |                |        | <b>60.476.334</b>            | <b>86,06</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |                |        | <b>56.602.443</b>            | <b>80,55</b>     |
| <b>Rumanía</b>                                                                                                                  |                |        | <b>3.688.069</b>             | <b>5,25</b>      |
| ROMANIA 2.6250 20-40 02/12A                                                                                                     | 650.000        | EUR    | 766.850                      | 1,09             |
| ROMANIA 3.0 20-31 14/02S                                                                                                        | 996.000        | USD    | 1.034.012                    | 1,47             |
| ROMANIA 4.0000 20-51 14/02S                                                                                                     | 480.000        | USD    | 506.148                      | 0,72             |
| ROMANIA 4.7500 19-34 11/10A                                                                                                     | 4.000.000      | RON    | 1.032.760                    | 1,47             |
| ROMANIA REGS 6.125 14-44 22/01S                                                                                                 | 254.000        | USD    | 348.299                      | 0,50             |
| <b>Luxemburgo</b>                                                                                                               |                |        | <b>3.287.316</b>             | <b>4,68</b>      |
| MILLICOM INTL CELL 5.125 17-28 15/01S                                                                                           | 1.350.000      | USD    | 1.416.953                    | 2,02             |
| REDE D OR FIN SARL 4.5 20-30 22/01S                                                                                             | 1.000.000      | USD    | 1.024.685                    | 1,46             |
| VM HOLDING SA 6.5 20-28 18/01S                                                                                                  | 750.000        | USD    | 845.678                      | 1,20             |
| <b>República Dominicana</b>                                                                                                     |                |        | <b>3.211.210</b>             | <b>4,57</b>      |
| DOMINICAN REPUBLIC 4.5 20-30 30/01S                                                                                             | 200.000        | USD    | 204.522                      | 0,29             |
| DOMINICAN REPUBLIC 4.875 20-32 23/09S                                                                                           | 850.000        | USD    | 881.267                      | 1,25             |
| DOMINICAN REPUBLIC 5.875 20-60 30/01S                                                                                           | 250.000        | USD    | 250.341                      | 0,36             |
| DOMINICAN REPUBLIC 6.85 15-45 27/01S                                                                                            | 250.000        | USD    | 283.743                      | 0,40             |
| DOMINICAN REPUBLIC 9.75 19-26 05/06S                                                                                            | 80.000.000     | DOP    | 1.591.337                    | 2,27             |
| <b>Islas Caimán</b>                                                                                                             |                |        | <b>3.108.796</b>             | <b>4,42</b>      |
| LIMA METRO LINE REGS 4.35 19-36 05/04Q                                                                                          | 200.000        | USD    | 207.570                      | 0,29             |
| MELCO RESORTS FINANCE 4.875 17-25 06/06S                                                                                        | 600.000        | USD    | 615.417                      | 0,88             |
| QNB FINANCE LTD 6.92 19-24 09/12S                                                                                               | 100.000.000    | INR    | 1.366.151                    | 1,94             |
| SA GLOBAL SUKUK 2.6940 21-31 17/06S                                                                                             | 200.000        | USD    | 202.129                      | 0,29             |
| SA GLOBAL SUKUK LTD 1.602 21-26 17/06S                                                                                          | 200.000        | USD    | 199.934                      | 0,28             |
| SHARJAH SUKUK P 2.9420 20-27 10/06S                                                                                             | 250.000        | USD    | 258.756                      | 0,37             |
| SHARJAH SUKUK REGS 3.234 19-29 23/10S                                                                                           | 250.000        | USD    | 258.839                      | 0,37             |
| <b>Egipto</b>                                                                                                                   |                |        | <b>2.915.651</b>             | <b>4,15</b>      |
| EGYPT 3.875 21-26 16/02                                                                                                         | 800.000        | USD    | 788.652                      | 1,12             |
| EGYPT 5.75 20-24 29/05S                                                                                                         | 350.000        | USD    | 373.516                      | 0,53             |
| EGYPT 5.875 21-31 16/02S                                                                                                        | 800.000        | USD    | 777.388                      | 1,11             |
| EGYPT REG-S 6.875 10-40 30/04S                                                                                                  | 1.000.000      | USD    | 976.095                      | 1,39             |
| <b>Indonesia</b>                                                                                                                |                |        | <b>2.815.738</b>             | <b>4,01</b>      |
| INDONESIA 8.375 13-34 15/03S                                                                                                    | 10.000.000.000 | IDR    | 763.200                      | 1,09             |
| INDONESIA REG-S 6.50 19-25 16/06S                                                                                               | 7.000.000.000  | IDR    | 507.193                      | 0,72             |
| PERTAMINA 3.1 20-30 25/08S                                                                                                      | 1.500.000      | USD    | 1.545.345                    | 2,20             |
| <b>Serbia</b>                                                                                                                   |                |        | <b>2.703.102</b>             | <b>3,85</b>      |
| SERBIA 1.5 19-29 26/06A                                                                                                         | 1.000.000      | EUR    | 1.197.036                    | 1,70             |
| SERBIA 2.125 20-30 01/12S                                                                                                       | 1.300.000      | USD    | 1.234.616                    | 1,76             |
| SERBIA REGS 7.25 11-21 28/09S                                                                                                   | 267.000        | USD    | 271.450                      | 0,39             |
| <b>México</b>                                                                                                                   |                |        | <b>2.169.360</b>             | <b>3,09</b>      |
| CEMEX SAB DE CV 3.875 21-31 11/07S                                                                                              | 500.000        | USD    | 507.247                      | 0,72             |
| CEMEX SAB DE CV REGS 5.2 20-30 17/09S                                                                                           | 400.000        | USD    | 439.426                      | 0,63             |
| INDUSTRIAS PENOLES SA 5.65 19-49 12/09S                                                                                         | 500.000        | USD    | 601.675                      | 0,86             |
| NEMAK SAB DE CV 4.75 18-25 23/01S                                                                                               | 600.000        | USD    | 621.012                      | 0,88             |
| <b>Colombia</b>                                                                                                                 |                |        | <b>2.050.727</b>             | <b>2,92</b>      |
| COLOMBIA 4.00 13-24 26/02S                                                                                                      | 500.000        | USD    | 530.560                      | 0,75             |
| COLOMBIA 7.25 19-34 18/10A                                                                                                      | 5.000.000.000  | COP    | 1.312.199                    | 1,87             |
| COLOMBIA TELECOM 4.95 20-30 17/07S                                                                                              | 200.000        | USD    | 207.968                      | 0,30             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Emerging Markets Total Return

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                            | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en USD) | % activo<br>neto |
|-----------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Pakistán</b>                         |            |        | <b>1.936.767</b>             | <b>2,76</b>      |
| PAKISTAN 6.0000 21-26 08/04S            | 1.500.000  | USD    | 1.520.633                    | 2,17             |
| PAKISTAN 6.875 17-27 05/12S             | 400.000    | USD    | 416.134                      | 0,59             |
| <b>Sudáfrica</b>                        |            |        | <b>1.837.091</b>             | <b>2,61</b>      |
| SOUTH AFRICA 8.75 12-48 28/02S          | 31.000.000 | ZAR    | 1.837.091                    | 2,61             |
| <b>Paraguay</b>                         |            |        | <b>1.830.117</b>             | <b>2,60</b>      |
| PARAGUAY 2.7390 21-33 29/01S            | 695.000    | USD    | 677.622                      | 0,96             |
| PARAGUAY 4.95 20-31 28/04S              | 1.000.000  | USD    | 1.152.495                    | 1,64             |
| <b>Malasia</b>                          |            |        | <b>1.819.149</b>             | <b>2,59</b>      |
| MALAYSIA 3.478 19-24 14/06S             | 7.300.000  | MYR    | 1.819.149                    | 2,59             |
| <b>Costa Rica</b>                       |            |        | <b>1.786.534</b>             | <b>2,54</b>      |
| COSTA RICA 7.158 15-45 12/03S           | 1.000.000  | USD    | 1.047.095                    | 1,49             |
| ICE REGS 6.95 11-21 10/11S              | 730.000    | USD    | 739.439                      | 1,05             |
| <b>Perú</b>                             |            |        | <b>1.592.883</b>             | <b>2,27</b>      |
| CAMPOSOL SA 6.0000 20-27 03/02S         | 500.000    | USD    | 522.283                      | 0,74             |
| MINSUR REGS 6.25 14-24 07/02A           | 1.000.000  | USD    | 1.070.600                    | 1,53             |
| <b>Bahrein</b>                          |            |        | <b>1.570.365</b>             | <b>2,23</b>      |
| BAHRAIN 5.25 21-33 25/01S               | 1.000.000  | USD    | 975.145                      | 1,39             |
| BAHRAIN 6.2500 21-51 25/01S             | 450.000    | USD    | 428.976                      | 0,61             |
| BAHRAIN 7.50 17-47 20/09S               | 154.000    | USD    | 166.244                      | 0,23             |
| <b>Ghana</b>                            |            |        | <b>1.437.696</b>             | <b>2,05</b>      |
| GHANA 7.75 21-29 07/04S                 | 350.000    | USD    | 358.631                      | 0,51             |
| GHANA REGS 8.125 14-26 18/01S           | 1.000.000  | USD    | 1.079.065                    | 1,54             |
| <b>Turquía</b>                          |            |        | <b>1.357.306</b>             | <b>1,93</b>      |
| TURKEY 10.60 16-26 11/02S               | 5.000.000  | TRY    | 449.266                      | 0,64             |
| TURKEY 6.00 11-41 14/01S                | 1.000.000  | USD    | 908.040                      | 1,29             |
| <b>Países Bajos</b>                     |            |        | <b>1.270.406</b>             | <b>1,81</b>      |
| BRASKEM NETHERLANDS 4.5 19-30 31/01S    | 450.000    | USD    | 471.184                      | 0,67             |
| VTR FINANCE BV 6.3750 20-28 15/07S      | 750.000    | USD    | 799.222                      | 1,14             |
| <b>Omán</b>                             |            |        | <b>1.219.148</b>             | <b>1,73</b>      |
| OMAN 4.875 19-25 01/02S                 | 400.000    | USD    | 420.024                      | 0,59             |
| OMAN 6.50 17-47 08/03S                  | 500.000    | USD    | 490.815                      | 0,70             |
| OMAN SOVEREIGN SUKUK 4.875 21-30 15/06S | 300.000    | USD    | 308.309                      | 0,44             |
| <b>Micronesia</b>                       |            |        | <b>1.039.235</b>             | <b>1,48</b>      |
| KAZMUNAYGAS 3.5000 20-33 14/04S         | 1.000.000  | USD    | 1.039.235                    | 1,48             |
| <b>Mongolia</b>                         |            |        | <b>1.023.092</b>             | <b>1,46</b>      |
| MONGOLIA 3.5 21-27 07/07S               | 200.000    | USD    | 198.500                      | 0,28             |
| MONGOLIA 5.125 12-22 05/12S             | 789.000    | USD    | 824.592                      | 1,18             |
| <b>Ucrania</b>                          |            |        | <b>988.161</b>               | <b>1,41</b>      |
| UKRAINE 6.8760 21-29 21/05S             | 950.000    | USD    | 988.161                      | 1,41             |
| <b>Georgia</b>                          |            |        | <b>959.457</b>               | <b>1,36</b>      |
| GEORGIAN RAILWAY 4 21-28 17/06S         | 950.000    | USD    | 959.457                      | 1,36             |
| <b>Uzbekistán</b>                       |            |        | <b>898.087</b>               | <b>1,28</b>      |
| UZBEKISTAN 3.7000 20-30 25/11S          | 900.000    | USD    | 898.087                      | 1,28             |
| <b>El Salvador</b>                      |            |        | <b>891.545</b>               | <b>1,27</b>      |
| EL SALVADOR REG S 7.625 11-41 01/02S    | 1.000.000  | USD    | 891.545                      | 1,27             |
| <b>Costa de Marfil</b>                  |            |        | <b>872.624</b>               | <b>1,24</b>      |
| IVORY COAST 4.8750 20-32 30/01A         | 200.000    | EUR    | 237.608                      | 0,34             |
| IVORY COAST 6.125 17-33 15/06S          | 600.000    | USD    | 635.016                      | 0,90             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Emerging Markets Total Return

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                           | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en USD) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>India</b>                                           |           |        | <b>819.240</b>               | <b>1,16</b>      |
| BHARTI AIRTEL REGS 4.375 15-25 10/06S                  | 750.000   | USD    | 819.240                      | 1,16             |
| <b>Emiratos Arabes Unidos</b>                          |           |        | <b>809.036</b>               | <b>1,15</b>      |
| EMIRATE OF SHARJAHDL 3.6250 21-33 10/03S               | 800.000   | USD    | 809.036                      | 1,15             |
| <b>Bahamas</b>                                         |           |        | <b>766.399</b>               | <b>1,09</b>      |
| BAHAMAS REGS 6.00 17-28 21/11S                         | 750.000   | USD    | 766.399                      | 1,09             |
| <b>Marruecos</b>                                       |           |        | <b>737.910</b>               | <b>1,05</b>      |
| MOROCCO 2.375 20-27 15/12S                             | 750.000   | USD    | 737.910                      | 1,05             |
| <b>Bermuda</b>                                         |           |        | <b>542.942</b>               | <b>0,77</b>      |
| INVESTMENT ENERG RES 6.25 21-29 26/04S                 | 500.000   | USD    | 542.942                      | 0,77             |
| <b>Arabia Saudita</b>                                  |           |        | <b>540.804</b>               | <b>0,77</b>      |
| SAUDI ARABIAN OIL COMPANY 2.25 20-30 24/11S            | 550.000   | USD    | 540.804                      | 0,77             |
| <b>Túnez</b>                                           |           |        | <b>533.539</b>               | <b>0,76</b>      |
| CENTRAL BANK TUNISIA 5.625 17-24 17/02A                | 300.000   | EUR    | 333.156                      | 0,47             |
| CENTRAL BANK TUNISIA 5.75 15-25 30/01S                 | 214.000   | USD    | 200.383                      | 0,29             |
| <b>Belarús</b>                                         |           |        | <b>497.045</b>               | <b>0,71</b>      |
| BELARUS 6.875 17-23 28/02S                             | 500.000   | USD    | 497.045                      | 0,71             |
| <b>Senegal</b>                                         |           |        | <b>468.468</b>               | <b>0,67</b>      |
| SENEGAL 5.375 21-37 08/06A                             | 400.000   | EUR    | 468.468                      | 0,67             |
| <b>Irak</b>                                            |           |        | <b>256.237</b>               | <b>0,36</b>      |
| IRAQ 6.75 17-23 03/09S                                 | 250.000   | USD    | 256.237                      | 0,36             |
| <b>Chile</b>                                           |           |        | <b>218.934</b>               | <b>0,31</b>      |
| CORPORACION NACIONAL 3.75 20-31 15/06S                 | 200.000   | USD    | 218.934                      | 0,31             |
| <b>Argentina</b>                                       |           |        | <b>132.257</b>               | <b>0,19</b>      |
| ARGENTINA 0.125 20-30 09/07S                           | 119.876   | USD    | 43.211                       | 0,06             |
| ARGENTINA 0.125 20-35 09/07S                           | 219.623   | USD    | 69.904                       | 0,10             |
| ARGENTINA 1.00 20-29 09/07SS                           | 50.231    | USD    | 19.142                       | 0,03             |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>                   |           |        | <b>3.873.891</b>             | <b>5,51</b>      |
| <b>Ucrania</b>                                         |           |        | <b>1.783.207</b>             | <b>2,54</b>      |
| UKRAINE FL.R 15-40 31/05A                              | 1.500.000 | USD    | 1.783.207                    | 2,54             |
| <b>Costa de Marfil</b>                                 |           |        | <b>1.028.186</b>             | <b>1,46</b>      |
| IVORY COAST FL.R 10-32 31/12S                          | 1.022.917 | USD    | 1.028.186                    | 1,46             |
| <b>Argentina</b>                                       |           |        | <b>850.086</b>               | <b>1,21</b>      |
| ARGENTINA FL.R 20-21 09/07S                            | 2.371.000 | USD    | 850.086                      | 1,21             |
| <b>Irak</b>                                            |           |        | <b>212.412</b>               | <b>0,30</b>      |
| IRAQ FL.R 06-28 15/01S                                 | 218.750   | USD    | 212.412                      | 0,30             |
| <b>Organismos de Inversión Colectiva</b>               |           |        | <b>4.800.532</b>             | <b>6,83</b>      |
| <b>Acciones/Participaciones en fondos de inversión</b> |           |        | <b>4.800.532</b>             | <b>6,83</b>      |
| <b>Luxemburgo</b>                                      |           |        | <b>4.800.532</b>             | <b>6,83</b>      |
| CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z USD C  | 2.440     | USD    | 2.688.929                    | 3,83             |
| CANDRIAM MONEY MARKET USD Z USD C                      | 1.900     | USD    | 2.111.603                    | 3,00             |
| <b>Total de la cartera de valores</b>                  |           |        | <b>65.276.866</b>            | <b>92,89</b>     |
| Coste de adquisición                                   |           |        | 63.417.503                   |                  |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Emerging Markets Total Return

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

### Distribución geográfica (en % activo neto)

|                        |              |
|------------------------|--------------|
| Luxemburgo             | 11,51        |
| Rumanía                | 5,25         |
| República Dominicana   | 4,57         |
| Islas Caimán           | 4,42         |
| Egipto                 | 4,15         |
| Indonesia              | 4,01         |
| Ucrania                | 3,94         |
| Serbia                 | 3,85         |
| México                 | 3,09         |
| Colombia               | 2,92         |
| Pakistán               | 2,76         |
| Costa de Marfil        | 2,70         |
| Sudáfrica              | 2,61         |
| Paraguay               | 2,60         |
| Malasia                | 2,59         |
| Costa Rica             | 2,54         |
| Perú                   | 2,27         |
| Bahrein                | 2,23         |
| Ghana                  | 2,05         |
| Turquía                | 1,93         |
| Países Bajos           | 1,81         |
| Omán                   | 1,73         |
| Micronesia             | 1,48         |
| Mongolia               | 1,46         |
| Argentina              | 1,40         |
| Georgia                | 1,36         |
| Uzbekistán             | 1,28         |
| El Salvador            | 1,27         |
| India                  | 1,16         |
| Emiratos Arabes Unidos | 1,15         |
| Bahamas                | 1,09         |
| Marruecos              | 1,05         |
| Arabia Saudita         | 0,77         |
| Bermuda                | 0,77         |
| Túnez                  | 0,76         |
| Belarús                | 0,71         |
| Irak                   | 0,67         |
| Senegal                | 0,67         |
| Chile                  | 0,31         |
|                        | <b>92,89</b> |

### Distribución económica (en % activo neto)

|                                                                |              |
|----------------------------------------------------------------|--------------|
| Obligaciones del Estado, de las provincias y de los municipios | 59,47        |
| Holdings y entidades financieras                               | 7,72         |
| Fondos de inversión                                            | 6,83         |
| Petróleo                                                       | 5,02         |
| Telecomunicaciones                                             | 4,62         |
| Minas                                                          | 1,84         |
| Transporte                                                     | 1,37         |
| Construcción, material de construcción                         | 1,35         |
| Electrotecnia y electrónica                                    | 1,05         |
| Industria automovilística                                      | 0,88         |
| Metales y piedras preciosas                                    | 0,86         |
| Agricultura y pesca                                            | 0,74         |
| Química                                                        | 0,67         |
| Bancos y otras entidades financieras                           | 0,47         |
|                                                                | <b>92,89</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |            |        | <b>528.459.836</b>           | <b>96,92</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |            |        | <b>479.390.595</b>           | <b>87,92</b>     |
| <b>Francia</b>                                                                                                                  |            |        | <b>89.350.191</b>            | <b>16,39</b>     |
| AGENCE FRANCAISE DVP 0.25 19-29 29/06A                                                                                          | 1.600.000  | EUR    | 1.625.072                    | 0,30             |
| AIR LIQUIDE FIN 1.0000 20-25 02/04A                                                                                             | 800.000    | EUR    | 834.848                      | 0,15             |
| ALD SA 0.375 19-23 18/07A                                                                                                       | 800.000    | EUR    | 808.360                      | 0,15             |
| BANQUE POSTALE HOME LOAN 1.0 18-28 10/04A                                                                                       | 2.000.000  | EUR    | 2.158.830                    | 0,40             |
| BFCM 1.75 19-29 15/03A                                                                                                          | 1.000.000  | EUR    | 1.089.370                    | 0,20             |
| BNP PARIBAS CARDIF 1.00 17-24 29/11A                                                                                            | 1.500.000  | EUR    | 1.538.475                    | 0,28             |
| BPCE SFH 0.125 21-30 03/12A                                                                                                     | 1.500.000  | EUR    | 1.506.420                    | 0,28             |
| CAISSE DEPOTS CONS 0.01 20-25 15/09A                                                                                            | 1.200.000  | EUR    | 1.219.452                    | 0,22             |
| CAPGEMINI SE 0.6250 20-25 23/06A                                                                                                | 1.700.000  | EUR    | 1.743.070                    | 0,32             |
| CARREFOUR BANQUE 0.107 21-25 14/06A                                                                                             | 800.000    | EUR    | 801.712                      | 0,15             |
| CIE DE SAINT-GOBAIN 1.875 18-28 21/09A                                                                                          | 200.000    | EUR    | 223.361                      | 0,04             |
| CNP ASSUR. 1.875 16-22 20/10A                                                                                                   | 200.000    | EUR    | 205.169                      | 0,04             |
| COUNCIL OF EUROPE 0.125 17-24 10/04A                                                                                            | 1.583.000  | EUR    | 1.611.051                    | 0,30             |
| CREDIT AGRICOLE SA 0.375 19-25 21/10A                                                                                           | 1.300.000  | EUR    | 1.315.724                    | 0,24             |
| DANONE SA EMTN 0.00 21-25 01/12A                                                                                                | 1.600.000  | EUR    | 1.607.736                    | 0,30             |
| ENGIE SA 0.375 19-27 21/06A                                                                                                     | 1.400.000  | EUR    | 1.422.995                    | 0,26             |
| ESSILORLUXOTTICA 0.375 19-27 27/11A                                                                                             | 1.000.000  | EUR    | 1.021.025                    | 0,19             |
| FRANCE 0.50 21-44 25/06A                                                                                                        | 2.576.000  | EUR    | 2.461.754                    | 0,45             |
| FRANCE 1.75 17-39 25/06A                                                                                                        | 11.210.000 | EUR    | 13.611.911                   | 2,50             |
| FRANCE 2.00 17-48 25/05A                                                                                                        | 1.668.000  | EUR    | 2.148.301                    | 0,39             |
| FRANCE 3.25 12-45 25/05A                                                                                                        | 3.314.000  | EUR    | 5.165.747                    | 0,95             |
| FRANCE 4.50 09-41 25/04A                                                                                                        | 3.000.000  | EUR    | 5.203.125                    | 0,95             |
| FRANCE OAT 1.5 18-50 25/05A                                                                                                     | 4.100.000  | EUR    | 4.765.922                    | 0,87             |
| FRANCE ZCP 290420                                                                                                               | 1.500.000  | EUR    | 1.434.240                    | 0,26             |
| GROUPAMA SA 2.125 19-29 16/09A                                                                                                  | 400.000    | EUR    | 420.628                      | 0,08             |
| GROUPAMA SA 3.375 18-28 24/09A                                                                                                  | 500.000    | EUR    | 568.183                      | 0,10             |
| ICADE SANTE SAS 1.375 20-30 17/09A                                                                                              | 500.000    | EUR    | 525.662                      | 0,10             |
| ILE DE FRANCE 0.50 16-25 14/06A                                                                                                 | 1.000.000  | EUR    | 1.032.185                    | 0,19             |
| KERING 0.2500 20-23 13/05A                                                                                                      | 2.000.000  | EUR    | 2.019.900                    | 0,37             |
| KLEPIERRE 0.625 19-30 01/07A                                                                                                    | 600.000    | EUR    | 601.161                      | 0,11             |
| LA BANQUE POSTALE 0.75 21-31 23/06A                                                                                             | 900.000    | EUR    | 896.535                      | 0,16             |
| LA BANQUE POSTALE 1.375 19-29 24/04A                                                                                            | 700.000    | EUR    | 747.394                      | 0,14             |
| LA MONDIALE 0.7500 20-26 20/04A                                                                                                 | 800.000    | EUR    | 810.652                      | 0,15             |
| LVMH MOET HENNESSY 0.125 19-23 28/02A                                                                                           | 1.000.000  | EUR    | 1.007.040                    | 0,18             |
| NESTLE FINANCE 0.00 20-24 12/11U                                                                                                | 2.823.000  | EUR    | 2.846.304                    | 0,52             |
| ORANGE SA 1.375 18-28 20/03A                                                                                                    | 1.400.000  | EUR    | 1.512.063                    | 0,28             |
| PERNOD RICARD S 1.1250 20-25 07/04A                                                                                             | 400.000    | EUR    | 417.756                      | 0,08             |
| REGIE AUTONOME TRANS 0.875 17-27 25/05A                                                                                         | 1.600.000  | EUR    | 1.688.608                    | 0,31             |
| REGION ILE DE FRANCE 1.375 17-29 14/03A                                                                                         | 2.700.000  | EUR    | 2.969.217                    | 0,54             |
| RTE RESEAU DE TRANSP 1.00 16-26 19/10A                                                                                          | 900.000    | EUR    | 943.312                      | 0,17             |
| SCHNEIDER ELECT 1.3750 18-27 21/06A                                                                                             | 900.000    | EUR    | 971.775                      | 0,18             |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.0 20-27 09/04A                                                                                          | 300.000    | EUR    | 317.322                      | 0,06             |
| SNCF RESEAU 1.875 17-34 30/03A                                                                                                  | 1.700.000  | EUR    | 1.983.228                    | 0,36             |
| SOCIETE DE FINANCE LOCALE 0.00 19-24 24/05U                                                                                     | 1.000.000  | EUR    | 1.011.475                    | 0,19             |
| SOCIETE GENERALE SFH 0.01 20-30 11/02A                                                                                          | 1.800.000  | EUR    | 1.800.423                    | 0,33             |
| STE AUTORPARRHI 1.5 18-30 25/01A                                                                                                | 800.000    | EUR    | 888.272                      | 0,16             |
| TOTAL CAPITAL INTERN 0.696 19-28 31/05A                                                                                         | 600.000    | EUR    | 622.911                      | 0,11             |
| TOTAL SE FL.R 16-XX 05/05A                                                                                                      | 500.000    | EUR    | 521.117                      | 0,10             |
| UNION NAT.INTERPRO.EMP 0.0 20-28 25/11U                                                                                         | 1.800.000  | EUR    | 1.808.451                    | 0,33             |
| VEOLIA ENV 1.2500 20-28 15/04A                                                                                                  | 600.000    | EUR    | 640.584                      | 0,12             |
| VEOLIA ENV 1.59 15-28 10/01A                                                                                                    | 300.000    | EUR    | 326.161                      | 0,06             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                              | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|-------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| VILLE DE PARIS 1.75 15-31 25/05A          | 2.000.000  | EUR    | 2.275.780                    | 0,42             |
| VINCI SA 1.625 19-29 18/01A               | 1.500.000  | EUR    | 1.652.422                    | 0,30             |
| <b>Italia</b>                             |            |        | <b>85.311.959</b>            | <b>15,65</b>     |
| ASSICURAZIONI GENERALI 2.429 20-31 14/07A | 470.000    | EUR    | 507.175                      | 0,09             |
| AUTOSTRADe PER l'ITAL 2.65 20-28 08/03A   | 2.000.000  | EUR    | 2.087.172                    | 0,38             |
| ENI 0.375 21-28 14/06A                    | 405.000    | EUR    | 406.312                      | 0,08             |
| INTESA SANPAOLO 0.75 19-24 04/12A         | 547.000    | EUR    | 561.170                      | 0,10             |
| INTESA SANPAOLO 1.0000 19-24 04/07A       | 992.000    | EUR    | 1.021.815                    | 0,19             |
| INTESA SANPAOLO 1.375 17-24 18/01A        | 1.400.000  | EUR    | 1.452.626                    | 0,27             |
| ITALY 0.9 20-31 01/04S                    | 6.000.000  | EUR    | 6.072.450                    | 1,11             |
| ITALY 0.95 18-23 01/03S                   | 4.000.000  | EUR    | 4.089.620                    | 0,75             |
| ITALY 1.65 20-30 01/12S                   | 14.000.000 | EUR    | 15.160.670                   | 2,78             |
| ITALY 2.00 18-28 01/02S                   | 6.000.000  | EUR    | 6.636.390                    | 1,22             |
| ITALY 2.25 16-36 01/09S                   | 6.412.000  | EUR    | 7.306.314                    | 1,34             |
| ITALY 2.50 14-24 01/12S                   | 3.500.000  | EUR    | 3.815.805                    | 0,70             |
| ITALY 2.70 16-47 01/03S                   | 3.032.000  | EUR    | 3.641.538                    | 0,67             |
| ITALY 2.80 18-28 01/08S                   | 2.900.000  | EUR    | 3.389.824                    | 0,62             |
| ITALY 3.75 14-24 01/09S                   | 2.000.000  | EUR    | 2.249.350                    | 0,41             |
| ITALY 4.00 05-37 01/02S                   | 700.000    | EUR    | 966.549                      | 0,18             |
| ITALY 4.50 13-24 01/03S                   | 6.400.000  | EUR    | 7.208.800                    | 1,32             |
| ITALY 5.00 03-34 01/08S                   | 2.007.000  | EUR    | 2.959.321                    | 0,54             |
| ITALY 5.00 09-40 01/09S                   | 2.991.000  | EUR    | 4.750.904                    | 0,87             |
| ITALY BTP 0.65 16-23 15/10S               | 500.000    | EUR    | 511.053                      | 0,09             |
| ITALY BTP 5.50 12-22 01/11S               | 2.000.000  | EUR    | 2.157.690                    | 0,40             |
| ITALY TB 2.10 19-26 15/07S                | 3.800.000  | EUR    | 4.177.587                    | 0,77             |
| SNAM 0.00 21-25 15/08A                    | 1.032.000  | EUR    | 1.031.453                    | 0,19             |
| SNAM SPA 0.00 20-28 07/12A                | 1.300.000  | EUR    | 1.259.037                    | 0,23             |
| TERNA SPA 0.75 20-32 24/09S               | 362.000    | EUR    | 362.491                      | 0,07             |
| TERNA SPA 1.0000 19-26 10/04A             | 394.000    | EUR    | 411.923                      | 0,08             |
| TRANSMISSIONNE ELETTRI 0.375 21-29 23/06A | 561.000    | EUR    | 561.098                      | 0,10             |
| UNICREDIT 2.569 20-26 22/09S              | 650.000    | USD    | 555.822                      | 0,10             |
| <b>España</b>                             |            |        | <b>52.349.397</b>            | <b>9,60</b>      |
| ADIF ALTA VELOC 0.5500 20-30 30/04A       | 1.100.000  | EUR    | 1.112.578                    | 0,20             |
| BANCO BILBAO VIZCAYA 0.75 20-25 04/06A    | 1.400.000  | EUR    | 1.442.945                    | 0,26             |
| BANCO DE SABADELL SA 0.125 20-28 10/02A   | 1.200.000  | EUR    | 1.214.580                    | 0,22             |
| BANCO DE SABADELL SA 0.875 17-23 05/03A   | 2.500.000  | EUR    | 2.537.425                    | 0,47             |
| BANCO SANTANDER SA 0.30 19-26 04/10A      | 1.500.000  | EUR    | 1.512.412                    | 0,28             |
| BANKIA SA 0.8750 19-24 25/03A             | 1.200.000  | EUR    | 1.231.842                    | 0,23             |
| BANKIA SA 1.0000 19-24 25/06A             | 400.000    | EUR    | 410.766                      | 0,07             |
| BONOS Y OBLIG DEL EST 0.0 20-26 31/01A    | 2.000.000  | EUR    | 2.022.810                    | 0,37             |
| CAIXABANK SA 0.50 21-29 09/02A            | 1.800.000  | EUR    | 1.774.728                    | 0,33             |
| CAIXABANK SA 0.7500 21-28 26/05A          | 1.600.000  | EUR    | 1.610.608                    | 0,30             |
| CORES 1.7500 17-27 24/11A                 | 1.500.000  | EUR    | 1.650.480                    | 0,30             |
| IBERDROLA FINANZAS 1.25 17-27 13/09A      | 2.100.000  | EUR    | 2.259.737                    | 0,41             |
| SANTANDER CONS FIN 0.3750 19-24 27/06A    | 700.000    | EUR    | 708.795                      | 0,13             |
| SPAIN 0.00 20-23 30/04U                   | 3.000.000  | EUR    | 3.028.245                    | 0,56             |
| SPAIN 0.80 20-27 30/07A                   | 4.000.000  | EUR    | 4.209.900                    | 0,77             |
| SPAIN 1.45 19-29 29/01A                   | 3.759.000  | EUR    | 4.138.697                    | 0,76             |
| SPAIN 2.35 17-33 30/07A                   | 1.200.000  | EUR    | 1.443.258                    | 0,26             |
| SPAIN 2.90 16-46 31/10A                   | 3.350.000  | EUR    | 4.527.039                    | 0,83             |
| SPAIN 4.20 05-37 31/01A                   | 4.700.000  | EUR    | 7.024.009                    | 1,29             |
| SPAIN 5.15 13-44 31/10A                   | 3.485.000  | EUR    | 6.299.713                    | 1,16             |
| SPAIN 5.40 13-23 31/01A                   | 2.000.000  | EUR    | 2.188.830                    | 0,40             |
| <b>Países Bajos</b>                       |            |        | <b>48.323.320</b>            | <b>8,86</b>      |
| ABN AMRO BANK 0.5 19-26 15/04A            | 1.646.000  | EUR    | 1.690.746                    | 0,31             |
| ABN AMRO BANK 0.8750 18-25 22/04A         | 1.661.000  | EUR    | 1.727.266                    | 0,32             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| ABN AMRO BANK 1.25 20-25 28/05A          | 400.000   | EUR    | 418.098                      | 0,08             |
| ALLIANZ FINANCE II 0.00 20-25 14/01U     | 1.500.000 | EUR    | 1.510.162                    | 0,28             |
| ASML HOLDING NV 0.6250 20-29 07/05A      | 2.054.000 | EUR    | 2.119.759                    | 0,39             |
| BMW FINANCE NV 0.0000 21-26 11/01A       | 1.161.000 | EUR    | 1.162.829                    | 0,21             |
| BMW FINANCE NV 0.6250 19-23 06/10A       | 1.335.000 | EUR    | 1.362.221                    | 0,25             |
| BUNGE FIN EUROPE BV 1.850 16-23 16/06A   | 1.012.000 | EUR    | 1.045.543                    | 0,19             |
| COOPERATIEVE RA 0.6250 21-33 25/02A      | 1.100.000 | EUR    | 1.097.547                    | 0,20             |
| CRH FUNDING 1.875 15-24 09/01A           | 518.000   | EUR    | 542.284                      | 0,10             |
| EDP FINANCE 0.3750 19-26 16/09A          | 1.054.000 | EUR    | 1.065.784                    | 0,20             |
| ENEL FIN INTL 1.125 18-26 16/09A         | 478.000   | EUR    | 503.384                      | 0,09             |
| HEINEKEN NV 1.625 20-25 30/03A           | 333.000   | EUR    | 354.498                      | 0,06             |
| ING GROEP NV 2.5000 18-30 15/11A         | 100.000   | EUR    | 119.197                      | 0,02             |
| ING GROUP NV 1.0 10-23 20/09A            | 300.000   | EUR    | 308.406                      | 0,06             |
| KON AHOLD DELHAIZE 0.25 19-25 26/06A     | 1.260.000 | EUR    | 1.273.879                    | 0,23             |
| KONINKLIJKE AHOLD 0.875 17-24 19/09A     | 1.299.000 | EUR    | 1.337.704                    | 0,25             |
| NATIONALE-NEDERLANDEN 0.625 18-25 11/09A | 1.500.000 | EUR    | 1.556.535                    | 0,29             |
| NEDER WATERSCHAPSB 1.25 16-36 27/05A     | 785.000   | EUR    | 877.292                      | 0,16             |
| NEDER WATERSCHAPSBANK 1.25 17-32 07/06A  | 1.577.000 | EUR    | 1.766.871                    | 0,32             |
| NETHERLANDS 0.00 20-30 15/07A            | 4.000.000 | EUR    | 4.065.300                    | 0,75             |
| NETHERLANDS 0.50 19-40 15/01A            | 4.400.000 | EUR    | 4.644.684                    | 0,85             |
| NN GROUP NV 1.625 17-27 01/06A           | 1.310.000 | EUR    | 1.421.304                    | 0,26             |
| RABOBANK 0.25 19-26 30/10A               | 1.900.000 | EUR    | 1.923.826                    | 0,35             |
| RABOBANK 1.125 19-31 07/05A              | 600.000   | EUR    | 641.211                      | 0,12             |
| RABOBANK FL.R 19-XX 29/06S               | 800.000   | EUR    | 829.432                      | 0,15             |
| RECKITT BENCKISER TRE 0.375 20-26 19/05A | 2.374.000 | EUR    | 2.415.414                    | 0,44             |
| REPSOL INTL FIN 0.125 20-24 05/10A       | 1.000.000 | EUR    | 1.006.790                    | 0,18             |
| ROYAL PHILIPS NV 0.5000 19-26 22/05A     | 923.000   | EUR    | 945.955                      | 0,17             |
| ROYAL PHILIPS NV 0.50 17-23 06/09A       | 1.244.000 | EUR    | 1.262.865                    | 0,23             |
| SCHLUMBERGER FIN 0.00 19-24 15/10U       | 2.619.000 | EUR    | 2.631.074                    | 0,48             |
| SHELL INTL FINANCE BV 0.125 19-27 08/11A | 901.000   | EUR    | 902.248                      | 0,17             |
| SIEMENS FIN 0.00 20-23 20/02U            | 1.300.000 | EUR    | 1.308.125                    | 0,24             |
| SIEMENS FIN NV 0.30 19-24 28/02A         | 216.000   | EUR    | 219.378                      | 0,04             |
| TELEFONICA EUROPE BV 2.376 21-99 31/12A  | 700.000   | EUR    | 685.429                      | 0,13             |
| UNILEVER NV 1.25 20-25 25/03A            | 1.500.000 | EUR    | 1.580.280                    | 0,29             |
| <b>Estados Unidos de América</b>         |           |        | <b>43.655.140</b>            | <b>8,01</b>      |
| ABBVIE INC 1.5 20-23N15/11A              | 167.000   | EUR    | 173.420                      | 0,03             |
| AIR PRODUCTS & CHEMS 0.5 20-28 05/05A    | 500.000   | EUR    | 510.010                      | 0,09             |
| AMAZON.COM INC 0.4500 21-24 12/05S       | 642.000   | USD    | 540.373                      | 0,10             |
| AMERICAN HONDA FIN 0.55 18-23 17/03A     | 389.000   | EUR    | 394.590                      | 0,07             |
| AMERICAN INTL GRP 1.875 17-27 21/06A     | 716.000   | EUR    | 774.143                      | 0,14             |
| APPLE INC 0.5 19-31 15/11A               | 955.000   | EUR    | 970.247                      | 0,18             |
| AT&T INC 0.8000 19-30 04/03A             | 741.000   | EUR    | 747.536                      | 0,14             |
| AT&T INC 2.35 18-29 05/09A               | 1.500.000 | EUR    | 1.700.625                    | 0,31             |
| BIRD 1.50 16-36 14/01A                   | 367.000   | EUR    | 425.766                      | 0,08             |
| BOSTON SCIENTIF 0.6250 19-27 01/12A      | 1.336.000 | EUR    | 1.356.835                    | 0,25             |
| BUONI POLIENNAL 1.5000 21-45 30/04S      | 4.424.000 | EUR    | 4.303.667                    | 0,79             |
| COCA-COLA CO/TH 1.4500 20-27 01/06S      | 453.000   | USD    | 385.850                      | 0,07             |
| COLGATE-PALMOLIVE CO 0.5 19-26 06/03A    | 833.000   | EUR    | 854.704                      | 0,16             |
| COLGATE-PALMOLIVE CO 0.875 19-29 12/11S  | 837.000   | EUR    | 845.140                      | 0,16             |
| DANAHER CORP 1.7 20-24 30/03A            | 990.000   | EUR    | 1.038.678                    | 0,19             |
| EQUINIX INC 0.2500 21-27 15/03A          | 840.000   | EUR    | 834.893                      | 0,15             |
| EXXON MOBIL COR 0.1420 20-24 26/06A      | 1.303.000 | EUR    | 1.314.056                    | 0,24             |
| FIDELITY NATIONAL INF 1.5 19-27 21/05A   | 571.000   | EUR    | 606.505                      | 0,11             |
| FISERV INC 1.125 19-27 01/07A            | 150.000   | EUR    | 156.826                      | 0,03             |
| ILLINOIS TOOL WORKS 1.25 15-23 22/05A    | 500.000   | EUR    | 512.717                      | 0,09             |
| INTL BK FOR RECONS 0.00 20-30 21/02U     | 6.000.000 | EUR    | 6.006.150                    | 1,10             |
| KELLOGG CO 0.5000 21-29 20/05A           | 923.000   | EUR    | 923.785                      | 0,17             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| MANPOWERGROUP INC 1.75 18-26 22/06A      | 526.000   | EUR    | 564.643                      | 0,10             |
| MCDONALD'S CORP 0.625 17-24 29/01A       | 2.000.000 | EUR    | 2.041.650                    | 0,37             |
| MONDELEZ INTERNATIONAL0.25 21-28 17/03A  | 1.402.000 | EUR    | 1.393.882                    | 0,26             |
| NASDAQ INC 0.8750 20-30 13/02A           | 613.000   | EUR    | 623.357                      | 0,11             |
| PEPSI 0.25 20-24 06/05A                  | 1.273.000 | EUR    | 1.292.712                    | 0,24             |
| PROCTER & GAMBLE CO 0.55 20-25 29/10S    | 553.000   | USD    | 460.721                      | 0,09             |
| PROCTER & GAMBLE CO 0.625 18-24 30/10A   | 2.469.000 | EUR    | 2.541.070                    | 0,47             |
| PROLOGIS EURO FINANCE 0.375 20-28 06/02A | 967.000   | EUR    | 976.017                      | 0,18             |
| PROLOGIS LP 1.625 20-32 17/06A           | 146.000   | EUR    | 158.130                      | 0,03             |
| STRYKER CORP 0.25 19-24 03/12A           | 2.287.000 | EUR    | 2.310.899                    | 0,42             |
| THERMO FISHER S 0.1250 19-25 01/03A      | 2.267.000 | EUR    | 2.279.616                    | 0,42             |
| THERMO FISHER SCIEN 1.40 17-26 23/01A    | 907.000   | EUR    | 960.935                      | 0,18             |
| VERIZON COMMUNICATION 0.875 19-27 08/04A | 1.000.000 | EUR    | 1.035.150                    | 0,19             |
| VOLKSWAGEN GROU 1.2500 20-25 24/11S      | 1.954.000 | USD    | 1.639.842                    | 0,30             |
| <b>Alemania</b>                          |           |        | <b>33.105.630</b>            | <b>6,07</b>      |
| ADIDAS AG 0.00 20-24 09/09U              | 800.000   | EUR    | 804.728                      | 0,15             |
| ADIDAS AG 0.00 20-28 05/10U              | 1.200.000 | EUR    | 1.192.188                    | 0,22             |
| DAIMLER AG 0.75 20-30 10/09A             | 500.000   | EUR    | 515.277                      | 0,09             |
| DEUTSCHE BAHN FIN 1.50 17-32 08/12A      | 1.231.000 | EUR    | 1.384.179                    | 0,25             |
| DEUTSCHE BOERSE AG 0.0 21-26 22/02A      | 4.000.000 | EUR    | 4.019.440                    | 0,74             |
| DEUTSCHE TELEKOM AG 1.75 19-31 25/03A    | 1.000.000 | EUR    | 1.122.105                    | 0,21             |
| EUROGRID GMBH 1.1130 20-32 15/05A        | 300.000   | EUR    | 316.551                      | 0,06             |
| GERMANY 0.00 20-30 15/08U                | 3.639.000 | EUR    | 3.758.941                    | 0,69             |
| GERMANY 0.50 14-30 15/04A                | 2.200.000 | EUR    | 2.858.237                    | 0,52             |
| GERMANY 2.50 12-44 04/07A                | 600.000   | EUR    | 920.874                      | 0,17             |
| GERMANY 5.625 98-28 04/01A               | 2.000.333 | EUR    | 2.822.070                    | 0,52             |
| HOCHTIEF AG 0.5 19-27 03/09A             | 566.000   | EUR    | 569.937                      | 0,10             |
| KFW 0.0100 19-27 05/05A                  | 1.115.000 | EUR    | 1.135.053                    | 0,21             |
| LAND HESSEN 0.6250 17-27 07/04A          | 2.000.000 | EUR    | 2.103.450                    | 0,39             |
| SAP SE 0.25 18-22 10/03A                 | 1.200.000 | EUR    | 1.205.190                    | 0,22             |
| STATE OF BERLIN 0.625 17-27 08/02A       | 700.000   | EUR    | 735.840                      | 0,13             |
| STATE OF SCHLESWIG-HO 0.200 19-39 15/08A | 1.357.000 | EUR    | 1.291.905                    | 0,24             |
| VOLKSWAGEN BANK 1.2500 18-24 10/06A      | 1.000.000 | EUR    | 1.037.385                    | 0,19             |
| VOLKSWAGEN FIN 2.2500 19-27 01/10A       | 1.000.000 | EUR    | 1.113.680                    | 0,20             |
| VOLKSWAGEN LEASING 0.00 21-24 19/07A     | 1.610.000 | EUR    | 1.609.082                    | 0,30             |
| VOLKSWAGEN LEASING 0.25 21-26 12/01A     | 1.317.000 | EUR    | 1.321.926                    | 0,24             |
| VOLKSWAGEN LEASING 0.50 19-22 20/06A     | 761.000   | EUR    | 766.727                      | 0,14             |
| VONOVIA SE 0.3750 21-27 16/06A           | 500.000   | EUR    | 500.865                      | 0,09             |
| <b>Bélgica</b>                           |           |        | <b>26.503.398</b>            | <b>4,86</b>      |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV 2.125 20-27 12/02A  | 1.000.000 | EUR    | 1.120.445                    | 0,21             |
| BARRY CALLEBAUT SER 2.375 16-24 24/05A   | 1.300.000 | EUR    | 1.378.006                    | 0,25             |
| BELFIUS BANQUE 0.375 21-27 08/06A        | 1.000.000 | EUR    | 998.345                      | 0,18             |
| BELFIUS BANQUE SA/NV 0.125 20-30 28/01A  | 800.000   | EUR    | 807.172                      | 0,15             |
| BELGIUM 0.375 20-30 15/04A               | 900.000   | EUR    | 919.661                      | 0,17             |
| BELGIUM 0.40 20-40 22/06A                | 1.400.000 | EUR    | 1.348.081                    | 0,25             |
| BELGIUM 1.25 18-33 22/04A                | 2.757.000 | EUR    | 3.110.199                    | 0,57             |
| BELGIUM 3.75 13-45 22/06A                | 4.438.000 | EUR    | 7.380.549                    | 1,35             |
| BNP PARIBAS 0.625 18-25 04/10A           | 700.000   | EUR    | 727.801                      | 0,13             |
| COMMUNAUTE EUROPEENNE 0.00 20-30 04/10A  | 1.000.000 | EUR    | 1.003.415                    | 0,19             |
| COMMUNAUTE FLAMANDE 1.00 16-36 13/10A    | 1.600.000 | EUR    | 1.699.992                    | 0,31             |
| COMMUNAUTE FLAMANDE 1.375 18-33 21/11A   | 200.000   | EUR    | 224.148                      | 0,04             |
| EUROPEAN UNION 0.00 21-31 04/07A         | 650.000   | EUR    | 648.989                      | 0,12             |
| FLUXYS BELGIUM SA 1.75 17-27 05/10A      | 1.800.000 | EUR    | 1.895.895                    | 0,35             |
| KBC BANK NV 0.00 20-25 03/12U            | 700.000   | EUR    | 710.192                      | 0,13             |
| KBC GROUP NV 0.6250 19-25 10/04A         | 500.000   | EUR    | 511.578                      | 0,09             |
| UCB SA 1.0000 21-28 30/03A               | 2.000.000 | EUR    | 2.018.930                    | 0,37             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Austria</b>                           |           |        | <b>13.627.621</b>            | <b>2,50</b>      |
| AUSTRIA 0.50 17-27 20/04A                | 900.000   | EUR    | 946.912                      | 0,18             |
| AUSTRIA 0.5 19-29 20/02A                 | 4.300.000 | EUR    | 4.529.943                    | 0,83             |
| AUSTRIA 1.50 16-47 20/02A                | 4.400.000 | EUR    | 5.401.110                    | 0,99             |
| AUSTRIA 2.40 13-34 23/05A                | 1.200.000 | EUR    | 1.543.770                    | 0,28             |
| ERSTE GROUP BAN 0.0500 20-25 16/09A      | 1.200.000 | EUR    | 1.205.886                    | 0,22             |
| <b>Luxemburgo</b>                        |           |        | <b>13.061.531</b>            | <b>2,40</b>      |
| DH EUROPE FIN 0.45 19-28 18/03A          | 1.408.000 | EUR    | 1.420.461                    | 0,26             |
| EFSF 3.00 13-34 04/09A                   | 1.000.000 | EUR    | 1.361.000                    | 0,25             |
| GRAND CITY PROPERTIES 1.375 17-26 03/08A | 700.000   | EUR    | 739.946                      | 0,14             |
| LUXEMBOURG 0.00 20-32 14/09U             | 1.277.000 | EUR    | 1.264.766                    | 0,23             |
| LUXEMBOURG 0.625 17-27 01/02A            | 640.000   | EUR    | 674.483                      | 0,12             |
| MEDTRONIC GLOBAL HOLD 0.00 20-23 15/03U  | 1.230.000 | EUR    | 1.237.337                    | 0,23             |
| MEDTRONIC GLOBAL HOLD 0.25 19-25 02/07A  | 1.704.000 | EUR    | 1.726.927                    | 0,32             |
| NESTLE FINANCE 0.00001 20-25 3/12A       | 1.806.000 | EUR    | 1.816.962                    | 0,33             |
| NESTLE FINANCE 0.00 20-33 03/03U         | 429.000   | EUR    | 405.412                      | 0,08             |
| PROLOGIS INTL FUND II 0.75 21-33 23/03A  | 898.000   | EUR    | 881.396                      | 0,16             |
| TYCO ELECTRONICS 0.00 20-25 14/02U       | 1.527.000 | EUR    | 1.532.841                    | 0,28             |
| <b>Reino Unido</b>                       |           |        | <b>9.120.700</b>             | <b>1,67</b>      |
| BP CAPITAL MARKETS 0.8310 19-27 08/11A   | 592.000   | EUR    | 611.077                      | 0,11             |
| CREDIT SUISSE AG LONDO 0.45 20-25 19/05A | 776.000   | EUR    | 787.714                      | 0,14             |
| DIAGEO FINANCE PLC 0.125 19-23 12/10A    | 1.500.000 | EUR    | 1.512.600                    | 0,28             |
| GLAXOSMITHKLINE 0.1250 20-23 12/05A      | 1.631.000 | EUR    | 1.645.133                    | 0,30             |
| HSBC HOLDINGS PLC 4.00 21-99 31/12S      | 1.761.000 | USD    | 1.514.409                    | 0,28             |
| NATWEST MARKETS PLC 0.125 21-26 18/06A   | 1.617.000 | EUR    | 1.611.292                    | 0,30             |
| STANDARD CHARTERED 0.991 21-25 12/01S    | 1.500.000 | USD    | 1.262.187                    | 0,23             |
| VODAFONE GROUP 3.1 18-79 03/01A          | 169.000   | EUR    | 176.288                      | 0,03             |
| <b>Rumanía</b>                           |           |        | <b>8.186.686</b>             | <b>1,50</b>      |
| ROMANIA 3.6240 20-30 26/05A              | 6.000.000 | EUR    | 6.951.480                    | 1,27             |
| ROMANIAN GOVT INTL BD 2.0 21-33 14/04A   | 1.242.000 | EUR    | 1.235.206                    | 0,23             |
| <b>Finlandia</b>                         |           |        | <b>7.142.101</b>             | <b>1,31</b>      |
| FINLAND 1.125 18-34 15/04A               | 600.000   | EUR    | 674.169                      | 0,13             |
| FINNVERA 0.50 16-26 13/04A               | 3.535.000 | EUR    | 3.672.423                    | 0,67             |
| KOJAMO OYJ 0.875 21-29 28/05A            | 773.000   | EUR    | 775.679                      | 0,14             |
| OP CORPORATE BANK 0.125 20-24 01/07A     | 2.000.000 | EUR    | 2.019.830                    | 0,37             |
| <b>Canadá</b>                            |           |        | <b>6.722.335</b>             | <b>1,23</b>      |
| BQUE TORONTO DOM. 0.625 18-25 06/06A     | 1.212.000 | EUR    | 1.256.608                    | 0,23             |
| CANADIAN IMPERIAL BAN 0.375 19-24 03/05A | 669.000   | EUR    | 678.577                      | 0,12             |
| CPPIB CAPITAL INC 0.75 19-49 15/07A      | 1.300.000 | EUR    | 1.288.937                    | 0,24             |
| QUEBEC 0.00 19-29 15/10U                 | 1.000.000 | EUR    | 990.500                      | 0,18             |
| ROYAL BANK OF CANADA 0.1250 19-24 23/07A | 1.021.000 | EUR    | 1.029.556                    | 0,19             |
| ROYAL BANK OF CANADA 0.2500 19-24 02/05A | 692.000   | EUR    | 699.878                      | 0,13             |
| TORONTO-DOMINIO 0.3750 19-24 25/04A      | 767.000   | EUR    | 778.279                      | 0,14             |
| <b>Australia</b>                         |           |        | <b>6.364.604</b>             | <b>1,17</b>      |
| AUSNET SERVICES HOLDI 1.50 15-27 26/02A  | 500.000   | EUR    | 538.790                      | 0,10             |
| MACQUARIE GROUP 0.35 20-28 03/03A        | 1.866.000 | EUR    | 1.837.441                    | 0,34             |
| MACQUARIE GROUP LTD 0.95 21-31 21/05A    | 2.000.000 | EUR    | 1.995.030                    | 0,37             |
| NATIONAL AUSTRALIA 0.25 19-24 20/05A     | 1.021.000 | EUR    | 1.035.309                    | 0,19             |
| TELSTRA CORP LTD 1.00 20-30 23/04A       | 918.000   | EUR    | 958.034                      | 0,17             |
| <b>Portugal</b>                          |           |        | <b>5.953.400</b>             | <b>1,09</b>      |
| ENERGIAS DE PORTUGAL 1.70 20-80 20/07A   | 900.000   | EUR    | 906.300                      | 0,16             |
| PORTUGAL 1.95 19-29 15/06A               | 2.700.000 | EUR    | 3.102.962                    | 0,57             |
| PORTUGAL 4.10 15-45 15/02A               | 1.200.000 | EUR    | 1.944.138                    | 0,36             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Noruega</b>                           |           |        | <b>5.315.484</b>             | <b>0,98</b>      |
| DNB BANK ASA 0.05 19-23 14/11A           | 1.783.000 | EUR    | 1.797.585                    | 0,33             |
| KOMMUNALBANKEN AS 0.875 17-27 24/05A     | 1.200.000 | EUR    | 1.272.576                    | 0,24             |
| SANTANDER CONSU 0.1250 20-25 25/02A      | 1.200.000 | EUR    | 1.202.184                    | 0,22             |
| TELENOR ASA 0.00 19-23 25/09U            | 1.037.000 | EUR    | 1.043.139                    | 0,19             |
| <b>Irlanda</b>                           |           |        | <b>4.742.090</b>             | <b>0,87</b>      |
| ABBOTT IRL FINANCING 0.375 19-27 19/11A  | 969.000   | EUR    | 982.755                      | 0,18             |
| FCA BANK S.P.A. 0.125 20-23 16/11A       | 349.000   | EUR    | 350.194                      | 0,07             |
| FCA BANK SPA 0.50 20-23 18/09A           | 552.000   | EUR    | 558.102                      | 0,10             |
| FCA BANK SPA IR 0.0000 21-24 16/04A      | 886.000   | EUR    | 886.155                      | 0,16             |
| KERRY GROUP FIN SERV 0.625 19-29 20/09A  | 818.000   | EUR    | 826.667                      | 0,15             |
| RYANAIR LTD 0.875 21-26 25/05A           | 1.133.000 | EUR    | 1.138.217                    | 0,21             |
| <b>Japón</b>                             |           |        | <b>3.322.528</b>             | <b>0,61</b>      |
| JAPAN FINANCE ORGANI 0.01 21-28 02/02A   | 839.000   | EUR    | 838.731                      | 0,15             |
| MIZUHO FINANCIARIA 1.0200 18-23 11/10A   | 802.000   | EUR    | 823.895                      | 0,15             |
| MIZUHO FINANCIARIA GR 0.214 20-25 07/10A | 429.000   | EUR    | 432.136                      | 0,08             |
| TAKEDA PHARMACEUTICAL 2.25 18-26 21/11A  | 1.111.000 | EUR    | 1.227.766                    | 0,23             |
| <b>México</b>                            |           |        | <b>2.950.080</b>             | <b>0,54</b>      |
| MEXICO 1.45 21-33 25/10S                 | 649.000   | EUR    | 621.210                      | 0,11             |
| MEXICO 3.375 16-31 23/02A                | 2.000.000 | EUR    | 2.328.870                    | 0,43             |
| <b>Nueva Zelanda</b>                     |           |        | <b>1.911.501</b>             | <b>0,35</b>      |
| AUCKLAND COUNCIL 1.00 17-27 19/01A       | 1.800.000 | EUR    | 1.911.501                    | 0,35             |
| <b>Eslovenia</b>                         |           |        | <b>1.858.802</b>             | <b>0,34</b>      |
| SLOVENIA 0.1250 21-31 01/07A             | 1.082.000 | EUR    | 1.081.351                    | 0,20             |
| SLOVENIA 0.275 20-30 17/02A              | 759.000   | EUR    | 777.451                      | 0,14             |
| <b>Emiratos Arabes Unidos</b>            |           |        | <b>1.705.279</b>             | <b>0,31</b>      |
| EMIRATES TELECO 0.3750 21-28 17/05A      | 569.000   | EUR    | 572.929                      | 0,10             |
| EMIRATE TEL CORP GMTN 2.75 14-26 18/06A  | 1.000.000 | EUR    | 1.132.350                    | 0,21             |
| <b>Filipinas</b>                         |           |        | <b>1.507.590</b>             | <b>0,28</b>      |
| PHILIPPINES 0.2500 21-25 28/04A          | 1.500.000 | EUR    | 1.507.590                    | 0,28             |
| <b>Suecia</b>                            |           |        | <b>1.436.953</b>             | <b>0,26</b>      |
| SCANIA CV AB 0.00 20-22 23/11U           | 1.142.000 | EUR    | 1.144.689                    | 0,21             |
| VOLVO TREASURY 0.125 20-24 17/09A        | 290.000   | EUR    | 292.264                      | 0,05             |
| <b>Dinamarca</b>                         |           |        | <b>1.262.119</b>             | <b>0,23</b>      |
| CARLSBERG BREWERIES 0.625 20-30 09/03A   | 1.250.000 | EUR    | 1.262.119                    | 0,23             |
| <b>Suiza</b>                             |           |        | <b>1.224.268</b>             | <b>0,22</b>      |
| CREDIT SUISSE 0.625 21-33 18/01A         | 1.300.000 | EUR    | 1.224.268                    | 0,22             |
| <b>Estonia</b>                           |           |        | <b>1.111.800</b>             | <b>0,20</b>      |
| ESTONIA 0.125 20-30 10/06A               | 1.109.000 | EUR    | 1.111.800                    | 0,20             |
| <b>Indonesia</b>                         |           |        | <b>1.042.380</b>             | <b>0,19</b>      |
| INDONESIA 1.45 19-26 18/06A              | 1.000.000 | EUR    | 1.042.380                    | 0,19             |
| <b>Costa de Marfil</b>                   |           |        | <b>1.019.830</b>             | <b>0,19</b>      |
| BQUE AFRICAINE DEV 0.125 16-26 07/10A    | 1.000.000 | EUR    | 1.019.830                    | 0,19             |
| <b>Serbia</b>                            |           |        | <b>201.878</b>               | <b>0,04</b>      |
| SERBIA 1.5 19-29 26/06A                  | 200.000   | EUR    | 201.878                      | 0,04             |
| <b>Obligaciones convertibles</b>         |           |        | <b>8.528.452</b>             | <b>1,56</b>      |
| <b>Francia</b>                           |           |        | <b>6.696.112</b>             | <b>1,23</b>      |
| EDENRED SA CV 0.00 19-24 06/09U          | 20.000    | EUR    | 1.257.960                    | 0,23             |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE CV 20-26 15/06A    | 10.000    | EUR    | 1.961.565                    | 0,36             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| VEOLIA ENV CV 0.00 19-25 01/01U          | 50.000    | EUR    | 1.612.475                    | 0,30             |
| WORLDLINE SA DIRTY CV 0.00 19-26 30/07U  | 8.000     | EUR    | 913.284                      | 0,17             |
| WORLDLINE SA FRANCE CV 0.00 20-25 30/07U | 7.714     | EUR    | 950.828                      | 0,17             |
| <b>Alemania</b>                          |           |        | <b>1.832.340</b>             | <b>0,33</b>      |
| DEUTSCHE POST AG CV 0.05 17-25 30/06A    | 1.500.000 | EUR    | 1.832.340                    | 0,33             |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>     |           |        | <b>40.540.789</b>            | <b>7,44</b>      |
| <b>Francia</b>                           |           |        | <b>10.311.551</b>            | <b>1,89</b>      |
| AXA SA FL.R 21-41 07/10A                 | 2.400.000 | EUR    | 2.400.804                    | 0,44             |
| CREDIT AGRICOLE ASSUR FL.R 14-XX 14/10A  | 700.000   | EUR    | 800.040                      | 0,15             |
| CREDIT AGRICOLE SA FL.R 20-30 05/06A     | 1.000.000 | EUR    | 1.039.685                    | 0,19             |
| CREDIT MUTUEL ARKEA FL.R 20-29 11/06A    | 900.000   | EUR    | 939.141                      | 0,17             |
| DANONE SA EMTN FL.R 17-XX 23/06A         | 1.000.000 | EUR    | 1.026.925                    | 0,19             |
| EDF FL.R 18-99 04/10A                    | 1.000.000 | EUR    | 1.072.476                    | 0,19             |
| ORANGE SA FL.R 20-49 31/12A              | 1.000.000 | EUR    | 1.023.320                    | 0,19             |
| SUEZ FL.R 19-XX XX/XXA                   | 1.500.000 | EUR    | 1.510.463                    | 0,28             |
| TOTAL SE FL.R 19-XX 04/04A               | 486.000   | EUR    | 498.697                      | 0,09             |
| <b>Alemania</b>                          |           |        | <b>7.655.216</b>             | <b>1,40</b>      |
| ALLIANZ SE FL.R 20-XX XX/XXA             | 400.000   | USD    | 349.373                      | 0,06             |
| GERMANY 0.10 15-26 15/04A                | 5.000.000 | EUR    | 5.872.876                    | 1,08             |
| MERCK KGAA FL.R 19-79 25/06A             | 600.000   | EUR    | 619.863                      | 0,11             |
| MUNICH RE FL.R 20-41 26/05A              | 800.000   | EUR    | 813.104                      | 0,15             |
| <b>Estados Unidos de América</b>         |           |        | <b>6.708.214</b>             | <b>1,23</b>      |
| BANK OF AMERICA CORP FL.R 21-31 22/03A   | 1.172.000 | EUR    | 1.170.154                    | 0,21             |
| BANK OF AMERICA FL.R 19-29 08/08A        | 1.071.000 | EUR    | 1.077.453                    | 0,20             |
| CITIGROUP INC FL.R 18-26 24/07A          | 1.474.000 | EUR    | 1.552.638                    | 0,29             |
| JPMORGAN CHASE & CO FL.R 19-27 11/03A    | 959.000   | EUR    | 999.101                      | 0,18             |
| JPMORGAN CHASE FL.R 17-28 18/05A         | 1.774.000 | EUR    | 1.908.868                    | 0,35             |
| <b>Bélgica</b>                           |           |        | <b>4.553.578</b>             | <b>0,84</b>      |
| AGEAS NV FL.R 19-XX XX/XXA               | 400.000   | EUR    | 426.300                      | 0,08             |
| BELFIUS BANK SA FL.R 18-XX XX/XXS        | 1.800.000 | EUR    | 1.784.286                    | 0,33             |
| ELIA SYSTEM FL.R 18-XX 05/12A            | 1.000.000 | EUR    | 1.055.020                    | 0,19             |
| KBC GROUPE SA FL.R 19-99 31/12S          | 1.200.000 | EUR    | 1.287.972                    | 0,24             |
| <b>Italia</b>                            |           |        | <b>2.986.801</b>             | <b>0,55</b>      |
| INTESA SANPAOLO FL.R 20-49 31/12S        | 710.000   | EUR    | 782.832                      | 0,14             |
| UNICREDIT SPA FL.R 19-25 25/06A          | 422.000   | EUR    | 434.740                      | 0,08             |
| UNICREDIT SPA FL.R 19-29 23/09A          | 688.000   | EUR    | 693.919                      | 0,13             |
| UNICREDIT SPA FL.R 20-32 15/01A          | 1.050.000 | EUR    | 1.075.310                    | 0,20             |
| <b>España</b>                            |           |        | <b>2.655.968</b>             | <b>0,49</b>      |
| BANCO BILBAO VIZCAYA FL.R 19-29 22/02A   | 1.200.000 | EUR    | 1.265.472                    | 0,23             |
| BANCO DE SABADE FL.R 20-27 11/03A        | 900.000   | EUR    | 925.690                      | 0,17             |
| MAPFRE SUB FL.R 17-47 31/03A             | 400.000   | EUR    | 464.806                      | 0,09             |
| <b>Suecia</b>                            |           |        | <b>2.118.514</b>             | <b>0,39</b>      |
| SWEDBANK AB FL.R 21-27 20/05A            | 1.600.000 | EUR    | 1.601.328                    | 0,29             |
| TELIA COMPANY AB FL.R 20-81 11/05A       | 510.000   | EUR    | 517.186                      | 0,10             |
| <b>Países Bajos</b>                      |           |        | <b>2.034.241</b>             | <b>0,37</b>      |
| COOPERATIVE RABOBANK FL.R 18-XX XX/XXS   | 400.000   | EUR    | 440.190                      | 0,08             |
| REPSOL INTL FINANCE FL.R 20-49 31/12A    | 1.200.000 | EUR    | 1.286.887                    | 0,23             |
| TELEFONICA EUROPE BV FL.R 17-XX 07/06M   | 300.000   | EUR    | 307.164                      | 0,06             |
| <b>Suiza</b>                             |           |        | <b>1.330.082</b>             | <b>0,24</b>      |
| CREDIT SUISSE GROUP FL.R 17-25 17/07A    | 1.295.000 | EUR    | 1.330.082                    | 0,24             |

## Candriam Bonds

### Candriam Bonds Euro

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                           | Cantidad | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------------------|----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Reino Unido</b>                                     |          |        | <b>186.624</b>               | <b>0,04</b>      |
| VODAFONE GROUP PLC FL.R 20-80 27/08A                   | 180.000  | EUR    | 186.624                      | 0,04             |
| <b>Organismos de Inversión Colectiva</b>               |          |        | <b>10.038.539</b>            | <b>1,84</b>      |
| <b>Acciones/Participaciones en fondos de inversión</b> |          |        | <b>10.038.539</b>            | <b>1,84</b>      |
| <b>Luxemburgo</b>                                      |          |        | <b>7.858.150</b>             | <b>1,44</b>      |
| CANDRIAM BONDS EURO LONG TERM Z EUR C                  | 25.000   | EUR    | 5.457.750                    | 1,00             |
| CANDRIAM BONDS FLOATING RATE NOTES I EUR C             | 1.600    | EUR    | 2.400.400                    | 0,44             |
| <b>Francia</b>                                         |          |        | <b>2.180.389</b>             | <b>0,40</b>      |
| CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV Z EUR C                       | 1.470    | EUR    | 2.180.389                    | 0,40             |
| <b>Total de la cartera de valores</b>                  |          |        | <b>538.498.375</b>           | <b>98,76</b>     |
| Coste de adquisición                                   |          |        | 525.920.639                  |                  |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

### Distribución geográfica (en % activo neto)

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| Francia                   | 19,91        |
| Italia                    | 16,19        |
| España                    | 10,09        |
| Estados Unidos de América | 9,24         |
| Países Bajos              | 9,23         |
| Alemania                  | 7,81         |
| Bélgica                   | 5,70         |
| Luxemburgo                | 3,84         |
| Austria                   | 2,50         |
| Reino Unido               | 1,71         |
| Rumanía                   | 1,50         |
| Finlandia                 | 1,31         |
| Canadá                    | 1,23         |
| Australia                 | 1,17         |
| Portugal                  | 1,09         |
| Noruega                   | 0,97         |
| Irlanda                   | 0,87         |
| Suecia                    | 0,65         |
| Japón                     | 0,61         |
| México                    | 0,54         |
| Suiza                     | 0,47         |
| Nueva Zelanda             | 0,35         |
| Eslovenia                 | 0,34         |
| Emiratos Arabes Unidos    | 0,31         |
| Filipinas                 | 0,28         |
| Dinamarca                 | 0,23         |
| Estonia                   | 0,20         |
| Indonesia                 | 0,19         |
| Costa de Marfil           | 0,19         |
| Serbia                    | 0,04         |
|                           | <b>98,76</b> |

### Distribución económica (en % activo neto)

|                                                                |              |
|----------------------------------------------------------------|--------------|
| Obligaciones del Estado, de las provincias y de los municipios | 43,04        |
| Bancos y otras entidades financieras                           | 16,52        |
| Holdings y entidades financieras                               | 9,79         |
| Energía y servicio de aguas                                    | 2,75         |
| Telecomunicaciones                                             | 2,33         |
| Farmacia y cosméticos                                          | 2,32         |
| Organizaciones supranacionales                                 | 2,21         |
| Seguros                                                        | 2,03         |
| Fondos de inversión                                            | 1,84         |
| Transporte                                                     | 1,60         |
| Servicios varios                                               | 1,52         |
| Industrias agro-alimentarias                                   | 1,47         |
| Petróleo                                                       | 1,39         |
| Electrónica y semiconductores                                  | 1,39         |
| Bienes de consumo diversos                                     | 0,97         |
| Comercio minorista y grandes almacenes                         | 0,95         |
| Electrotecnia y electrónica                                    | 0,88         |
| Instituciones inclasificables / no clasificadas                | 0,85         |
| Sociedades inmobiliarias                                       | 0,76         |
| Internet y servicios de Internet                               | 0,68         |
| Industria automovilística                                      | 0,61         |
| Tabaco y alcohol                                               | 0,58         |
| Textiles y vestido                                             | 0,55         |
| Construcción, material de construcción                         | 0,45         |
| Restaurantes, hoteles                                          | 0,37         |
| Varios                                                         | 0,36         |
| Construcción de máquinas y aparatos                            | 0,28         |
| Artículos de oficina y ordenadores                             | 0,18         |
| Química                                                        | 0,09         |
|                                                                | <b>98,76</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Corporate

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |           |        | <b>723.973.507</b>           | <b>80,90</b>     |
| <b>Acciones</b>                                                                                                                 |           |        | <b>1.325.070</b>             | <b>0,15</b>      |
| <b>España</b>                                                                                                                   |           |        | <b>1.325.070</b>             | <b>0,15</b>      |
| ABERTIS INFRASTRUCT 2.375 19-27 27/09A                                                                                          | 1.200.000 | EUR    | 1.325.070                    | 0,15             |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |           |        | <b>529.888.372</b>           | <b>59,21</b>     |
| <b>Estados Unidos de América</b>                                                                                                |           |        | <b>133.488.325</b>           | <b>14,92</b>     |
| AMERICAN TOWER 0.5000 20-28 15/01A                                                                                              | 2.638.000 | EUR    | 2.617.041                    | 0,29             |
| AT&T INC 0.25 19-26 04/03A                                                                                                      | 3.423.000 | EUR    | 3.443.880                    | 0,39             |
| AT&T INC 0.8000 19-30 04/03A                                                                                                    | 2.333.000 | EUR    | 2.353.577                    | 0,26             |
| AT&T INC 1.6000 20-28 19/05A                                                                                                    | 6.375.000 | EUR    | 6.841.427                    | 0,76             |
| AT&T INC 2.45 15-35 15/03S                                                                                                      | 500.000   | EUR    | 564.078                      | 0,06             |
| AT&T INC 2.60 14-29 17/12A                                                                                                      | 1.378.000 | EUR    | 1.594.918                    | 0,18             |
| BECTON DICKINSON 1.9570 21-31 11/02S                                                                                            | 2.500.000 | USD    | 2.054.726                    | 0,23             |
| BOSTON SCIENTIFIC 0.6250 19-27 01/12A                                                                                           | 7.000.000 | EUR    | 7.109.165                    | 0,79             |
| BP CAP MARKETS 1.7490 20-30 10/08S                                                                                              | 999.000   | USD    | 822.139                      | 0,09             |
| COMCAST CORP 0.7500 20-32 20/02A                                                                                                | 1.000.000 | EUR    | 1.005.445                    | 0,11             |
| CYRUSONE LP/CYR 2.1500 20-30 01/11S                                                                                             | 1.041.000 | USD    | 836.632                      | 0,09             |
| DANAHER CORP 2.5 20-30 30/03A                                                                                                   | 300.000   | EUR    | 348.605                      | 0,04             |
| DEUTSCHE BANK AG NY 3.729 21-32 14/01S                                                                                          | 3.649.000 | USD    | 3.138.606                    | 0,35             |
| DIGITAL EURO FINCO 1.125 19-28 09/10A                                                                                           | 1.510.000 | EUR    | 1.562.699                    | 0,18             |
| DIGITAL EURO FINCO 2.5 19-26 16/01A                                                                                             | 800.000   | EUR    | 879.588                      | 0,10             |
| EQUINIX INC 0.2500 21-27 15/03A                                                                                                 | 1.000.000 | EUR    | 993.920                      | 0,11             |
| FEDEX 0.95 21-33 04/05A                                                                                                         | 3.000.000 | EUR    | 2.983.035                    | 0,33             |
| FIDELITY NATIONAL INF 1.5 19-27 21/05A                                                                                          | 2.286.000 | EUR    | 2.428.143                    | 0,27             |
| FIDELITY NATL I 0.6250 19-25 03/12A                                                                                             | 2.200.000 | EUR    | 2.248.950                    | 0,25             |
| FIDEL NATL INFO SERV 1.00 19-28 03/12A                                                                                          | 5.000.000 | EUR    | 5.149.100                    | 0,58             |
| FISERV INC 1.125 19-27 01/07A                                                                                                   | 1.098.000 | EUR    | 1.147.964                    | 0,13             |
| FRESENIUS MED CARE US F 3.0 21-31 01/12S                                                                                        | 3.000.000 | USD    | 2.582.140                    | 0,29             |
| GE CAPITAL FUNDING 4.4 21-30 15/05S                                                                                             | 1.000.000 | USD    | 983.253                      | 0,11             |
| GENERAL ELECTRIC CO 0.875 17-25 17/05A                                                                                          | 3.000.000 | EUR    | 3.084.030                    | 0,34             |
| GENERAL ELECTRIC CO 4.125 05-35 19/09A                                                                                          | 1.700.000 | EUR    | 2.306.943                    | 0,26             |
| GENERAL MOTORS 0.6000 21-27 20/05A                                                                                              | 2.324.000 | EUR    | 2.317.330                    | 0,26             |
| GOLDMAN SACHS GROUP 0.25 21-28 26/01A                                                                                           | 5.000.000 | EUR    | 4.915.600                    | 0,55             |
| GOLDMAN SACHS GROUP 2.0 18-28 01/11A                                                                                            | 2.000.000 | EUR    | 2.210.380                    | 0,25             |
| IBM CORP 0.3 20-21 11/02A                                                                                                       | 5.247.000 | EUR    | 5.266.781                    | 0,59             |
| IBM CORP 0.65 20-32 11/02A                                                                                                      | 4.000.000 | EUR    | 3.992.640                    | 0,45             |
| IQVIA INC 2.25 19-28 15/01A                                                                                                     | 4.510.000 | EUR    | 4.546.851                    | 0,51             |
| IQVIA INC 2.8750 20-28 15/06S                                                                                                   | 2.000.000 | EUR    | 2.064.670                    | 0,23             |
| KRAFT HEINZ FOODS 2.25 16-28 25/05A                                                                                             | 1.000.000 | EUR    | 1.090.000                    | 0,12             |
| KRAFT HEINZ FOODS 4.25 20-31 01/03S                                                                                             | 1.000.000 | USD    | 959.857                      | 0,11             |
| KRAFT HEINZ FOODS 4.6250 18-29 30/01S                                                                                           | 3.000.000 | USD    | 2.947.095                    | 0,33             |
| KRAFT HEINZ FOODS CO 3.875 21-27 15/05S                                                                                         | 3.000.000 | USD    | 2.774.612                    | 0,31             |
| MONDELEZ INTL 1.625 15-27 08/03A                                                                                                | 2.700.000 | EUR    | 2.910.614                    | 0,33             |
| MORGAN STANLEY 1.375 16-26 27/10                                                                                                | 1.658.000 | EUR    | 1.761.467                    | 0,20             |
| NETFLIX INC 3.6250 19-30 15/06S                                                                                                 | 3.500.000 | EUR    | 4.169.393                    | 0,47             |
| PROLOGIS EURO FINANCE 0.375 20-28 06/02A                                                                                        | 800.000   | EUR    | 807.460                      | 0,09             |
| PROLOGIS LP 1.625 20-32 17/06A                                                                                                  | 1.755.000 | EUR    | 1.900.814                    | 0,21             |
| SODEXO INC 2.718 21-31 16/04S                                                                                                   | 4.500.000 | USD    | 3.859.796                    | 0,43             |
| THERMO FISHER SCIENT 0.50 19-28 01/03A                                                                                          | 5.000.000 | EUR    | 5.058.350                    | 0,57             |
| THERMO FISHER SCIENT 1.75 20-27 15/04A                                                                                          | 2.400.000 | EUR    | 2.611.716                    | 0,29             |
| VERIZON COMMUNICATION 0.875 19-27 08/04A                                                                                        | 3.019.000 | EUR    | 3.125.118                    | 0,35             |
| VERIZON COMMUNICATION 1.375 17-26 27/10A                                                                                        | 5.000.000 | EUR    | 5.318.675                    | 0,59             |
| VERIZON COMMUNICATION 1.875 17-29 26/10A                                                                                        | 3.500.000 | EUR    | 3.880.765                    | 0,43             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Corporate

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| VF CORP 0.25 20-28 25/02A                   | 1.444.000 | EUR    | 1.435.849                    | 0,16             |
| WELLS FARGO 0.625 20-30 14/08A              | 2.000.000 | EUR    | 1.979.900                    | 0,22             |
| ZIMMER BIOMET 1.164 19-27 15/11A            | 2.400.000 | EUR    | 2.502.588                    | 0,28             |
| <b>Francia</b>                              |           |        | <b>127.626.946</b>           | <b>14,26</b>     |
| AEROPORTS DE PA 1.0000 20-29 05/01A         | 5.800.000 | EUR    | 6.092.262                    | 0,68             |
| AUCHAN HOLDING SA 3.2500 20-27 23/07A       | 2.000.000 | EUR    | 2.322.900                    | 0,26             |
| BFCM 1.25 20-30 03/06A                      | 5.200.000 | EUR    | 5.455.658                    | 0,61             |
| BFCM 1.75 19-29 15/03A                      | 1.200.000 | EUR    | 1.307.244                    | 0,15             |
| BNP PARIBAS 1.125 20-29 17/04A              | 2.400.000 | EUR    | 2.485.356                    | 0,28             |
| BNP PARIBAS 1.625 19-31 02/07A              | 1.500.000 | EUR    | 1.568.168                    | 0,18             |
| BNP PARIBAS FL.R 19-27 23/01A               | 3.000.000 | EUR    | 3.239.280                    | 0,36             |
| BPCE 0.625 19-24 26/09A                     | 1.900.000 | EUR    | 1.937.848                    | 0,22             |
| BPCE S.A 1.0 19-25 01/04A                   | 3.400.000 | EUR    | 3.516.552                    | 0,39             |
| CAPGEMINI SE 1.125 20-30 23/06A             | 3.300.000 | EUR    | 3.483.661                    | 0,39             |
| CAPGEMINI SE 2.0 20-29 15/04A               | 200.000   | EUR    | 225.224                      | 0,03             |
| CARMILA 1.625 20-27 30/05A                  | 2.400.000 | EUR    | 2.459.220                    | 0,27             |
| CARREFOUR SA 2.625 20-27 15/12A             | 4.000.000 | EUR    | 4.598.520                    | 0,51             |
| COMPAGNIE FIN ET IND 1.0000 20-31 19/05A    | 6.000.000 | EUR    | 6.335.580                    | 0,71             |
| COVIVIO 1.6250 20-30 23/06A                 | 2.400.000 | EUR    | 2.589.672                    | 0,29             |
| CREDIT AGRICOLE 0.125 20-27 09/12A          | 2.700.000 | EUR    | 2.653.762                    | 0,30             |
| CREDIT AGRICOLE ASSURANCE 2.00 20-30 17/07A | 3.000.000 | EUR    | 3.148.245                    | 0,35             |
| CREDIT AGRICOLE SA 2.3 16-26 24/10Q         | 500.000   | EUR    | 539.223                      | 0,06             |
| CREDIT MUTUEL ARKEA 0.875 20-27 07/05A      | 4.000.000 | EUR    | 4.156.520                    | 0,46             |
| ELECT.DE FRANCE EMTN 5.625 03-33 21/02A     | 1.400.000 | EUR    | 2.168.838                    | 0,24             |
| ENGIE SA 0.5 19-30 24/10A                   | 1.000.000 | EUR    | 1.007.210                    | 0,11             |
| ENGIE SA 1.75 20-28 27/03A                  | 2.000.000 | EUR    | 2.200.570                    | 0,25             |
| ENGIE SA 1.875 18-33 19/09A                 | 1.900.000 | EUR    | 2.156.557                    | 0,24             |
| FAURECIA 2.625 18-25 15/06S                 | 2.000.000 | EUR    | 2.028.388                    | 0,23             |
| FAURECIA 3.7500 20-28 15/06S                | 2.500.000 | EUR    | 2.637.465                    | 0,29             |
| GROUPAMA SA SUB 6.00 17-27 23/01A           | 1.500.000 | EUR    | 1.889.738                    | 0,21             |
| ICADE SA 0.6250 21-31 18/01A                | 2.200.000 | EUR    | 2.148.795                    | 0,24             |
| ICADE SA 1.625 18-28 28/02A                 | 1.000.000 | EUR    | 1.075.090                    | 0,12             |
| ICADE SANTE SAS 0.875 19-29 04/11A          | 2.000.000 | EUR    | 2.020.340                    | 0,23             |
| ICADE SANTE SAS 1.375 20-30 17/09A          | 500.000   | EUR    | 525.662                      | 0,06             |
| IMERYS SA 1.50 17-27 15/01A                 | 1.100.000 | EUR    | 1.164.168                    | 0,13             |
| KLEPIERRE SA 0.8750 20-31 17/02A            | 3.600.000 | EUR    | 3.658.392                    | 0,41             |
| LA MONDIALE 2.1250 20-31 23/06A             | 1.000.000 | EUR    | 1.050.860                    | 0,12             |
| LEGRAND SA 0.75 20-30 05/20A                | 3.700.000 | EUR    | 3.859.230                    | 0,43             |
| MUTUELLE AS 21-49 31/12S                    | 600.000   | EUR    | 604.461                      | 0,07             |
| MUTUELLE ASSURA 2.1250 21-52 21/06A         | 900.000   | EUR    | 908.969                      | 0,10             |
| ORANGE SA 1.625 20-32 07/04A                | 1.300.000 | EUR    | 1.448.675                    | 0,16             |
| ORANGE SA 1.875 18-30 12/09A                | 2.500.000 | EUR    | 2.835.688                    | 0,32             |
| PEUGEOT SA 2 18-25 20/03A                   | 2.000.000 | EUR    | 2.127.650                    | 0,24             |
| RCI BANQUE SA 1.75 19-26 10/04A             | 2.000.000 | EUR    | 2.124.110                    | 0,24             |
| RENAULT SA 2 19-24 11/07A                   | 671.000   | EUR    | 706.798                      | 0,08             |
| SOCIETE GENERALE 0.7500 20-27 25/01A        | 1.100.000 | EUR    | 1.113.343                    | 0,12             |
| SOCIETE GENERALE 1.25 20-30 12/06A          | 4.000.000 | EUR    | 4.131.140                    | 0,46             |
| SOCIETE GENERALE 1.4880 20-26 14/12S        | 2.000.000 | USD    | 1.673.134                    | 0,19             |
| STE FONCIERE LYONNAISE 1.50 20-27 05/06A    | 2.300.000 | EUR    | 2.453.329                    | 0,27             |
| SUEZ 1.2500 20-27 02/04A                    | 5.600.000 | EUR    | 5.947.872                    | 0,66             |
| TOTAL CAPITAL I 1.9940 20-32 08/04A         | 2.100.000 | EUR    | 2.430.466                    | 0,27             |
| TOTAL CAPITAL INTERN 1.491 18-30 04/09A     | 1.000.000 | EUR    | 1.103.195                    | 0,12             |
| TOTAL CAPITAL INTL 0.952 20-31 18/05A       | 2.800.000 | EUR    | 2.953.370                    | 0,33             |
| TOTAL SE FL.R 16-XX 05/05A                  | 3.000.000 | EUR    | 3.126.705                    | 0,35             |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT 0.8 20-32 15/01A       | 3.400.000 | EUR    | 3.437.298                    | 0,38             |
| VINCI SA 1.7500 18-30 26/09A                | 700.000   | EUR    | 794.545                      | 0,09             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Corporate

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                               | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Países Bajos</b>                        |            |        | <b>71.284.001</b>            | <b>7,97</b>      |
| ABERTIS FINANCE BV 2.625 21-49 31/12A      | 2.000.000  | EUR    | 1.986.000                    | 0,22             |
| ABN AMRO BANK N 0.6000 20-27 15/01A        | 4.500.000  | EUR    | 4.571.122                    | 0,51             |
| ASML HOLDING NV 0.6250 20-29 07/05A        | 2.000.000  | EUR    | 2.064.030                    | 0,23             |
| BMW FINANCE NV 0.2000 21-33 11/01A         | 1.678.000  | EUR    | 1.617.634                    | 0,18             |
| BMW FINANCE NV 1.5000 19-29 06/02A         | 4.095.000  | EUR    | 4.495.962                    | 0,50             |
| BP CAPITAL MARK 0.9330 20-40 04/12A        | 1.956.000  | EUR    | 1.822.757                    | 0,20             |
| COOPERATIEVE RA 3.1000 21-XX XX/XXS        | 1.000.000  | EUR    | 1.013.430                    | 0,11             |
| DEUT TELEKOM INTL FIN 3.60 17-27 19/01S    | 4.500.000  | USD    | 4.178.599                    | 0,47             |
| DIGITAL DUTCH F 1.0000 20-32 15/01A        | 1.280.000  | EUR    | 1.270.144                    | 0,14             |
| DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.25 20-31 01/02A   | 1.000.000  | EUR    | 1.023.390                    | 0,12             |
| EDP FINANCE 0.3750 19-26 16/09A            | 2.300.000  | EUR    | 2.325.714                    | 0,26             |
| ENEL FINANCE IN 0.00 21-27 17/06A          | 2.800.000  | EUR    | 2.768.542                    | 0,31             |
| ENEL FIN INTL 1.125 19-34 17/10A           | 1.000.000  | EUR    | 1.047.150                    | 0,12             |
| EON INTL FINAN BV 1.50 18-29 31/07A        | 2.000.000  | EUR    | 2.175.490                    | 0,24             |
| ING GROEP NV FL.R 20-29 18/02A             | 1.700.000  | EUR    | 1.667.301                    | 0,19             |
| PROSUS NV 1.539 20-28 03/08A               | 3.508.000  | EUR    | 3.634.709                    | 0,41             |
| PROSUS NV 2.031 20-32 03/08A               | 3.463.000  | EUR    | 3.567.773                    | 0,40             |
| RELX FINANCE BV 1.50 18-27 13/05A          | 1.000.000  | EUR    | 1.075.310                    | 0,12             |
| SCHLUMBERGER FINANCE 0.25 19-27 15/10A     | 2.389.000  | EUR    | 2.392.428                    | 0,27             |
| STELLANTIS NV 0.625 21-27 30/03A           | 1.700.000  | EUR    | 1.708.934                    | 0,19             |
| TELEFONICA EUROPE BV 2.376 21-99 31/12A    | 6.800.000  | EUR    | 6.658.451                    | 0,74             |
| TENNET HOLDING 0.1250 20-32 30/11A         | 1.346.000  | EUR    | 1.282.704                    | 0,14             |
| UPJOHN FINANCE 1.9080 20-32 23/06A         | 3.708.000  | EUR    | 3.951.393                    | 0,44             |
| UPJOHN FINANCE BV 1.362 20-27 23/06A       | 6.000.000  | EUR    | 6.287.490                    | 0,70             |
| VONOVIA FINANCE 0.5000 19-29 14/09A        | 2.300.000  | EUR    | 2.294.158                    | 0,26             |
| VONOVIA FINANCE BV 0.625 19-27 07/10A      | 500.000    | EUR    | 508.865                      | 0,06             |
| WINTERSHALL DEA FINA 3.5 21-99 31/12A      | 900.000    | EUR    | 887.850                      | 0,10             |
| WOLTERS KLUWER NV 0.75 20-30 03/07A        | 1.632.000  | EUR    | 1.669.569                    | 0,19             |
| ZF EUROPE FINANCE BV 2.5 19-27 23/10A      | 1.300.000  | EUR    | 1.337.102                    | 0,15             |
| <b>Italia</b>                              |            |        | <b>47.630.422</b>            | <b>5,32</b>      |
| ACEA SPA 0.5000 20-29 06/04A               | 4.401.000  | EUR    | 4.378.951                    | 0,49             |
| ACEA SPA 1 16-26 24/10A                    | 2.500.000  | EUR    | 2.599.525                    | 0,29             |
| AEROPORTI DI ROMA SPA 1.625 17-27 08/06A   | 386.000    | EUR    | 407.234                      | 0,05             |
| AEROPORTI DI ROMA SPA 1.625 20-29 02/02A   | 2.443.000  | EUR    | 2.575.887                    | 0,29             |
| AEROPORTI DI ROMA SPA 1.75 21-31 30/07A    | 1.975.000  | EUR    | 2.061.357                    | 0,23             |
| ASSICURAZIONI GENERALI 1.7130 21-32 30/06A | 1.838.000  | EUR    | 1.840.656                    | 0,21             |
| ASSICURAZIONI GENERALI 2.429 20-31 14/07A  | 1.039.000  | EUR    | 1.121.180                    | 0,13             |
| AUTOSTRADA ITALIA SPA 2.000 21-30 15/01A   | 3.970.000  | EUR    | 4.111.280                    | 0,46             |
| AUTOSTRADA PER L'ITAL 2.65 20-28 08/03A    | 4.500.000  | EUR    | 4.696.137                    | 0,52             |
| INFRASTRUTTURE 1.7500 21-31 19/04A         | 2.700.000  | EUR    | 2.697.654                    | 0,30             |
| INTESA SANPAOLO 0.6250 21-26 24/02A        | 2.000.000  | EUR    | 1.999.116                    | 0,22             |
| INTESA SANPAOLO 0.75 19-24 04/12A          | 1.600.000  | EUR    | 1.641.448                    | 0,18             |
| INTESA SANPAOLO 1.0000 19-24 04/07A        | 1.468.000  | EUR    | 1.512.121                    | 0,17             |
| INTESA SANPAOLO 1.75 19-29 04/07A          | 2.183.000  | EUR    | 2.340.460                    | 0,26             |
| INTESA SANPAOLO 2.1250 20-25 26/05A        | 3.810.000  | EUR    | 4.093.293                    | 0,46             |
| MEDIOBANCA 0.875 19-26 15/01A              | 1.481.000  | EUR    | 1.518.143                    | 0,17             |
| MEDIOBANCA - BANCA 1.00 20-27 08/09A       | 1.500.000  | EUR    | 1.547.070                    | 0,17             |
| NEXI SPA 1.6250 21-26 30/04S               | 2.300.000  | EUR    | 2.292.720                    | 0,26             |
| TRANSMISSIONE ELETTRI 0.375 21-29 23/06A   | 1.200.000  | EUR    | 1.200.210                    | 0,13             |
| UNICREDIT SPA 0.3250 21-26 19/01A          | 3.000.000  | EUR    | 2.995.980                    | 0,33             |
| <b>Alemania</b>                            |            |        | <b>41.127.291</b>            | <b>4,60</b>      |
| CECONOMY AG 1.75 21-26 24/06A              | 3.500.000  | EUR    | 3.479.420                    | 0,39             |
| COMMERZBANK AG 1.1250 19-26 22/06A         | 2.200.000  | EUR    | 2.274.382                    | 0,25             |
| DAIMLER AG 2.0000 20-26 22/08A             | 10.480.000 | EUR    | 11.531.458                   | 1,29             |
| DEUTSCHE BAHN FINANCE 0.625 21-36 15/04A   | 3.500.000  | EUR    | 3.418.993                    | 0,38             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Corporate

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                              | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|-------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| DEUTSCHE BANK A 0.7500 21-27 17/02A       | 2.000.000 | EUR    | 2.013.870                    | 0,23             |
| FRESENIUS MEDICAL CARE 1.0 20-26 29/05A   | 2.815.000 | EUR    | 2.929.148                    | 0,33             |
| FRESENIUS SE & CO. KG 0.75 20-28 15/01A   | 3.813.000 | EUR    | 3.890.823                    | 0,43             |
| FRESENIUS SE & CO KGA 1.625 20-27 08/10A  | 1.500.000 | EUR    | 1.615.478                    | 0,18             |
| INFINEON TECHNO 1.1250 20-26 24/06A       | 1.800.000 | EUR    | 1.881.909                    | 0,21             |
| INFINEON TECHNOLOGIES 1.625 20-29 24/06A  | 1.000.000 | EUR    | 1.078.050                    | 0,12             |
| SCHAEFFLER AG 2.75 20-25 12/10A           | 3.500.000 | EUR    | 3.745.000                    | 0,42             |
| VONOVIA SE 0.6250 21-29 14/12A            | 1.600.000 | EUR    | 1.602.896                    | 0,18             |
| ZF FINANCE GMBH 2.75 20-27 25/05A         | 1.600.000 | EUR    | 1.665.864                    | 0,19             |
| <b>Reino Unido</b>                        |           |        | <b>19.718.903</b>            | <b>2,20</b>      |
| COCA-COLA EUROPEAN 1.1250 19-29 12/04A    | 1.272.000 | EUR    | 1.337.699                    | 0,15             |
| CREDIT AGRICOLE SA 1.75 19-29 05/03A      | 600.000   | EUR    | 652.995                      | 0,07             |
| DS SMITH PLC 0.8750 19-26 12/09A          | 2.870.000 | EUR    | 2.935.723                    | 0,33             |
| DS SMITH PLC 1.375 17-24 26/07A           | 5.970.000 | EUR    | 6.191.756                    | 0,69             |
| UBS AG LONDON 0.01 21-26 29/06A           | 2.250.000 | EUR    | 2.248.841                    | 0,25             |
| VODAFONE GROUP 1.60 16-31 29/07A          | 3.366.000 | EUR    | 3.663.756                    | 0,41             |
| VODAFONE GROUP 3.1 18-79 03/01A           | 2.577.000 | EUR    | 2.688.133                    | 0,30             |
| <b>España</b>                             |           |        | <b>19.197.690</b>            | <b>2,15</b>      |
| ABERTIS INFRAES 2.2500 20-29 29/03A       | 1.000.000 | EUR    | 1.097.935                    | 0,12             |
| BANCO BILBAO VIZCAYA 1.00 19-26 21/06A    | 2.300.000 | EUR    | 2.394.611                    | 0,27             |
| BANCO BILBAO VIZCAYA AR 0.5 20-27 14/01A  | 3.500.000 | EUR    | 3.524.097                    | 0,39             |
| BANCO DE SABADELL SA 2.5 21-31 15/04A     | 800.000   | EUR    | 806.608                      | 0,09             |
| BANCO SANTANDER 1.125 18-25 17/01A        | 2.400.000 | EUR    | 2.483.760                    | 0,28             |
| BANCO SANTANDER 1.3750 20-26 05/01A       | 2.600.000 | EUR    | 2.727.231                    | 0,31             |
| BANCO SANTANDER SA 1.0 21-27 11/02Q       | 2.700.000 | EUR    | 2.679.858                    | 0,30             |
| CAIXABANK SA 0.50 21-29 09/02A            | 1.500.000 | EUR    | 1.478.940                    | 0,17             |
| CELLNEX FINANCE CO SA 1.5 21-28 08/06A    | 2.000.000 | EUR    | 2.004.650                    | 0,22             |
| <b>Bélgica</b>                            |           |        | <b>18.508.712</b>            | <b>2,07</b>      |
| ANHEUSER-BUSCH INB 2.00 16-28 17/03A      | 3.036.000 | EUR    | 3.395.690                    | 0,38             |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV 2.875 20-32 02/04A   | 5.500.000 | EUR    | 6.698.285                    | 0,75             |
| BELFIUS BANQUE SA/NV 0.00 19-26 28/08U    | 2.600.000 | EUR    | 2.589.730                    | 0,29             |
| COFINIMMO SA 0.875 20-30 02/12A           | 900.000   | EUR    | 904.014                      | 0,10             |
| COFINIMMO SA 1.929 15-22 25/03A           | 2.900.000 | EUR    | 2.959.015                    | 0,33             |
| ELIA TRANSMISSION BEL 0.875 20-30 28/04A  | 1.900.000 | EUR    | 1.961.978                    | 0,22             |
| <b>Luxemburgo</b>                         |           |        | <b>12.453.743</b>            | <b>1,39</b>      |
| DH EUROPE FIN 0.45 19-28 18/03A           | 2.992.000 | EUR    | 3.018.479                    | 0,34             |
| DH EUROPE FIN 0.75 19-31 18/09A           | 4.074.000 | EUR    | 4.082.331                    | 0,46             |
| MEDTRONIC GLOBAL 0.7500 20-32 15/10A      | 5.000.000 | EUR    | 5.040.475                    | 0,56             |
| MEDTRONIC GLOBAL HOLD 1.00 19-31 02/07A   | 300.000   | EUR    | 312.458                      | 0,03             |
| <b>Japón</b>                              |           |        | <b>10.756.920</b>            | <b>1,20</b>      |
| SOFTBANK GROUP 3.125 17-25 19/09S         | 1.000.000 | EUR    | 1.033.335                    | 0,12             |
| SOFTBANK GROUP 4.0000 18-23 20/04S        | 3.000.000 | EUR    | 3.129.840                    | 0,35             |
| TAKEDA PHARMACEUTICAL 0.7500 20-27 09/07A | 3.158.000 | EUR    | 3.238.608                    | 0,36             |
| TAKEDA PHARMACEUTICAL 1.0000 20-29 09/07A | 3.250.000 | EUR    | 3.355.137                    | 0,37             |
| <b>Austria</b>                            |           |        | <b>6.511.774</b>             | <b>0,73</b>      |
| OMV AG 0.750 20-30 16/06A                 | 2.300.000 | EUR    | 2.366.114                    | 0,26             |
| OMV AG 2.0 20-28 09/04A                   | 3.176.000 | EUR    | 3.555.278                    | 0,40             |
| OMV AG 2.375 20-32 09/04A                 | 500.000   | EUR    | 590.382                      | 0,07             |
| <b>Suecia</b>                             |           |        | <b>6.428.663</b>             | <b>0,72</b>      |
| FASTIGHETS AB BALDER 1.0 21-29 20/01A     | 3.500.000 | EUR    | 3.449.408                    | 0,39             |
| SAMHALLSBYGGNAD 2.8750 21-49 31/12A       | 3.000.000 | EUR    | 2.979.255                    | 0,33             |
| <b>Irlanda</b>                            |           |        | <b>5.681.134</b>             | <b>0,63</b>      |
| FRESENIUS FINANCE IRL 0.875 21-31 01/10A  | 1.500.000 | EUR    | 1.495.852                    | 0,16             |
| SMURFIT KAPPA TREA 1.50 19-27 15/09S      | 3.950.000 | EUR    | 4.185.282                    | 0,47             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Corporate

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Portugal</b>                          |           |        | <b>3.874.014</b>             | <b>0,43</b>      |
| ENERGIAS DE PORTUGAL 1.6250 20-27 15/04A | 3.600.000 | EUR    | 3.874.014                    | 0,43             |
| <b>Finlandia</b>                         |           |        | <b>2.372.566</b>             | <b>0,26</b>      |
| NOKIA OYJ 2.00 19-26 11/03A              | 2.244.000 | EUR    | 2.372.566                    | 0,26             |
| <b>Noruega</b>                           |           |        | <b>1.673.823</b>             | <b>0,19</b>      |
| EQUINOR ASA 1.375 20-32 22/05A           | 1.546.000 | EUR    | 1.673.823                    | 0,19             |
| <b>Islas Caimán</b>                      |           |        | <b>1.553.445</b>             | <b>0,17</b>      |
| CK HUTCHISON GR 1.1250 19-28 17/10A      | 1.500.000 | EUR    | 1.553.445                    | 0,17             |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>     |           |        | <b>192.760.065</b>           | <b>21,54</b>     |
| <b>Francia</b>                           |           |        | <b>57.738.015</b>            | <b>6,45</b>      |
| AXA SA FL.R 14-XX 07/11A                 | 2.189.000 | EUR    | 2.430.666                    | 0,27             |
| BNP PARIBAS CARDIF FL.R 4.032 14-XX 25   | 1.000.000 | EUR    | 1.132.415                    | 0,13             |
| BNP PARIBAS FL.R 19-25 15/07A            | 1.600.000 | EUR    | 1.621.680                    | 0,18             |
| BNP PARIBAS FL.R 20-27 14/10A            | 2.300.000 | EUR    | 2.304.393                    | 0,26             |
| BNP PARIBAS FL.R 20-32 15/01A            | 2.400.000 | EUR    | 2.423.304                    | 0,27             |
| CREDIT AGRICOLE SA FL.R 20-26 22/04A     | 8.300.000 | EUR    | 8.568.629                    | 0,96             |
| CREDIT MUTUEL ARKEA FL.R 17-29 25/10A    | 1.500.000 | EUR    | 1.567.365                    | 0,17             |
| CREDIT MUTUEL ARKEA FL.R 20-29 11/06A    | 3.000.000 | EUR    | 3.130.470                    | 0,35             |
| DANONE SA EMTN FL.R 17-XX 23/06A         | 4.500.000 | EUR    | 4.621.163                    | 0,52             |
| EDF FL.R 18-99 04/10A                    | 4.000.000 | EUR    | 4.289.904                    | 0,48             |
| EDF SA FL.R 13-XX 29/01A                 | 1.000.000 | EUR    | 1.124.230                    | 0,13             |
| ELECT.DE FRANCE SUB FL.R 14-XX 22/01A    | 1.200.000 | EUR    | 1.350.000                    | 0,15             |
| ELECTRICITE DE FL.R 20-XX XX/XXA         | 3.400.000 | EUR    | 3.511.296                    | 0,39             |
| LA BANQUE POSTALE FL.R 20-26 17.06A      | 6.900.000 | EUR    | 6.987.837                    | 0,78             |
| LA BANQUE POSTALE FL.R 20-31 26/01A      | 1.600.000 | EUR    | 1.605.360                    | 0,18             |
| LA MONDIALE REGS SUB FL.R 14-XX 17/12A   | 1.000.000 | EUR    | 1.165.505                    | 0,13             |
| SG 0.50 21-29 12/06A                     | 2.500.000 | EUR    | 2.448.212                    | 0,27             |
| SOCIETE GENERALE FL.R 20-30 24/11A       | 1.000.000 | EUR    | 999.850                      | 0,11             |
| SOGECAP SA FL.R 14-49 29/12A             | 1.200.000 | EUR    | 1.358.796                    | 0,15             |
| TOTAL SE FL.R 19-XX 04/04A               | 4.000.000 | EUR    | 4.104.500                    | 0,46             |
| UNIBAIL RODAMCO FL.R 18-XX 25/10A        | 1.000.000 | EUR    | 992.440                      | 0,11             |
| <b>Países Bajos</b>                      |           |        | <b>47.251.823</b>            | <b>5,28</b>      |
| COOPERATIEVE RABOBANK FL.R 20-XX XX-XXS  | 2.200.000 | EUR    | 2.443.188                    | 0,27             |
| COOPERATIEVE RA FL.R 20-28 05/05A        | 4.800.000 | EUR    | 4.977.288                    | 0,56             |
| IBERDROLA INTL BV FL.R 20-99 31/12A      | 2.000.000 | EUR    | 2.065.440                    | 0,23             |
| ING GROEP NV FL.R 20-31 26/05A           | 3.000.000 | EUR    | 3.192.105                    | 0,36             |
| ING GROUP NV FL.R 17-29 26/09A           | 2.700.000 | EUR    | 2.802.033                    | 0,31             |
| ING GROUP NV FL.R 19-25 03/09A           | 2.900.000 | EUR    | 2.907.004                    | 0,33             |
| ING GROUP NV FL.R 19-30 13/11A           | 2.000.000 | EUR    | 2.028.300                    | 0,23             |
| TELEFONICA EUROPE BV FL.R 17-XX 07/06M   | 1.400.000 | EUR    | 1.433.432                    | 0,16             |
| TENNET HOLDING BV FL.R 20-XX 22/10A      | 2.000.000 | EUR    | 2.077.750                    | 0,23             |
| VOLKSWAGEN INTER FIN FL.R 20-XX 17/06A   | 3.000.000 | EUR    | 3.337.560                    | 0,37             |
| VOLKSWAGEN INTER FIN FL.R 20-XX 17/06A   | 5.600.000 | EUR    | 6.057.156                    | 0,68             |
| VOLKSWAGEN INTL FIN FL.R 15-XX 20/03A    | 3.000.000 | EUR    | 3.049.470                    | 0,34             |
| VOLKSWAGEN INTL FIN FL.R 17-XX 14/06A    | 1.000.000 | EUR    | 1.107.020                    | 0,12             |
| VOLKSWAGEN INTL FIN FL.R 17-XX 14/12A    | 3.500.000 | EUR    | 3.608.307                    | 0,40             |
| VOLKSWAGEN INTL FIN FL.R 8-XX 27/06A     | 4.000.000 | EUR    | 4.638.080                    | 0,52             |
| VONOVIA FINANCE BV FL.R 14-XX 17/12A     | 1.500.000 | EUR    | 1.527.690                    | 0,17             |
| <b>Estados Unidos de América</b>         |           |        | <b>21.500.077</b>            | <b>2,40</b>      |
| BANK OF AMERICA FL.R 19-29 08/08A        | 1.872.000 | EUR    | 1.883.279                    | 0,21             |
| BANK OF AMERICA FL.R 20-31 26/10A        | 3.780.000 | EUR    | 3.746.585                    | 0,42             |
| CITIGROUP INC FL.R 20-26 06/07A          | 6.066.000 | EUR    | 6.335.057                    | 0,71             |
| DEUTSCHE BANK AG NY FL.R 21-32 28/05S    | 1.613.000 | USD    | 1.385.277                    | 0,15             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Corporate

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                           | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| JPMORGAN CHASE & CO FL.R 19-27 11/03A                  | 4.305.000 | EUR    | 4.485.014                    | 0,50             |
| JPMORGAN CHASE FL.R 17-28 18/05A                       | 1.478.000 | EUR    | 1.590.365                    | 0,18             |
| WELLS FARGO FL.R 20-25 04/05A                          | 2.000.000 | EUR    | 2.074.500                    | 0,23             |
| <b>Italia</b>                                          |           |        | <b>18.718.205</b>            | <b>2,09</b>      |
| ASSICURAZ GENERALI FL.R 15-47 27/10A                   | 1.200.000 | EUR    | 1.481.958                    | 0,17             |
| ENEL SPA EMTN 2.25 20-XX XX/XXA                        | 1.000.000 | EUR    | 1.048.535                    | 0,12             |
| ENI S.P.A. FL.R 21-99 31/12A                           | 1.450.000 | EUR    | 1.451.189                    | 0,16             |
| UNICREDIT FL.R 14-XX 10/09S                            | 5.000.000 | EUR    | 5.062.875                    | 0,57             |
| UNICREDIT FL.R 21-32 03/06S                            | 2.147.000 | USD    | 1.825.357                    | 0,20             |
| UNICREDIT SPA FL.R 17-49 03/12S                        | 2.000.000 | EUR    | 2.156.990                    | 0,24             |
| UNICREDIT SPA FL.R 19-25 25/06A                        | 1.500.000 | EUR    | 1.545.285                    | 0,17             |
| UNICREDIT SPA FL.R 19-29 23/09A                        | 2.000.000 | EUR    | 2.017.206                    | 0,22             |
| UNICREDIT SPA FL.R 20-27 22/07A                        | 2.000.000 | EUR    | 2.128.810                    | 0,24             |
| <b>Alemania</b>                                        |           |        | <b>18.430.134</b>            | <b>2,06</b>      |
| ALLIANZ SE FL.R 20-50 08/07A                           | 4.600.000 | EUR    | 4.937.548                    | 0,55             |
| BERTELSMANN SUB FL.R 15-75 23/04A                      | 4.000.000 | EUR    | 4.154.212                    | 0,47             |
| COMMERZBANK AG FL.R 20-26 24/03A                       | 2.000.000 | EUR    | 2.038.040                    | 0,23             |
| DEUTSCHE BANK A -25 19/11A                             | 1.700.000 | EUR    | 1.736.176                    | 0,19             |
| DEUTSCHE BANK A -30 19/11A                             | 2.700.000 | EUR    | 2.856.843                    | 0,32             |
| DEUTSCHE BK FL.R 21-99 31/12A                          | 2.600.000 | EUR    | 2.707.315                    | 0,30             |
| <b>España</b>                                          |           |        | <b>14.087.527</b>            | <b>1,58</b>      |
| BANCO DE SABADELL SA FL.R 17-XX 18/02Q                 | 5.000.000 | EUR    | 5.146.025                    | 0,58             |
| BANCO DE SABADELL SA FL.R 18-28 12/12A                 | 2.700.000 | EUR    | 2.959.875                    | 0,33             |
| BANCO DE SABADELL SA FL.R 21-28 16/06A                 | 1.200.000 | EUR    | 1.183.620                    | 0,13             |
| CAIXABANK SA FL.R 17-28 14/07A                         | 1.700.000 | EUR    | 1.776.109                    | 0,20             |
| CAIXABANK SA FL.R 20-26 10/07A                         | 800.000   | EUR    | 817.828                      | 0,09             |
| CAIXABANK SA FL.R 20-26 18/11A                         | 2.200.000 | EUR    | 2.204.070                    | 0,25             |
| <b>Suiza</b>                                           |           |        | <b>6.712.299</b>             | <b>0,75</b>      |
| CREDIT SUISSE AG FL.R 20-99 21/12A                     | 2.000.000 | USD    | 1.788.279                    | 0,20             |
| CREDIT SUISSE GROUP FL.R 17-25 17/07A                  | 1.680.000 | EUR    | 1.725.511                    | 0,19             |
| CREDIT SUISSE GROUP FL.R 20-28 14/01A                  | 1.886.000 | EUR    | 1.887.886                    | 0,21             |
| CREDIT SUISSE SA AG FL.R 20-99 31/12S                  | 1.562.000 | USD    | 1.310.623                    | 0,15             |
| <b>Austria</b>                                         |           |        | <b>4.654.755</b>             | <b>0,52</b>      |
| OMV AG FL.R 15-XX 09/12A                               | 2.500.000 | EUR    | 2.558.275                    | 0,29             |
| OMV AG FL.R 20-49 31/12A                               | 2.000.000 | EUR    | 2.096.480                    | 0,23             |
| <b>Reino Unido</b>                                     |           |        | <b>3.667.230</b>             | <b>0,41</b>      |
| BARCLAYS FL.R 20-25 02/04A                             | 1.069.000 | EUR    | 1.165.130                    | 0,13             |
| HSBC HOLDINGS PLC FL.R 20-31 13/11A                    | 2.500.000 | EUR    | 2.502.100                    | 0,28             |
| <b>Organismos de Inversión Colectiva</b>               |           |        | <b>85.684.169</b>            | <b>9,57</b>      |
| <b>Acciones/Participaciones en fondos de inversión</b> |           |        | <b>85.684.169</b>            | <b>9,57</b>      |
| <b>Francia</b>                                         |           |        | <b>73.958.160</b>            | <b>8,26</b>      |
| CANDRIAM LONG SHORT CREDIT R EUR C                     | 447.000   | EUR    | 47.265.780                   | 5,28             |
| CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV Z EUR C                       | 18.000    | EUR    | 26.692.380                   | 2,98             |
| <b>Luxemburgo</b>                                      |           |        | <b>11.726.009</b>            | <b>1,31</b>      |
| CANDRIAM BONDS CAPITAL SECURITIES Z EUR C              | 6.842     | EUR    | 11.725.409                   | 1,31             |
| CANDRIAM BONDS EMERGING MARKETS Z EUR C H              | 0         | EUR    | 600                          | 0,00             |
| <b>Total de la cartera de valores</b>                  |           |        | <b>809.657.676</b>           | <b>90,47</b>     |
| Coste de adquisición                                   |           |        | 785.874.287                  |                  |

# Candriam Bonds

---

## Candriam Bonds Euro Corporate

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

### Distribución geográfica (en % activo neto)

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| Francia                   | 28,98        |
| Estados Unidos de América | 17,32        |
| Países Bajos              | 13,25        |
| Italia                    | 7,41         |
| Alemania                  | 6,66         |
| España                    | 3,87         |
| Luxemburgo                | 2,70         |
| Reino Unido               | 2,61         |
| Bélgica                   | 2,07         |
| Austria                   | 1,25         |
| Japón                     | 1,20         |
| Suiza                     | 0,75         |
| Suecia                    | 0,72         |
| Irlanda                   | 0,63         |
| Portugal                  | 0,43         |
| Finlandia                 | 0,26         |
| Noruega                   | 0,19         |
| Islas Caimán              | 0,17         |
|                           | <b>90,47</b> |

### Distribución económica (en % activo neto)

|                                                 |              |
|-------------------------------------------------|--------------|
| Bancos y otras entidades financieras            | 24,18        |
| Holdings y entidades financieras                | 13,10        |
| Fondos de inversión                             | 9,58         |
| Telecomunicaciones                              | 5,69         |
| Energía y servicio de aguas                     | 4,72         |
| Sociedades inmobiliarias                        | 4,23         |
| Transporte                                      | 3,54         |
| Internet y servicios de Internet                | 3,38         |
| Farmacia y cosméticos                           | 3,30         |
| Industria automovilística                       | 2,74         |
| Petróleo                                        | 2,67         |
| Seguros                                         | 2,45         |
| Industrias agro-alimentarias                    | 1,86         |
| Electrónica y semiconductores                   | 1,42         |
| Electrotecnia y electrónica                     | 1,26         |
| Comercio minorista y grandes almacenes          | 1,16         |
| Tabaco y alcohol                                | 1,13         |
| Artículos de oficina y ordenadores              | 1,03         |
| Industria del embalaje                          | 1,02         |
| Artes gráficas y editoriales                    | 0,76         |
| Servicios sociales y de sanidad pública         | 0,74         |
| Construcción, material de construcción          | 0,22         |
| Textiles y vestido                              | 0,16         |
| Instituciones inclasificables / no clasificadas | 0,09         |
| Construcción de máquinas y aparatos             | 0,04         |
|                                                 | <b>90,47</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Diversified

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |            |        | <b>573.350.489</b>           | <b>91,00</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |            |        | <b>516.706.236</b>           | <b>82,01</b>     |
| <b>Francia</b>                                                                                                                  |            |        | <b>90.028.294</b>            | <b>14,29</b>     |
| AGENCE FRANCAISE DE 0.50 18-25 31/10A                                                                                           | 2.100.000  | EUR    | 2.172.072                    | 0,34             |
| AGENCE FRANCAISE DVP 0.25 19-29 29/06A                                                                                          | 700.000    | EUR    | 710.969                      | 0,11             |
| ALD SA 0.375 19-23 18/07A                                                                                                       | 800.000    | EUR    | 808.360                      | 0,13             |
| BNP PARIBAS 1.125 20-29 17/04A                                                                                                  | 500.000    | EUR    | 517.783                      | 0,08             |
| CAISSE DEPOTS CONS 0.01 20-25 15/09A                                                                                            | 500.000    | EUR    | 508.105                      | 0,08             |
| CAPGEMINI SE 0.6250 20-25 23/06A                                                                                                | 2.100.000  | EUR    | 2.153.203                    | 0,34             |
| CARREFOUR BANQUE 0.107 21-25 14/06A                                                                                             | 700.000    | EUR    | 701.498                      | 0,11             |
| COUNCIL OF EURO 0.0000 21-31 20/01A                                                                                             | 3.000.000  | EUR    | 3.001.425                    | 0,48             |
| CREDIT AGRICOLE SA 0.375 19-25 21/10A                                                                                           | 1.000.000  | EUR    | 1.012.095                    | 0,16             |
| CROWN EURO HOLDINGS 0.75 19-23 15/02S                                                                                           | 3.072.000  | EUR    | 3.083.873                    | 0,49             |
| DANONE SA EMTN 0.709 16-24 03/11                                                                                                | 1.500.000  | EUR    | 1.545.240                    | 0,25             |
| EDENRED SA 1.875 18-26 06/03A                                                                                                   | 1.100.000  | EUR    | 1.192.125                    | 0,19             |
| ELIS SA 1.0 19-25 03/04A                                                                                                        | 1.200.000  | EUR    | 1.196.322                    | 0,19             |
| ELIS SA 1.75 19-24 11/04A                                                                                                       | 700.000    | EUR    | 717.465                      | 0,11             |
| ESSILORLUXOTTICA 0.375 19-27 27/11A                                                                                             | 1.000.000  | EUR    | 1.021.025                    | 0,16             |
| FRANCE 0.00 19-29 25/11A                                                                                                        | 14.000.000 | EUR    | 14.080.850                   | 2,24             |
| FRANCE 0.00 20-23 25/02U                                                                                                        | 2.000.000  | EUR    | 2.021.470                    | 0,32             |
| FRANCE 0.00 20-30 25/11U                                                                                                        | 3.700.000  | EUR    | 3.690.158                    | 0,59             |
| FRANCE 0.50 18-29 25/05A                                                                                                        | 2.000.000  | EUR    | 2.098.710                    | 0,33             |
| GROUPAMA SA 3.375 18-28 24/09A                                                                                                  | 1.600.000  | EUR    | 1.818.184                    | 0,29             |
| HSBC FRANCE 0.25 19-24 17/05A                                                                                                   | 1.600.000  | EUR    | 1.622.040                    | 0,26             |
| ICADE SANTE SAS 1.375 20-30 17/09A                                                                                              | 800.000    | EUR    | 841.060                      | 0,13             |
| ILE DE FRANCE 0.50 16-25 14/06A                                                                                                 | 6.500.000  | EUR    | 6.709.202                    | 1,07             |
| KERING 0.2500 20-23 13/05A                                                                                                      | 1.700.000  | EUR    | 1.716.915                    | 0,27             |
| KLEPIERRE 0.625 19-30 01/07A                                                                                                    | 600.000    | EUR    | 601.161                      | 0,10             |
| LA BANQUE POSTALE 0.75 21-31 23/06A                                                                                             | 2.700.000  | EUR    | 2.689.605                    | 0,43             |
| LA BANQUE POSTALE 3.875 19-XX 20/05S                                                                                            | 1.000.000  | EUR    | 1.055.145                    | 0,17             |
| LA MONDIALE 0.7500 20-26 20/04A                                                                                                 | 1.300.000  | EUR    | 1.317.310                    | 0,21             |
| LVMH MOET HENNESSY 0.125 19-23 28/02A                                                                                           | 1.300.000  | EUR    | 1.309.152                    | 0,21             |
| NESTLE FINANCE 0.00 20-24 12/11U                                                                                                | 2.824.000  | EUR    | 2.847.312                    | 0,45             |
| ORANGE 0.00 19-26 04/09U                                                                                                        | 900.000    | EUR    | 899.365                      | 0,14             |
| ORANGE SA 1.1250 19-24 15/07A                                                                                                   | 700.000    | EUR    | 726.296                      | 0,12             |
| PERNOD RICARD S 1.1250 20-25 07/04A                                                                                             | 800.000    | EUR    | 835.512                      | 0,13             |
| PSA BANQUE FRAN 0.6250 19-24 21/06A                                                                                             | 1.405.000  | EUR    | 1.429.890                    | 0,23             |
| REGIE AUTONOME TRANS 0.875 17-27 25/05A                                                                                         | 1.600.000  | EUR    | 1.688.608                    | 0,27             |
| SAGESS 0.625 16-28 20/10A                                                                                                       | 1.600.000  | EUR    | 1.662.232                    | 0,26             |
| SCHNEIDER ELECT 0.00 20-23 12/06U                                                                                               | 700.000    | EUR    | 704.806                      | 0,11             |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.0 20-27 09/04A                                                                                          | 500.000    | EUR    | 528.870                      | 0,08             |
| SNCF RESEAU 1.00 16-31 09/11A                                                                                                   | 1.900.000  | EUR    | 2.026.255                    | 0,32             |
| SOCIETE DE FINANCE LOCALE 0.00 19-24 24/05U                                                                                     | 1.500.000  | EUR    | 1.517.212                    | 0,24             |
| SOCIETE GENERALE 1.7500 19-29 22/03A                                                                                            | 600.000    | EUR    | 643.686                      | 0,10             |
| SOCIETE GRAND PARIS 1.125 18-28 22/10A                                                                                          | 2.000.000  | EUR    | 2.169.010                    | 0,34             |
| SODEXO 0.75 20-25 27/04A                                                                                                        | 1.400.000  | EUR    | 1.441.860                    | 0,23             |
| SPIE SA 2.625 19-26 18/06A                                                                                                      | 2.000.000  | EUR    | 2.076.416                    | 0,33             |
| STE AUTORPARRHI 1.5 18-30 25/01A                                                                                                | 1.600.000  | EUR    | 1.776.544                    | 0,28             |
| TOTAL SE FL.R 16-XX 05/05A                                                                                                      | 1.000.000  | EUR    | 1.042.235                    | 0,17             |
| UNIBAIL-RODAMCO 1.0000 19-27 27/02A                                                                                             | 2.200.000  | EUR    | 2.291.212                    | 0,36             |
| UNION NAT.INTERPRO.EMP 0.0 20-28 25/11U                                                                                         | 1.800.000  | EUR    | 1.808.451                    | 0,29             |
| <b>Italia</b>                                                                                                                   |            |        | <b>87.901.805</b>            | <b>13,95</b>     |
| ACEA SPA 0.0000 21-25 28/09A                                                                                                    | 991.000    | EUR    | 991.302                      | 0,16             |
| ASSICURAZ GENERALI 2.124 19-30 01/10A                                                                                           | 562.000    | EUR    | 596.386                      | 0,09             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Diversified

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                               | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| ASSICURAZIONI GENERALI 2.429 20-31 14/07A  | 552.000    | EUR    | 595.660                      | 0,09             |
| ASSICURAZIONI GENERALI 3.875 19-29 29/01A  | 500.000    | EUR    | 591.402                      | 0,09             |
| AUTOSTRADIE ITALIA SPA 2.000 21-30 15/01A  | 800.000    | EUR    | 828.470                      | 0,13             |
| BUONI POLIENNAL 0.3500 19-25 01/02S        | 2.500.000  | EUR    | 2.541.062                    | 0,40             |
| INTESA SANPAOLO 0.75 19-24 04/12A          | 547.000    | EUR    | 561.170                      | 0,09             |
| INTESA SANPAOLO 1.0000 19-24 04/07A        | 992.000    | EUR    | 1.021.815                    | 0,16             |
| ITALY 0.05 19-23 15/01S                    | 3.500.000  | EUR    | 3.524.973                    | 0,56             |
| ITALY 1.65 20-30 01/12S                    | 16.500.000 | EUR    | 17.867.933                   | 2,84             |
| ITALY 2.05 17-27 01/08S                    | 8.000.000  | EUR    | 8.847.600                    | 1,40             |
| ITALY 2.50 14-24 01/12S                    | 3.200.000  | EUR    | 3.488.736                    | 0,55             |
| ITALY 2.50 18-25 15/11S                    | 4.000.000  | EUR    | 4.436.560                    | 0,70             |
| ITALY 2.80 18-28 01/08S                    | 4.000.000  | EUR    | 4.675.620                    | 0,74             |
| ITALY 3.50 14-30 01/03S                    | 3.000.000  | EUR    | 3.726.030                    | 0,59             |
| ITALY 3.75 14-24 01/09S                    | 7.100.000  | EUR    | 7.985.192                    | 1,27             |
| ITALY 4.50 13-23 01/05S                    | 7.100.000  | EUR    | 7.738.610                    | 1,23             |
| ITALY 5.00 09-25 01/03S                    | 1.500.000  | EUR    | 1.781.355                    | 0,28             |
| ITALY 5.25 98-29 01/11S                    | 1.000.000  | EUR    | 1.380.660                    | 0,22             |
| ITALY BTP 5.50 12-22 01/11S                | 4.000.000  | EUR    | 4.315.380                    | 0,69             |
| ITALY BTP 6.50 97-27 01/11S                | 1.300.000  | EUR    | 1.802.184                    | 0,29             |
| ITALY TB 2.10 19-26 15/07S                 | 4.400.000  | EUR    | 4.837.206                    | 0,77             |
| SNAM 0.00 21-25 15/08A                     | 1.378.000  | EUR    | 1.377.270                    | 0,22             |
| TERNA SPA 1.0000 19-26 10/04A              | 394.000    | EUR    | 411.923                      | 0,07             |
| TRAMMISSIONE ELETTRI 0.375 21-29 23/06A    | 1.122.000  | EUR    | 1.122.196                    | 0,18             |
| UNICREDIT 2.569 20-26 22/09S               | 1.000.000  | USD    | 855.110                      | 0,14             |
| <b>España</b>                              |            |        | <b>57.018.843</b>            | <b>9,05</b>      |
| ADIF ALTA VELOC 0.5500 20-30 30/04A        | 2.100.000  | EUR    | 2.124.013                    | 0,34             |
| BANCO BILBAO VI 0.3750 19-24 02/10A        | 900.000    | EUR    | 912.303                      | 0,14             |
| BANCO BILBAO VIZCAYA 0.75 20-25 04/06A     | 2.300.000  | EUR    | 2.370.553                    | 0,38             |
| BANCO DE SABADELL SA 1.75 19-24 10/05A     | 800.000    | EUR    | 830.559                      | 0,13             |
| BANKIA SA 0.8750 19-24 25/03A              | 1.200.000  | EUR    | 1.231.842                    | 0,20             |
| BANKIA SA 1.0000 19-24 25/06A              | 400.000    | EUR    | 410.766                      | 0,06             |
| CAIXABANK SA 0.7500 21-28 26/05A           | 2.000.000  | EUR    | 2.013.260                    | 0,32             |
| CAIXABANK SA 1.75 18-23 24/10A             | 900.000    | EUR    | 937.863                      | 0,15             |
| CELLNEX FINANCE CO SA 0.75 21-26 15/11A    | 1.400.000  | EUR    | 1.390.539                    | 0,22             |
| COMMUNITY OF MADRID 1.571 19-29 30/04A     | 323.000    | EUR    | 355.245                      | 0,06             |
| GRIFOLS SA 2.25 19-27 15/11S               | 1.000.000  | EUR    | 1.019.675                    | 0,16             |
| NT CONS FIN 0.00 21-26 23/02A              | 1.300.000  | EUR    | 1.290.894                    | 0,20             |
| SANTAN CONSUMER 1.1250 18-23 09/10A        | 1.600.000  | EUR    | 1.648.584                    | 0,26             |
| SPAIN 0.35 18-23 30/07A                    | 4.100.000  | EUR    | 4.172.693                    | 0,66             |
| SPAIN 0.80 20-27 30/07A                    | 7.000.000  | EUR    | 7.367.325                    | 1,17             |
| SPAIN 1.45 19-29 29/01A                    | 6.509.000  | EUR    | 7.166.474                    | 1,14             |
| SPAIN 1.60 15-25 30/04A                    | 3.000.000  | EUR    | 3.228.795                    | 0,51             |
| SPAIN 1.95 15-30 30/07A                    | 5.000.000  | EUR    | 5.737.875                    | 0,91             |
| SPAIN 2.15 15-25 31/10A                    | 500.000    | EUR    | 553.940                      | 0,09             |
| SPAIN 5.40 13-23 31/01A                    | 2.000.000  | EUR    | 2.188.830                    | 0,35             |
| SPAIN 5.90 11-26 30/07A                    | 5.300.000  | EUR    | 6.959.324                    | 1,10             |
| SPAIN GOVERNMENT BOND 0.1 21-31 30/04A     | 2.000.000  | EUR    | 1.940.160                    | 0,31             |
| TELEFONICA EMISIONES 1.495 18-25 11/09A    | 1.100.000  | EUR    | 1.167.331                    | 0,19             |
| <b>Estados Unidos de América</b>           |            |        | <b>51.908.384</b>            | <b>8,24</b>      |
| ABBVIE INC 0.75 19-27 18/11A               | 927.000    | EUR    | 953.647                      | 0,15             |
| ABBVIE INC 1.5 20-23N15/11A                | 333.000    | EUR    | 345.802                      | 0,05             |
| AIR PRODUCTS & CHEMICAL 1.500 20-25 15/10S | 336.000    | USD    | 289.735                      | 0,05             |
| AMERICAN HONDA 0.35 19-22 26/02A           | 1.545.000  | EUR    | 1.558.217                    | 0,25             |
| APPLE INC 0.00 19-25 15/11A                | 5.327.000  | EUR    | 5.365.141                    | 0,85             |
| AT&T INC 0.8000 19-30 04/03A               | 741.000    | EUR    | 747.536                      | 0,12             |
| AT&T INC 2.35 18-29 05/09A                 | 1.000.000  | EUR    | 1.133.750                    | 0,18             |
| AVANTOR FUNDING INC 2.62520-25 01/11S      | 2.000.000  | EUR    | 2.050.260                    | 0,33             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Diversified

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| BERRY GLOBAL INC 1.00 20-25 15/01S       | 2.000.000  | EUR    | 2.022.500                    | 0,32             |
| BOSTON SCIENTIF 0.6250 19-27 01/12A      | 1.336.000  | EUR    | 1.356.835                    | 0,21             |
| CITIGROUP INC 1.625 18-28 21/03A         | 3.000.000  | EUR    | 3.240.675                    | 0,51             |
| COCA-COLA CO/TH 1.4500 20-27 01/06S      | 755.000    | USD    | 643.084                      | 0,10             |
| COLGATE-PALMOLIVE CO 0.5 19-26 06/03A    | 833.000    | EUR    | 854.704                      | 0,14             |
| EQUINIX INC 0.2500 21-27 15/03A          | 991.000    | EUR    | 984.975                      | 0,16             |
| FIDELITY NATIONAL INF 1.5 19-27 21/05A   | 571.000    | EUR    | 606.505                      | 0,10             |
| FIDELITY NATL I 0.1250 19-22 03/12A      | 800.000    | EUR    | 804.024                      | 0,13             |
| FISERV INC 1.125 19-27 01/07A            | 150.000    | EUR    | 156.826                      | 0,02             |
| INTL BK FOR RECONS 0.00 20-30 21/02U     | 3.500.000  | EUR    | 3.503.587                    | 0,56             |
| IQVIA INC 1.7500 21-26 15/03S            | 1.000.000  | EUR    | 1.011.399                    | 0,16             |
| KELLOGG CO 0.5000 21-29 20/05A           | 923.000    | EUR    | 923.785                      | 0,15             |
| MCDONALD'S CORP 0.9 19-26 15/06A         | 1.200.000  | EUR    | 1.249.662                    | 0,20             |
| MORGAN STANLEY 1.00 16-22 02/12A         | 3.000.000  | EUR    | 3.055.500                    | 0,48             |
| NASDAQ INC 0.8750 20-30 13/02A           | 920.000    | EUR    | 935.543                      | 0,15             |
| NATIONAL GRID 0.75 18-23 08/08A          | 2.041.000  | EUR    | 2.078.779                    | 0,33             |
| NETFLIX INC 3.8750 19-29 15/11S          | 300.000    | EUR    | 361.875                      | 0,06             |
| PEPSI 0.25 20-24 06/05A                  | 1.910.000  | EUR    | 1.939.576                    | 0,31             |
| PROCTER & GAMBLE CO 0.55 20-25 29/10S    | 1.404.000  | USD    | 1.169.716                    | 0,19             |
| PROCTER & GAMBLE CO 0.625 18-24 30/10A   | 4.116.000  | EUR    | 4.236.146                    | 0,67             |
| PROLOGIS LP 1.625 20-32 17/06A           | 487.000    | EUR    | 527.462                      | 0,08             |
| STRYKER CORP 0.25 19-24 03/12A           | 1.287.000  | EUR    | 1.300.449                    | 0,21             |
| STRYKER CORP 0.60 20-23 01/12S           | 300.000    | USD    | 252.981                      | 0,04             |
| THERMO FISHER S 0.1250 19-25 01/03A      | 1.402.000  | EUR    | 1.409.802                    | 0,22             |
| TOYOTA MOTOR CR 0.8000 20-25 16/10S      | 553.000    | USD    | 462.762                      | 0,07             |
| VERIZON COMMUNICATION 0.875 19-27 08/04A | 2.006.000  | EUR    | 2.076.511                    | 0,33             |
| VOLKSWAGEN GROU 1.2500 20-25 24/11S      | 2.739.000  | USD    | 2.298.633                    | 0,36             |
| <b>Alemania</b>                          |            |        | <b>35.170.693</b>            | <b>5,58</b>      |
| ADIDAS AG 0.00 20-24 09/09U              | 1.100.000  | EUR    | 1.106.501                    | 0,18             |
| BUNDESREPUB. DE 0.0000 21-31 15/02A      | 11.000.000 | EUR    | 11.271.645                   | 1,79             |
| DAIMLER AG 0.75 20-30 10/09A             | 760.000    | EUR    | 783.222                      | 0,12             |
| DEUTSCHE BOERSE AG 0.0 21-26 22/02A      | 1.100.000  | EUR    | 1.105.346                    | 0,18             |
| GERMANY 0.00 20-30 15/08U                | 3.007.000  | EUR    | 3.106.111                    | 0,49             |
| GERMANY 0.50 14-30 15/04A                | 3.000.000  | EUR    | 3.897.595                    | 0,62             |
| GERMANY 6.50 97-27 04/07A                | 146.556    | EUR    | 210.079                      | 0,03             |
| HOCHTIEF AG 0.5 19-27 03/09A             | 566.000    | EUR    | 569.937                      | 0,09             |
| KFW 0.0100 19-27 05/05A                  | 1.115.000  | EUR    | 1.135.053                    | 0,18             |
| LAND HESSEN 0.6250 17-27 07/04A          | 2.500.000  | EUR    | 2.629.312                    | 0,42             |
| NORTH RHINE-WESTPH 0.50 17-27 16/02A     | 3.000.000  | EUR    | 3.135.420                    | 0,50             |
| STATE OF BERLIN 0.625 17-27 08/02A       | 2.500.000  | EUR    | 2.628.000                    | 0,42             |
| VOLKSWAGEN LEASING 0.00 21-24 19/07A     | 1.610.000  | EUR    | 1.609.082                    | 0,25             |
| VOLKSWAGEN LEASING 0.25 21-26 12/01A     | 1.976.000  | EUR    | 1.983.390                    | 0,31             |
| <b>Países Bajos</b>                      |            |        | <b>33.171.597</b>            | <b>5,27</b>      |
| ABN AMRO BANK 0.5 19-26 15/04A           | 1.146.000  | EUR    | 1.177.154                    | 0,19             |
| ABN AMRO BANK 1.25 20-25 28/05A          | 900.000    | EUR    | 940.721                      | 0,15             |
| ALLIANZ FINANCE II 0.00 20-25 14/01U     | 500.000    | EUR    | 503.387                      | 0,08             |
| ASML HOLDING NV 0.6250 20-29 07/05A      | 1.088.000  | EUR    | 1.122.832                    | 0,18             |
| BMW FINANCE NV 0.0000 21-26 11/01A       | 1.742.000  | EUR    | 1.744.744                    | 0,28             |
| BMW FINANCE NV 0.6250 19-23 06/10A       | 1.253.000  | EUR    | 1.278.549                    | 0,20             |
| COOPERATIEVE RA 0.6250 21-33 25/02A      | 1.300.000  | EUR    | 1.297.101                    | 0,21             |
| DAIMLER AG 0.85 17-25 28/02A             | 1.000.000  | EUR    | 1.034.850                    | 0,16             |
| EDP FINANCE BV 1.625 18-26 26/01A        | 1.083.000  | EUR    | 1.159.227                    | 0,18             |
| ENEL FIN INTL 0.3750 19-27 17/06A        | 961.000    | EUR    | 973.219                      | 0,15             |
| HEINEKEN NV 1.625 20-25 30/03A           | 333.000    | EUR    | 354.498                      | 0,06             |
| IBERDROLA INTL BV 1.125 16-26 21/04A     | 500.000    | EUR    | 528.840                      | 0,08             |
| ING GROEP NV 2.5000 18-30 15/11A         | 200.000    | EUR    | 238.395                      | 0,04             |
| ING GROUP NV 1.0 10-23 20/09A            | 700.000    | EUR    | 719.614                      | 0,11             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Diversified

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| KON AHOLD DELHAIZE 0.25 19-25 26/06A     | 653.000   | EUR    | 660.193                      | 0,11             |
| NEDER FINANCIERINGS 0.125 17-23 01/06A   | 3.600.000 | EUR    | 3.643.560                    | 0,58             |
| NETHERLANDS 0.00 20-30 15/07A            | 3.000.000 | EUR    | 3.048.975                    | 0,48             |
| NETHERLANDS 0.25 19-29 14/02A            | 3.200.000 | EUR    | 3.332.800                    | 0,53             |
| NETHERLANDS 0.50 16-26 15/07A            | 800.000   | EUR    | 841.732                      | 0,13             |
| RABOBANK 0.25 19-26 30/10A               | 900.000   | EUR    | 911.286                      | 0,15             |
| RABOBANK FL.R 19-XX 29/06S               | 1.000.000 | EUR    | 1.036.790                    | 0,16             |
| RECKITT BENCKISER TRE 0.375 20-26 19/05A | 2.374.000 | EUR    | 2.415.414                    | 0,38             |
| ROYAL PHILIPS NV 0.5000 19-26 22/05A     | 923.000   | EUR    | 945.955                      | 0,15             |
| SIEMENS FIN 0.00 20-23 20/02U            | 1.600.000 | EUR    | 1.610.000                    | 0,26             |
| SIEMENS FINANCIER 0.375 18-23 06/09A     | 500.000   | EUR    | 508.043                      | 0,08             |
| SIEMENS FIN NV 0.30 19-24 28/02A         | 162.000   | EUR    | 164.534                      | 0,03             |
| TELEFONICA EUROPE BV 2.376 21-99 31/12A  | 1.000.000 | EUR    | 979.184                      | 0,16             |
| <b>Bélgica</b>                           |           |        | <b>22.818.617</b>            | <b>3,62</b>      |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV 2.125 20-27 12/02A  | 701.000   | EUR    | 785.432                      | 0,12             |
| BELGIUM 0.00 20-27 22/10U                | 7.000.000 | EUR    | 7.144.725                    | 1,13             |
| BELGIUM 0.10 20-30 22/06A                | 6.000.000 | EUR    | 6.082.230                    | 0,97             |
| BELGIUM 0.375 20-30 15/04A               | 1.800.000 | EUR    | 1.839.321                    | 0,29             |
| COMMUNAUTE FLAMANDE 0.375 16-26 13/10A   | 3.000.000 | EUR    | 3.092.040                    | 0,49             |
| EUROPEAN UNION 0.00 21-31 04/07A         | 1.050.000 | EUR    | 1.048.367                    | 0,17             |
| UCB SA 1.0000 21-28 30/03A               | 2.800.000 | EUR    | 2.826.502                    | 0,45             |
| <b>Austria</b>                           |           |        | <b>19.356.719</b>            | <b>3,07</b>      |
| AUSTRIA 0.0000 21-31 20/02A              | 2.500.000 | EUR    | 2.501.312                    | 0,40             |
| AUSTRIA 0.00 20-30 20/02U                | 1.000.000 | EUR    | 1.008.085                    | 0,16             |
| AUSTRIA 0.5 19-29 20/02A                 | 4.000.000 | EUR    | 4.213.900                    | 0,67             |
| AUSTRIA 0.75 16-26 20/10A                | 500.000   | EUR    | 531.460                      | 0,09             |
| AUSTRIA 1.20 15-25 20/10A                | 7.800.000 | EUR    | 8.388.939                    | 1,33             |
| ERSTE GROUP BAN 0.0500 20-25 16/09A      | 1.400.000 | EUR    | 1.406.867                    | 0,22             |
| OEBB INFR REGS 1.00 14-24 18/11A         | 500.000   | EUR    | 523.860                      | 0,08             |
| OEBB INFRA 3.00 13-33 24/10A             | 590.000   | EUR    | 782.296                      | 0,12             |
| <b>Rumanía</b>                           |           |        | <b>11.538.438</b>            | <b>1,83</b>      |
| ROMANIA 1.3750 20-29 02/12A              | 2.000.000 | EUR    | 1.998.650                    | 0,32             |
| ROMANIA 2.875 18-29 11/03S               | 2.000.000 | EUR    | 2.217.740                    | 0,35             |
| ROMANIA 3.6240 20-30 26/05A              | 2.000.000 | EUR    | 2.317.160                    | 0,37             |
| ROMANIAN GOVT INTL BD 2.0 21-33 14/04A   | 2.867.000 | EUR    | 2.851.318                    | 0,45             |
| ROUMANIE 2.50 18-30 08/02S               | 2.000.000 | EUR    | 2.153.570                    | 0,34             |
| <b>Canadá</b>                            |           |        | <b>10.690.210</b>            | <b>1,70</b>      |
| CANADIAN IMPERIAL BAN 0.375 19-24 03/05A | 2.169.000 | EUR    | 2.200.049                    | 0,35             |
| QUEBEC 0.875 18-28 05/07A                | 1.000.000 | EUR    | 1.061.080                    | 0,17             |
| ROYAL BANK OF CANADA 0.1250 19-24 23/07A | 2.521.000 | EUR    | 2.542.126                    | 0,40             |
| ROYAL BANK OF CANADA 0.2500 19-24 02/05A | 1.192.000 | EUR    | 1.205.571                    | 0,19             |
| TORONTO-DOMINIO 0.3750 19-24 25/04A      | 767.000   | EUR    | 778.279                      | 0,13             |
| TORONTO-DOMINION 0.625 18-23 20/07A      | 2.846.000 | EUR    | 2.903.105                    | 0,46             |
| <b>Reino Unido</b>                       |           |        | <b>10.359.291</b>            | <b>1,64</b>      |
| BP CAPITAL MARKETS 0.8310 19-27 08/11A   | 1.092.000 | EUR    | 1.127.190                    | 0,18             |
| BP CAPITAL MARKETS 3.25 20-XX 22/06A     | 1.061.000 | EUR    | 1.135.593                    | 0,18             |
| CREDIT AGRICOLE LDN 0.75 18-23 05/12A    | 1.000.000 | EUR    | 1.025.970                    | 0,16             |
| CREDIT SUISSE AG LONDO 0.45 20-25 19/05A | 776.000   | EUR    | 787.714                      | 0,12             |
| GLAXOSMITHKLINE 0.1250 20-23 12/05A      | 2.284.000 | EUR    | 2.303.791                    | 0,36             |
| HSBC HOLDINGS PLC 4.00 21-99 31/12S      | 2.465.000 | USD    | 2.119.829                    | 0,34             |
| STANDARD CHARTERED 0.991 21-25 12/01S    | 2.000.000 | USD    | 1.682.916                    | 0,27             |
| VODAFONE GROUP 3.1 18-79 03/01A          | 169.000   | EUR    | 176.288                      | 0,03             |
| <b>Portugal</b>                          |           |        | <b>9.608.438</b>             | <b>1,53</b>      |
| ENERGIAS DE PORTUGAL 1.70 20-80 20/07A   | 500.000   | EUR    | 503.500                      | 0,08             |
| PORTUGAL 0.475 20-30 18/10A              | 500.000   | EUR    | 509.923                      | 0,08             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Diversified

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                            | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|-----------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| PORTUGAL 4.125 17-27 14/04A             | 5.000.000 | EUR    | 6.265.325                    | 1,00             |
| PORTUGAL 5.65 13-24 15/02A              | 2.000.000 | EUR    | 2.329.690                    | 0,37             |
| <b>Indonesia</b>                        |           |        | <b>9.224.211</b>             | <b>1,46</b>      |
| INDONESIA 0.9 20-27 14/02A              | 6.000.000 | EUR    | 6.076.710                    | 0,96             |
| INDONESIA 1.45 19-26 18/06A             | 800.000   | EUR    | 833.904                      | 0,13             |
| INDONESIE REGS 2.625 16-23 14/06A       | 2.200.000 | EUR    | 2.313.597                    | 0,37             |
| <b>Luxemburgo</b>                       |           |        | <b>9.036.230</b>             | <b>1,43</b>      |
| DH EUROPE FIN 0.45 19-28 18/03A         | 1.408.000 | EUR    | 1.420.461                    | 0,23             |
| EFSF 0.875 17-27 26/07A                 | 1.000.000 | EUR    | 1.068.110                    | 0,17             |
| LUXEMBOURG 0.625 17-27 01/02A           | 446.000   | EUR    | 470.030                      | 0,07             |
| NESTLE FINANCE 0.00001 20-25 3/12A      | 2.529.000 | EUR    | 2.544.351                    | 0,40             |
| PROLOGIS INTL FUND II 0.75 21-33 23/03A | 998.000   | EUR    | 979.547                      | 0,16             |
| TYCO ELECTRONICS 0.00 20-25 14/02U      | 2.544.000 | EUR    | 2.553.731                    | 0,40             |
| <b>Filipinas</b>                        |           |        | <b>8.136.028</b>             | <b>1,29</b>      |
| PHILIPPINES 0.2500 21-25 28/04A         | 1.800.000 | EUR    | 1.809.108                    | 0,29             |
| PHILIPPINES 0.70 20-29 03/02A           | 3.000.000 | EUR    | 2.989.170                    | 0,47             |
| PHILIPPINES 1.20 21-33 28/04A           | 3.333.000 | EUR    | 3.337.750                    | 0,53             |
| <b>Irlanda</b>                          |           |        | <b>7.173.687</b>             | <b>1,14</b>      |
| ABBOTT IRL FINANCING 0.375 19-27 19/11A | 969.000   | EUR    | 982.755                      | 0,15             |
| FCA BANK S.P.A. 0.125 20-23 16/11A      | 699.000   | EUR    | 701.391                      | 0,11             |
| FCA BANK SPA 0.50 20-23 18/09A          | 1.103.000 | EUR    | 1.115.194                    | 0,18             |
| FRESENIUS FINANCE IRL 0.0 21-25 01/10A  | 1.124.000 | EUR    | 1.121.847                    | 0,18             |
| KERRY GROUP FIN SERV 0.625 19-29 20/09A | 819.000   | EUR    | 827.677                      | 0,13             |
| RYANAIR LTD 0.875 21-26 25/05A          | 1.359.000 | EUR    | 1.365.258                    | 0,22             |
| SMURFIT KAPPA TREA 1.50 19-27 15/09S    | 1.000.000 | EUR    | 1.059.565                    | 0,17             |
| <b>Australia</b>                        |           |        | <b>6.884.366</b>             | <b>1,09</b>      |
| MACQUARIE GROUP 0.35 20-28 03/03A       | 2.489.000 | EUR    | 2.450.906                    | 0,39             |
| MACQUARIE GROUP LTD 0.95 21-31 21/05A   | 3.000.000 | EUR    | 2.992.545                    | 0,47             |
| NATIONAL AUSTRALIA 0.25 19-24 20/05A    | 1.421.000 | EUR    | 1.440.915                    | 0,23             |
| <b>Noruega</b>                          |           |        | <b>5.511.909</b>             | <b>0,88</b>      |
| DNB BANK ASA 0.6 18-23 25/09A           | 2.220.000 | EUR    | 2.264.766                    | 0,36             |
| SANTANDER CONSU 0.1250 20-25 25/02A     | 2.200.000 | EUR    | 2.204.004                    | 0,35             |
| TELENOR ASA 0.00 19-23 25/09U           | 1.037.000 | EUR    | 1.043.139                    | 0,17             |
| <b>México</b>                           |           |        | <b>4.745.841</b>             | <b>0,75</b>      |
| MEXICO 1.35 20-27 18/09A                | 1.990.000 | EUR    | 2.065.938                    | 0,33             |
| MEXICO 1.45 21-33 25/10S                | 975.000   | EUR    | 933.250                      | 0,15             |
| MEXICO 3.375 16-31 23/02A               | 1.500.000 | EUR    | 1.746.653                    | 0,27             |
| <b>Japón</b>                            |           |        | <b>4.178.951</b>             | <b>0,66</b>      |
| JAPAN FINANCE ORGANI 0.01 21-28 02/02A  | 907.000   | EUR    | 906.710                      | 0,15             |
| MIZUHO FINANCIA 1.0200 18-23 11/10A     | 1.737.000 | EUR    | 1.784.420                    | 0,28             |
| MIZUHO FINANCIAL GR 0.214 20-25 07/10A  | 643.000   | EUR    | 647.700                      | 0,10             |
| SUMITOMO MITSUI FIN 0.465 19-24 30/05A  | 826.000   | EUR    | 840.121                      | 0,13             |
| <b>Kazajstán</b>                        |           |        | <b>4.127.830</b>             | <b>0,66</b>      |
| KAZAKHSTAN 0.60 19-26 30/09A            | 3.000.000 | EUR    | 3.006.285                    | 0,48             |
| KAZAKSTAN 2.375 18-28 09/11A            | 1.000.000 | EUR    | 1.121.545                    | 0,18             |
| <b>Finlandia</b>                        |           |        | <b>4.101.992</b>             | <b>0,65</b>      |
| FINLAND 0.5 19-29 15/09A                | 1.000.000 | EUR    | 1.056.165                    | 0,17             |
| FINNVERA 0.50 16-26 13/04A              | 1.345.000 | EUR    | 1.397.287                    | 0,22             |
| NOKIA OYJ 2.3750 20-25 15/05A           | 600.000   | EUR    | 638.625                      | 0,10             |
| OP CORPORATE BANK 0.125 20-24 01/07A    | 1.000.000 | EUR    | 1.009.915                    | 0,16             |
| <b>Polonia</b>                          |           |        | <b>3.379.849</b>             | <b>0,54</b>      |
| BGK 1.75 16-26 06/05A                   | 1.226.000 | EUR    | 1.332.319                    | 0,21             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Diversified

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| CANPACK SA 2.375 20-27 01/11S            | 2.000.000 | EUR    | 2.047.530                    | 0,33             |
| <b>Suecia</b>                            |           |        | <b>2.504.653</b>             | <b>0,40</b>      |
| SVENSKA HANDELSBANKEN 0.375 18-23 03/07A | 1.490.000 | EUR    | 1.512.544                    | 0,24             |
| VOLVO TREASURY 0.00 20-23 11/02U         | 546.000   | EUR    | 548.675                      | 0,09             |
| VOLVO TREASURY 0.125 20-24 17/09A        | 440.000   | EUR    | 443.434                      | 0,07             |
| <b>Suiza</b>                             |           |        | <b>1.883.490</b>             | <b>0,30</b>      |
| CREDIT SUISSE 0.625 21-33 18/01A         | 2.000.000 | EUR    | 1.883.490                    | 0,30             |
| <b>Emiratos Arabes Unidos</b>            |           |        | <b>1.705.279</b>             | <b>0,27</b>      |
| EMIRATES TELECO 0.3750 21-28 17/05A      | 569.000   | EUR    | 572.929                      | 0,09             |
| EMIRATE TEL CORP GMTN 2.75 14-26 18/06A  | 1.000.000 | EUR    | 1.132.350                    | 0,18             |
| <b>Dinamarca</b>                         |           |        | <b>1.583.592</b>             | <b>0,25</b>      |
| CARLSBERG BREWERIES 0.375 20-27 30/06A   | 1.565.000 | EUR    | 1.583.592                    | 0,25             |
| <b>Estonia</b>                           |           |        | <b>1.111.800</b>             | <b>0,18</b>      |
| ESTONIA 0.125 20-30 10/06A               | 1.109.000 | EUR    | 1.111.800                    | 0,18             |
| <b>Eslovenia</b>                         |           |        | <b>1.086.266</b>             | <b>0,17</b>      |
| SLOVENIA 0.1250 21-31 01/07A             | 309.000   | EUR    | 308.815                      | 0,05             |
| SLOVENIA 0.275 20-30 17/02A              | 759.000   | EUR    | 777.451                      | 0,12             |
| <b>Serbia</b>                            |           |        | <b>758.933</b>               | <b>0,12</b>      |
| SERBIA 1.5 19-29 26/06A                  | 200.000   | EUR    | 201.878                      | 0,03             |
| SERBIA 3.1250 20-27 15/05A               | 500.000   | EUR    | 557.055                      | 0,09             |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>     |           |        | <b>56.644.253</b>            | <b>8,99</b>      |
| <b>Francia</b>                           |           |        | <b>11.746.923</b>            | <b>1,86</b>      |
| AXA SA FL.R 21-41 07/10A                 | 3.429.000 | EUR    | 3.430.149                    | 0,54             |
| CREDIT AGRICOLE SA FL.R 20-30 05/06A     | 1.700.000 | EUR    | 1.767.464                    | 0,28             |
| DANONE SA EMTN FL.R 17-XX 23/06A         | 1.000.000 | EUR    | 1.026.925                    | 0,16             |
| EDF FL.R 18-99 04/10A                    | 1.000.000 | EUR    | 1.072.476                    | 0,17             |
| ELECTRICITE DE FRANCE FL.R 19-XX XX/XXA  | 800.000   | EUR    | 829.242                      | 0,13             |
| ORANGE SA FL.R 19-XX 19/03A              | 300.000   | EUR    | 309.063                      | 0,05             |
| ORANGE SA FL.R 20-49 31/12A              | 1.000.000 | EUR    | 1.023.320                    | 0,16             |
| SUEZ FL.R 19-XX XX/XXA                   | 1.000.000 | EUR    | 1.006.975                    | 0,16             |
| TOTAL SE FL.R 19-XX 04/04A               | 648.000   | EUR    | 664.929                      | 0,11             |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT FL.R 20-49 21/12A   | 600.000   | EUR    | 616.380                      | 0,10             |
| <b>Alemania</b>                          |           |        | <b>8.983.823</b>             | <b>1,43</b>      |
| ALLIANZ SE FL.R 20-XX XX/XXA             | 800.000   | USD    | 698.747                      | 0,11             |
| COMMERZBANK AG FL.R 20-30 05/12A         | 500.000   | EUR    | 555.029                      | 0,09             |
| COMMERZBANK AG FL.R 20-99 31/12A         | 200.000   | EUR    | 220.928                      | 0,04             |
| GERMANY 0.10 15-26 15/04A                | 5.000.000 | EUR    | 5.872.876                    | 0,93             |
| MERCK KGAA FL.R 19-79 25/06A             | 600.000   | EUR    | 619.863                      | 0,10             |
| MUNICH RE FLR 20-41 26/05A               | 1.000.000 | EUR    | 1.016.380                    | 0,16             |
| <b>Estados Unidos de América</b>         |           |        | <b>7.286.481</b>             | <b>1,16</b>      |
| BANK OF AMERICA CORP FL.R 21-31 22/03A   | 2.345.000 | EUR    | 2.341.307                    | 0,37             |
| BANK OF AMERICA FL.R 19-29 08/08A        | 1.571.000 | EUR    | 1.580.465                    | 0,25             |
| CITIGROUP INC FL.R 18-26 24/07A          | 1.866.000 | EUR    | 1.965.551                    | 0,31             |
| JPMORGAN CHASE & CO FL.R 19-27 11/03A    | 1.343.000 | EUR    | 1.399.158                    | 0,23             |
| <b>Países Bajos</b>                      |           |        | <b>7.133.311</b>             | <b>1,13</b>      |
| COOPERATIVE RABOBANK FL.R 18-XX XX/XXS   | 600.000   | EUR    | 660.285                      | 0,11             |
| ING GROUP NV FL.R 19-25 03/09A           | 1.400.000 | EUR    | 1.403.381                    | 0,22             |
| REPSOL INTL FINANCE FL.R 20-49 31/12A    | 3.000.000 | EUR    | 3.217.218                    | 0,51             |
| TELEFONICA EUROPE BV FL.R 17-XX 07/06M   | 300.000   | EUR    | 307.164                      | 0,05             |
| TELEFONICA EUROPE BV FL.R 19-XX 24/09A   | 500.000   | EUR    | 514.318                      | 0,08             |
| VOLKSWAGEN INTL FIN FL.R 17-XX 14/12A    | 1.000.000 | EUR    | 1.030.945                    | 0,16             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Diversified

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                           | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Italia</b>                                          |           |        | <b>6.999.295</b>             | <b>1,11</b>      |
| ENEL SPA FL.R 19-80 24/05A                             | 1.000.000 | EUR    | 1.094.995                    | 0,17             |
| ENI SPA FL.R 20-49 31/12A                              | 1.000.000 | EUR    | 1.052.040                    | 0,17             |
| INTESA SANPAOLO FL.R 20-49 31/12S                      | 1.000.000 | EUR    | 1.102.580                    | 0,17             |
| UNICREDIT SPA FL.R 19-25 25/06A                        | 1.022.000 | EUR    | 1.052.854                    | 0,17             |
| UNICREDIT SPA FL.R 19-29 23/09A                        | 1.100.000 | EUR    | 1.109.463                    | 0,18             |
| UNICREDIT SPA FL.R 20-32 15/01A                        | 1.550.000 | EUR    | 1.587.363                    | 0,25             |
| <b>Bélgica</b>                                         |           |        | <b>6.754.607</b>             | <b>1,07</b>      |
| AGEAS NV FL.R 19-XX XX/XXA                             | 600.000   | EUR    | 639.450                      | 0,10             |
| BELFIUS BANK SA FL.R 18-XX XX/XXS                      | 1.800.000 | EUR    | 1.784.286                    | 0,28             |
| ELIA SYSTEM FL.R 18-XX 05/12A                          | 500.000   | EUR    | 527.510                      | 0,09             |
| KBC GROEP FL.R 15-27 11/03A                            | 1.000.000 | EUR    | 1.012.755                    | 0,16             |
| KBC GROUPE SA FL.R 19-99 31/12S                        | 2.600.000 | EUR    | 2.790.606                    | 0,44             |
| <b>Suecia</b>                                          |           |        | <b>2.772.368</b>             | <b>0,44</b>      |
| SWEDBANK AB FL.R 21-27 20/05A                          | 2.000.000 | EUR    | 2.001.660                    | 0,32             |
| TELIA COMPANY AB FL.R 20-81 11/05A                     | 760.000   | EUR    | 770.708                      | 0,12             |
| <b>España</b>                                          |           |        | <b>2.527.341</b>             | <b>0,40</b>      |
| BANCO BILBAO VIZCAYA FL.R 19-29 22/02A                 | 700.000   | EUR    | 738.192                      | 0,12             |
| BANCO DE SABADE FL.R 20-27 11/03A                      | 1.100.000 | EUR    | 1.131.399                    | 0,18             |
| BANCO DE SABADELL SA FL.R 18-28 12/12A                 | 600.000   | EUR    | 657.750                      | 0,10             |
| <b>Suiza</b>                                           |           |        | <b>1.261.260</b>             | <b>0,20</b>      |
| CREDIT SUISSE GROUP FL.R 20-28 14/01A                  | 1.260.000 | EUR    | 1.261.260                    | 0,20             |
| <b>Reino Unido</b>                                     |           |        | <b>1.178.844</b>             | <b>0,19</b>      |
| VODAFONE GROUP PLC FL.R 20-80 27/08A                   | 1.137.000 | EUR    | 1.178.844                    | 0,19             |
| <b>Organismos de Inversión Colectiva</b>               |           |        | <b>46.290.203</b>            | <b>7,35</b>      |
| <b>Acciones/Participaciones en fondos de inversión</b> |           |        | <b>46.290.203</b>            | <b>7,35</b>      |
| <b>Luxemburgo</b>                                      |           |        | <b>43.142.599</b>            | <b>6,85</b>      |
| CANDRIAM BONDS CONVERTIBLE DEFENSIVE Z EUR C           | 4.400     | EUR    | 7.571.784                    | 1,20             |
| CANDRIAM BONDS CREDIT ALPHA Z EUR C                    | 4.000     | EUR    | 6.048.560                    | 0,96             |
| CANDRIAM BONDS GLOBAL INFLATION SHORT DUR Z EUR C      | 45.000    | EUR    | 6.045.300                    | 0,96             |
| CANDRIAM BONDS TOTAL RETURN I EUR C                    | 1         | EUR    | 1.488                        | 0,00             |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO Z EUR C                 | 2.700     | EUR    | 2.931.137                    | 0,47             |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND GLOBAL V EUR C AH            | 3.600     | EUR    | 3.550.356                    | 0,56             |
| CLEOME INDEX EURO LONG TERM BONDS I EUR C              | 1         | EUR    | 2.065                        | 0,00             |
| CLEOME INDEX EURO LONG TERM BONDS Z EUR C              | 1         | EUR    | 2.094                        | 0,00             |
| CLEOME INDEX EURO SHORT TERM BONDS Z EUR C             | 1         | EUR    | 1.217                        | 0,00             |
| G FUND EUROPEAN CONVERTIBLE BONDS I EUR CAP            | 9.900     | EUR    | 16.988.598                   | 2,70             |
| <b>Francia</b>                                         |           |        | <b>3.147.604</b>             | <b>0,50</b>      |
| CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV Z EUR C                       | 2.123     | EUR    | 3.147.604                    | 0,50             |
| <b>Total de la cartera de valores</b>                  |           |        | <b>619.640.692</b>           | <b>98,35</b>     |
| Coste de adquisición                                   |           |        | 612.410.430                  |                  |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Diversified

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

### Distribución geográfica (en % activo neto)

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| Francia                   | 16,65        |
| Italia                    | 15,06        |
| España                    | 9,45         |
| Estados Unidos de América | 9,40         |
| Luxemburgo                | 8,28         |
| Alemania                  | 7,01         |
| Países Bajos              | 6,40         |
| Bélgica                   | 4,69         |
| Austria                   | 3,07         |
| Reino Unido               | 1,83         |
| Rumanía                   | 1,83         |
| Canadá                    | 1,70         |
| Portugal                  | 1,53         |
| Indonesia                 | 1,46         |
| Filipinas                 | 1,29         |
| Irlanda                   | 1,14         |
| Australia                 | 1,09         |
| Noruega                   | 0,88         |
| Suecia                    | 0,84         |
| México                    | 0,75         |
| Japón                     | 0,66         |
| Kazajstán                 | 0,66         |
| Finlandia                 | 0,65         |
| Polonia                   | 0,54         |
| Suiza                     | 0,50         |
| Emiratos Arabes Unidos    | 0,27         |
| Dinamarca                 | 0,25         |
| Estonia                   | 0,18         |
| Eslovenia                 | 0,17         |
| Serbia                    | 0,12         |
|                           | <b>98,35</b> |

### Distribución económica (en % activo neto)

|                                                                |              |
|----------------------------------------------------------------|--------------|
| Obligaciones del Estado, de las provincias y de los municipios | 43,39        |
| Bancos y otras entidades financieras                           | 16,32        |
| Holdings y entidades financieras                               | 9,80         |
| Fondos de inversión                                            | 7,35         |
| Telecomunicaciones                                             | 2,44         |
| Seguros                                                        | 1,68         |
| Transporte                                                     | 1,58         |
| Farmacia y cosméticos                                          | 1,53         |
| Energía y servicio de aguas                                    | 1,52         |
| Organizaciones supranacionales                                 | 1,37         |
| Petróleo                                                       | 1,03         |
| Bienes de consumo diversos                                     | 0,99         |
| Industrias agro-alimentarias                                   | 0,96         |
| Artículos de oficina y ordenadores                             | 0,85         |
| Sociedades inmobiliarias                                       | 0,83         |
| Electrotecnia y electrónica                                    | 0,68         |
| Internet y servicios de Internet                               | 0,65         |
| Tabaco y alcohol                                               | 0,56         |
| Electrónica y semiconductores                                  | 0,55         |
| Instituciones inclasificables / no clasificadas                | 0,55         |
| Varios                                                         | 0,53         |
| Industria del embalaje                                         | 0,49         |
| Industria automovilística                                      | 0,49         |
| Construcción, material de construcción                         | 0,42         |
| Textiles y vestido                                             | 0,38         |
| Comercio minorista y grandes almacenes                         | 0,38         |
| Servicios sociales y de sanidad pública                        | 0,33         |
| Servicios varios                                               | 0,29         |
| Restaurantes, hoteles                                          | 0,20         |
| Biotechnología                                                 | 0,16         |
| Química                                                        | 0,05         |
|                                                                | <b>98,35</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Government

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |            |        | <b>788.640.444</b>           | <b>95,31</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |            |        | <b>776.894.693</b>           | <b>93,89</b>     |
| <b>Italia</b>                                                                                                                   |            |        | <b>207.955.057</b>           | <b>25,13</b>     |
| BUONI POLIENNAL 3.8500 18-49 01/09S                                                                                             | 7.500.000  | EUR    | 10.941.863                   | 1,32             |
| BUONI POLIENNALI DEL 1.8500 20-25 01/07S                                                                                        | 5.000.000  | EUR    | 5.376.400                    | 0,65             |
| CASSA DEPOSITI 1.00 20-30 11/02A                                                                                                | 1.600.000  | EUR    | 1.631.288                    | 0,20             |
| ITALY 0.95 18-23 01/03S                                                                                                         | 3.000.000  | EUR    | 3.067.215                    | 0,37             |
| ITALY 0.95 21-37 01/03S                                                                                                         | 7.500.000  | EUR    | 7.146.675                    | 0,86             |
| ITALY 1.00 19-22 15/07S                                                                                                         | 1.500.000  | EUR    | 1.522.620                    | 0,18             |
| ITALY 1.35 15-22 15/04S                                                                                                         | 7.300.000  | EUR    | 7.406.142                    | 0,89             |
| ITALY 1.65 20-30 01/12S                                                                                                         | 8.000.000  | EUR    | 8.663.240                    | 1,05             |
| ITALY 1.75 19-24 01/07S                                                                                                         | 3.500.000  | EUR    | 3.703.980                    | 0,45             |
| ITALY 2.00 18-28 01/02S                                                                                                         | 10.500.000 | EUR    | 11.613.683                   | 1,40             |
| ITALY 2.05 17-27 01/08S                                                                                                         | 6.000.000  | EUR    | 6.635.700                    | 0,80             |
| ITALY 2.50 14-24 01/12S                                                                                                         | 4.400.000  | EUR    | 4.797.012                    | 0,58             |
| ITALY 2.50 18-25 15/11S                                                                                                         | 8.800.000  | EUR    | 9.760.432                    | 1,18             |
| ITALY 2.80 18-28 01/08S                                                                                                         | 2.000.000  | EUR    | 2.337.810                    | 0,28             |
| ITALY 3.00 19-29 01/02S                                                                                                         | 3.400.000  | EUR    | 4.054.789                    | 0,49             |
| ITALY 3.10 19-40 01/03S                                                                                                         | 8.000.000  | EUR    | 10.129.240                   | 1,22             |
| ITALY 3.25 14-46 01/09S                                                                                                         | 4.000.000  | EUR    | 5.258.360                    | 0,64             |
| ITALY 3.50 14-30 01/03S                                                                                                         | 12.000.000 | EUR    | 14.904.120                   | 1,80             |
| ITALY 4.50 10-26 01/03S                                                                                                         | 9.300.000  | EUR    | 11.230.912                   | 1,36             |
| ITALY 4.50 13-23 01/05S                                                                                                         | 6.600.000  | EUR    | 7.193.637                    | 0,87             |
| ITALY 4.50 13-24 01/03S                                                                                                         | 12.700.000 | EUR    | 14.304.962                   | 1,73             |
| ITALY 4.75 13-28 01/09S                                                                                                         | 7.300.000  | EUR    | 9.506.680                    | 1,15             |
| ITALY 4.75 13-44 01/09S                                                                                                         | 600.000    | EUR    | 960.741                      | 0,12             |
| ITALY 5.00 09-40 01/09S                                                                                                         | 5.500.000  | EUR    | 8.736.200                    | 1,06             |
| ITALY 5.75 02-33 01/02S                                                                                                         | 16.250.000 | EUR    | 24.834.469                   | 3,00             |
| ITALY BTP 0.65 16-23 15/10S                                                                                                     | 2.900.000  | EUR    | 2.964.104                    | 0,36             |
| ITALY BTP 5.50 12-22 01/11S                                                                                                     | 3.500.000  | EUR    | 3.775.958                    | 0,46             |
| ITALY TB 2.10 19-26 15/07S                                                                                                      | 5.000.000  | EUR    | 5.496.825                    | 0,66             |
| <b>Francia</b>                                                                                                                  |            |        | <b>160.338.831</b>           | <b>19,38</b>     |
| AFD 1.375 14-24 17/09A                                                                                                          | 900.000    | EUR    | 951.323                      | 0,12             |
| AFL EMTN 0.375 15-22 20/03A                                                                                                     | 6.600.000  | EUR    | 6.637.026                    | 0,80             |
| BPIFRANCE FINAN 0.0000 21-28 25/05A                                                                                             | 2.500.000  | EUR    | 2.513.575                    | 0,30             |
| BPIFRANCE FINANCE SA 0.75 14-21 25/10A                                                                                          | 3.000.000  | EUR    | 3.012.360                    | 0,36             |
| COUNCIL OF EURO 0.0000 21-31 20/01A                                                                                             | 1.000.000  | EUR    | 1.000.475                    | 0,12             |
| FRANCE 0.00 18-24 25/03U                                                                                                        | 200.000    | EUR    | 203.376                      | 0,02             |
| FRANCE 0.00 19-25 25/03A                                                                                                        | 3.000.000  | EUR    | 3.059.760                    | 0,37             |
| FRANCE 0.00 19-29 25/11A                                                                                                        | 11.800.000 | EUR    | 11.868.145                   | 1,43             |
| FRANCE 0.00 20-30 25/11U                                                                                                        | 3.000.000  | EUR    | 2.992.020                    | 0,36             |
| FRANCE 0.50 18-29 25/05A                                                                                                        | 7.500.000  | EUR    | 7.870.162                    | 0,95             |
| FRANCE 0.50 21-44 25/06A                                                                                                        | 4.000.000  | EUR    | 3.822.600                    | 0,46             |
| FRANCE 1.00 16-27 25/05A                                                                                                        | 14.000.000 | EUR    | 15.105.370                   | 1,83             |
| FRANCE 1.25 18-34 25/05A                                                                                                        | 4.500.000  | EUR    | 5.042.160                    | 0,61             |
| FRANCE 1.75 15-66 25/05A                                                                                                        | 4.000.000  | EUR    | 5.040.420                    | 0,61             |
| FRANCE 1.75 17-39 25/06A                                                                                                        | 17.500.000 | EUR    | 21.249.638                   | 2,57             |
| FRANCE 2.00 17-48 25/05A                                                                                                        | 7.300.000  | EUR    | 9.402.035                    | 1,14             |
| FRANCE 3.25 12-45 25/05A                                                                                                        | 5.450.000  | EUR    | 8.495.269                    | 1,03             |
| FRANCE 4.75 04-35 25/04A                                                                                                        | 2.000.000  | EUR    | 3.208.850                    | 0,39             |
| FRANCE OAT 1.5 18-50 25/05A                                                                                                     | 9.800.000  | EUR    | 11.391.716                   | 1,38             |
| FRANCE OAT 1.75 12-23 25/05A                                                                                                    | 7.000.000  | EUR    | 7.320.635                    | 0,89             |
| ILE DE FRANCE 0.50 16-25 14/06A                                                                                                 | 9.300.000  | EUR    | 9.599.320                    | 1,16             |
| REGIE AUTONOME TRANS 0.875 17-27 25/05A                                                                                         | 3.100.000  | EUR    | 3.271.678                    | 0,40             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Government

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| SAGESS 0.625 16-28 20/10A                   | 2.500.000  | EUR    | 2.597.238                    | 0,31             |
| SNCF RESEAU 1.00 16-31 09/11A               | 4.300.000  | EUR    | 4.585.735                    | 0,55             |
| SNCF RESEAU 1.875 17-34 30/03A              | 2.500.000  | EUR    | 2.916.513                    | 0,35             |
| SOCIETE DE FINANCE LOCALE 0.00 19-24 24/05U | 3.000.000  | EUR    | 3.034.425                    | 0,37             |
| UNEDIC 1.25 15-27 21/10A                    | 1.500.000  | EUR    | 1.635.270                    | 0,20             |
| UNION NAT.INTERPRO.EMP 0.0 20-28 25/11U     | 2.500.000  | EUR    | 2.511.737                    | 0,30             |
| <b>España</b>                               |            |        | <b>114.966.606</b>           | <b>13,89</b>     |
| BONOS Y OBLIG DEL 1.45 17-27 31/10A         | 4.500.000  | EUR    | 4.924.823                    | 0,59             |
| BONOS Y OBLIG DEL EST 0.0 20-26 31/01A      | 3.000.000  | EUR    | 3.034.215                    | 0,37             |
| SPAIN 0.00 20-23 30/04U                     | 4.000.000  | EUR    | 4.037.660                    | 0,49             |
| SPAIN 0.40 17-22 30/04A                     | 3.000.000  | EUR    | 3.024.480                    | 0,36             |
| SPAIN 1.25 20-30 31/10A                     | 8.400.000  | EUR    | 9.100.224                    | 1,10             |
| SPAIN 1.85 19-35 05/03A                     | 8.450.000  | EUR    | 9.660.631                    | 1,17             |
| SPAIN 1.95 15-30 30/07A                     | 11.300.000 | EUR    | 12.967.597                   | 1,57             |
| SPAIN 2.75 14-24 31/10A                     | 3.700.000  | EUR    | 4.095.068                    | 0,49             |
| SPAIN 2.90 16-46 31/10A                     | 8.400.000  | EUR    | 11.351.382                   | 1,37             |
| SPAIN 3.80 14-24 30/04A                     | 12.000.000 | EUR    | 13.452.900                   | 1,63             |
| SPAIN 4.20 05-37 31/01A                     | 2.800.000  | EUR    | 4.184.516                    | 0,50             |
| SPAIN 4.65 10-25 30/07A                     | 8.500.000  | EUR    | 10.252.487                   | 1,24             |
| SPAIN 5.15 13-44 31/10A                     | 6.500.000  | EUR    | 11.749.823                   | 1,42             |
| SPAIN 5.90 11-26 30/07A                     | 10.000.000 | EUR    | 13.130.800                   | 1,59             |
| <b>Alemania</b>                             |            |        | <b>78.476.470</b>            | <b>9,48</b>      |
| GERMANY 0.00 20-30 15/08U                   | 8.900.000  | EUR    | 9.193.344                    | 1,11             |
| GERMANY 0.50 14-30 15/04A                   | 2.000.000  | EUR    | 2.598.397                    | 0,31             |
| GERMANY 0.50 17-27 15/08A                   | 9.800.000  | EUR    | 10.419.556                   | 1,26             |
| GERMANY 1.00 15-25 15/08A                   | 9.500.000  | EUR    | 10.153.885                   | 1,23             |
| GERMANY 1.25 17-48 15/08A                   | 5.500.000  | EUR    | 6.942.238                    | 0,84             |
| GERMANY 1.75 14-24 15/02A                   | 10.500.000 | EUR    | 11.182.815                   | 1,35             |
| GERMANY 2.50 12-44 04/07A                   | 1.800.000  | EUR    | 2.762.622                    | 0,33             |
| KFW 0.0100 19-27 05/05A                     | 2.585.000  | EUR    | 2.631.491                    | 0,32             |
| LANDWIRT RENTENBANK 0.625 16-36 31/10A      | 3.000.000  | EUR    | 3.118.965                    | 0,38             |
| LANDWIRTSCH REN 0.000 21-31 30/06A          | 5.000.000  | EUR    | 4.994.375                    | 0,60             |
| NORTH RHINE-WESTPH 0.50 17-27 16/02A        | 4.200.000  | EUR    | 4.389.588                    | 0,53             |
| STATE OF BERLIN 0.625 17-27 08/02A          | 5.700.000  | EUR    | 5.991.840                    | 0,73             |
| STATE OF HESSEN 0.00 19-24 26/07U           | 1.492.000  | EUR    | 1.513.545                    | 0,18             |
| STATE OF SCHLESWIG-HO 0.200 19-39 15/08A    | 2.714.000  | EUR    | 2.583.809                    | 0,31             |
| <b>Austria</b>                              |            |        | <b>47.791.834</b>            | <b>5,78</b>      |
| AUSTRIA 0.0000 21-31 20/02A                 | 1.000.000  | EUR    | 1.000.525                    | 0,12             |
| AUSTRIA 0.50 17-27 20/04A                   | 6.500.000  | EUR    | 6.838.812                    | 0,83             |
| AUSTRIA 0.5 19-29 20/02A                    | 8.000.000  | EUR    | 8.427.800                    | 1,02             |
| AUSTRIA 0.75 16-26 20/10A                   | 2.730.000  | EUR    | 2.901.772                    | 0,35             |
| AUSTRIA 0.75 20-51 20/03A                   | 1.700.000  | EUR    | 1.757.834                    | 0,21             |
| AUSTRIA 1.20 15-25 20/10A                   | 1.500.000  | EUR    | 1.613.258                    | 0,19             |
| AUSTRIA 1.50 16-47 20/02A                   | 3.000.000  | EUR    | 3.682.575                    | 0,45             |
| AUSTRIA 1.65 14-24 21/10A                   | 6.500.000  | EUR    | 6.990.783                    | 0,84             |
| AUSTRIA 1.75 13-23 20/10A                   | 4.000.000  | EUR    | 4.222.220                    | 0,51             |
| AUSTRIA 2.40 13-34 23/05A                   | 5.700.000  | EUR    | 7.332.907                    | 0,89             |
| OEBB INFR REGS 1.00 14-24 18/11A            | 1.000.000  | EUR    | 1.047.720                    | 0,13             |
| OEBB INFRA 3.00 13-33 24/10A                | 1.490.000  | EUR    | 1.975.628                    | 0,24             |
| <b>Países Bajos</b>                         |            |        | <b>41.010.781</b>            | <b>4,96</b>      |
| NEDER FINANCIERINGS 0.125 17-23 01/06A      | 7.200.000  | EUR    | 7.287.120                    | 0,88             |
| NEDER WATERSCHAPSB 1.25 16-36 27/05A        | 1.800.000  | EUR    | 2.011.626                    | 0,24             |
| NETHERLANDS 0.00 20-30 15/07A               | 3.000.000  | EUR    | 3.048.975                    | 0,37             |
| NETHERLANDS 0.25 19-29 14/02A               | 20.900.000 | EUR    | 21.767.350                   | 2,63             |
| NETHERLANDS 0.50 19-40 15/01A               | 5.000.000  | EUR    | 5.278.050                    | 0,64             |
| NETHERLANDS 0.75 18-28 15/07A               | 1.500.000  | EUR    | 1.617.660                    | 0,20             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Government

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                               | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Bélgica</b>                             |           |        | <b>39.161.375</b>            | <b>4,73</b>      |
| BELGIUM 0.10 20-30 22/06A                  | 2.000.000 | EUR    | 2.027.410                    | 0,25             |
| BELGIUM 0.375 20-30 15/04A                 | 2.700.000 | EUR    | 2.758.982                    | 0,33             |
| BELGIUM 0.40 20-40 22/06A                  | 2.100.000 | EUR    | 2.022.121                    | 0,24             |
| BELGIUM 0.9 19-29 22/06A                   | 1.000.000 | EUR    | 1.084.090                    | 0,13             |
| BELGIUM 1.25 18-33 22/04A                  | 7.000.000 | EUR    | 7.896.770                    | 0,95             |
| BELGIUM 1.60 16-47 22/06A                  | 4.500.000 | EUR    | 5.317.560                    | 0,64             |
| BELGIUM 1.7 19-50 05/02A                   | 1.000.000 | EUR    | 1.209.095                    | 0,15             |
| BELGIUM 3.75 13-45 22/06A                  | 6.250.000 | EUR    | 10.393.969                   | 1,26             |
| COMMUNAUTE FLAMANDE 0.375 16-26 13/10A     | 5.000.000 | EUR    | 5.153.400                    | 0,62             |
| EUROPEAN UNION 0.00 21-31 04/07A           | 1.300.000 | EUR    | 1.297.978                    | 0,16             |
| <b>Portugal</b>                            |           |        | <b>31.577.677</b>            | <b>3,82</b>      |
| PORTUGAL 0.90 20-35 12/10A                 | 2.500.000 | EUR    | 2.568.025                    | 0,31             |
| PORTUGAL 2.875 15-25 15/10A                | 3.000.000 | EUR    | 3.427.320                    | 0,42             |
| PORTUGAL 3.875 14-30 15/02A                | 7.200.000 | EUR    | 9.493.308                    | 1,15             |
| PORTUGAL 4.10 15-45 15/02A                 | 1.900.000 | EUR    | 3.078.218                    | 0,37             |
| PORTUGAL 4.125 17-27 14/04A                | 6.200.000 | EUR    | 7.769.003                    | 0,94             |
| PORTUGAL 5.65 13-24 15/02A                 | 4.500.000 | EUR    | 5.241.803                    | 0,63             |
| <b>Irlanda</b>                             |           |        | <b>12.670.398</b>            | <b>1,53</b>      |
| IRELAND 1.35 18-31 18/03A                  | 6.900.000 | EUR    | 7.762.465                    | 0,94             |
| IRELAND 2.00 15-45 18/02A                  | 500.000   | EUR    | 641.670                      | 0,08             |
| IRELAND 2.40 14-30 15/05A                  | 500.000   | EUR    | 606.998                      | 0,07             |
| IRELAND 5.40 09-25 13/03A                  | 3.000.000 | EUR    | 3.659.265                    | 0,44             |
| <b>Finlandia</b>                           |           |        | <b>9.399.947</b>             | <b>1,14</b>      |
| FINLAND 1.125 18-34 15/04A                 | 6.500.000 | EUR    | 7.303.497                    | 0,88             |
| FINNVERA 0.50 16-26 13/04A                 | 2.018.000 | EUR    | 2.096.450                    | 0,26             |
| <b>Luxemburgo</b>                          |           |        | <b>6.788.195</b>             | <b>0,82</b>      |
| EIB 1.125 17-33 13/04A                     | 2.000.000 | EUR    | 2.222.060                    | 0,27             |
| LUXEMBOURG 0.00 20-32 14/09U               | 1.533.000 | EUR    | 1.518.314                    | 0,18             |
| LUXEMBOURG 0.625 17-27 01/02A              | 2.892.000 | EUR    | 3.047.821                    | 0,37             |
| <b>Eslovenia</b>                           |           |        | <b>5.925.022</b>             | <b>0,72</b>      |
| SLOVENIA 0.1250 21-31 01/07A               | 1.546.000 | EUR    | 1.545.072                    | 0,19             |
| SLOVENIA 0.275 20-30 17/02A                | 4.276.000 | EUR    | 4.379.950                    | 0,53             |
| <b>Croacia</b>                             |           |        | <b>4.553.770</b>             | <b>0,55</b>      |
| CROATIA 1.125 19-29 19/06A                 | 2.116.000 | EUR    | 2.180.083                    | 0,26             |
| CROATIA 3.00 17-27 20/03A                  | 2.060.000 | EUR    | 2.373.687                    | 0,29             |
| <b>Polonia</b>                             |           |        | <b>3.752.444</b>             | <b>0,45</b>      |
| BGK 1.75 16-26 06/05A                      | 3.453.000 | EUR    | 3.752.444                    | 0,45             |
| <b>Chipre</b>                              |           |        | <b>3.604.062</b>             | <b>0,44</b>      |
| REPUBLIC OF CYP 0.0000 21-26 09/02A        | 3.581.000 | EUR    | 3.604.062                    | 0,44             |
| <b>Rumanía</b>                             |           |        | <b>3.370.462</b>             | <b>0,41</b>      |
| ROMANIAN GOVT INTL BD 2.0 21-33 14/04A     | 3.389.000 | EUR    | 3.370.462                    | 0,41             |
| <b>Estados Unidos de América</b>           |           |        | <b>2.918.400</b>             | <b>0,35</b>      |
| BUONI POLIENNAL 1.5000 21-45 30/04S        | 3.000.000 | EUR    | 2.918.400                    | 0,35             |
| <b>Reino Unido</b>                         |           |        | <b>1.521.562</b>             | <b>0,18</b>      |
| EUROPEAN BANK FOR RECONS 0.00 19-24 17/10U | 1.500.000 | EUR    | 1.521.562                    | 0,18             |
| <b>Estonia</b>                             |           |        | <b>1.111.800</b>             | <b>0,13</b>      |
| ESTONIA 0.125 20-30 10/06A                 | 1.109.000 | EUR    | 1.111.800                    | 0,13             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Government

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                           | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>                   |            |        | <b>11.745.751</b>            | <b>1,42</b>      |
| <b>Alemania</b>                                        |            |        | <b>11.745.751</b>            | <b>1,42</b>      |
| GERMANY 0.10 15-26 15/04A                              | 10.000.000 | EUR    | 11.745.751                   | 1,42             |
| <b>Organismos de Inversión Colectiva</b>               |            |        | <b>28.236.254</b>            | <b>3,41</b>      |
| <b>Acciones/Participaciones en fondos de inversión</b> |            |        | <b>28.236.254</b>            | <b>3,41</b>      |
| <b>Francia</b>                                         |            |        | <b>28.236.254</b>            | <b>3,41</b>      |
| CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV Z EUR C                       | 19.041     | EUR    | 28.236.254                   | 3,41             |
| <b>Total de la cartera de valores</b>                  |            |        | <b>816.876.698</b>           | <b>98,72</b>     |
| Coste de adquisición                                   |            |        | 804.914.024                  |                  |

## Candriam Bonds

---

### Candriam Bonds Euro Government

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

**Distribución geográfica (en % activo neto)**

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| Italia                    | 25,13        |
| Francia                   | 22,79        |
| España                    | 13,89        |
| Alemania                  | 10,90        |
| Austria                   | 5,78         |
| Países Bajos              | 4,96         |
| Bélgica                   | 4,73         |
| Portugal                  | 3,82         |
| Irlanda                   | 1,53         |
| Finlandia                 | 1,14         |
| Luxemburgo                | 0,82         |
| Eslovenia                 | 0,72         |
| Croacia                   | 0,55         |
| Polonia                   | 0,45         |
| Chipre                    | 0,44         |
| Rumanía                   | 0,41         |
| Estados Unidos de América | 0,35         |
| Reino Unido               | 0,18         |
| Estonia                   | 0,13         |
|                           | <b>98,72</b> |

**Distribución económica (en % activo neto)**

|                                                                |              |
|----------------------------------------------------------------|--------------|
| Obligaciones del Estado, de las provincias y de los municipios | 85,10        |
| Fondos de inversión                                            | 3,41         |
| Bancos y otras entidades financieras                           | 3,36         |
| Holdings y entidades financieras                               | 1,67         |
| Servicios sociales y de sanidad pública                        | 1,36         |
| Varios                                                         | 1,27         |
| Servicios varios                                               | 0,85         |
| Organizaciones supranacionales                                 | 0,73         |
| Transporte                                                     | 0,40         |
| Petróleo                                                       | 0,32         |
| Instituciones inclasificables / no clasificadas                | 0,25         |
|                                                                | <b>98,72</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro High Yield

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |            |        | <b>3.045.253.754</b>         | <b>93,67</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |            |        | <b>2.600.547.331</b>         | <b>79,99</b>     |
| <b>Estados Unidos de América</b>                                                                                                |            |        | <b>498.653.346</b>           | <b>15,34</b>     |
| ALLIED UNI HLD LLC 3.625 21-28 01/06S                                                                                           | 55.308.000 | EUR    | 54.860.005                   | 1,69             |
| ARAMARK SERVICES INC 6.375 20-25 01/05S                                                                                         | 8.601.000  | USD    | 7.706.014                    | 0,24             |
| AVANTOR FUNDING INC 2.62520-25 01/11S                                                                                           | 29.534.000 | EUR    | 30.220.961                   | 0,93             |
| CATALENT PHARMA 2.375 20-28 01/03S                                                                                              | 35.909.000 | EUR    | 35.980.818                   | 1,11             |
| CCO HLDG LLC/CAPITAL 5.75 16-26 15/02S                                                                                          | 3.329.000  | USD    | 2.901.359                    | 0,09             |
| CCO HOLDINGS LLC 5.125 17-27 01/05S                                                                                             | 12.099.000 | USD    | 10.701.274                   | 0,33             |
| CENTENE ESCROW CORP 5.375 18-26 01/06S                                                                                          | 7.927.000  | USD    | 6.976.950                    | 0,22             |
| COLFAX CORP 3.25 17-25 15/05S                                                                                                   | 25.951.000 | EUR    | 26.148.747                   | 0,80             |
| HJ HEINZ FINANCE CO 7.125 09-39 01/08S                                                                                          | 3.242.095  | USD    | 3.994.156                    | 0,12             |
| IQVIA INC 2.25 19-28 15/01A                                                                                                     | 4.950.000  | EUR    | 4.979.066                    | 0,15             |
| IQVIA INC 2.25 21-29 15/03S                                                                                                     | 31.686.000 | EUR    | 31.597.279                   | 0,97             |
| KRAFT FOODS 6.875 12-39 26/01S                                                                                                  | 4.300.000  | USD    | 5.207.679                    | 0,16             |
| KRAFT HEINZ FOODS 2.25 16-28 25/05A                                                                                             | 6.800.000  | EUR    | 7.396.768                    | 0,23             |
| NETFLIX INC 3.625 17-27 05/02S                                                                                                  | 33.415.000 | EUR    | 38.421.770                   | 1,18             |
| NETFLIX INC 3.8750 19-29 15/11S                                                                                                 | 13.913.000 | EUR    | 16.747.774                   | 0,52             |
| NETFLIX INC 4.625 18-29 15/05S                                                                                                  | 27.142.000 | EUR    | 33.893.572                   | 1,04             |
| ORGANON FINANCE 2.8750 21-28 30/04S                                                                                             | 37.965.000 | EUR    | 38.487.019                   | 1,18             |
| PRIME SECURITY SERVICE 3.375 20-27 31/08S                                                                                       | 26.377.000 | USD    | 21.574.914                   | 0,66             |
| PRIMO WATER COR 3.8750 20-28 31/10S                                                                                             | 28.434.000 | EUR    | 28.960.882                   | 0,89             |
| QUINTILES IMS REGS 2.875 17-25 15/09S                                                                                           | 33.575.000 | EUR    | 33.994.687                   | 1,05             |
| SILGAN HOLDINGS INC 2.25 20-28 01/06S                                                                                           | 6.382.000  | EUR    | 6.413.910                    | 0,20             |
| STANDARD INDUST 2.2500 19-26 21/11A                                                                                             | 25.221.000 | EUR    | 25.085.897                   | 0,77             |
| WMG ACQ. 3.625 18-26 09/10S                                                                                                     | 15.022.000 | EUR    | 15.396.739                   | 0,47             |
| WMG ACQUISITION 2.75 20-28 15/07S                                                                                               | 10.754.000 | EUR    | 11.005.106                   | 0,34             |
| <b>Países Bajos</b>                                                                                                             |            |        | <b>459.878.222</b>           | <b>14,15</b>     |
| ABERTIS FINANCE BV 2.625 21-49 31/12A                                                                                           | 10.300.000 | EUR    | 10.207.300                   | 0,31             |
| ABERTIS FINANCE BV 3.248 20-XX XX/XXA                                                                                           | 60.300.000 | EUR    | 62.335.125                   | 1,92             |
| ASHLAND SERVICES BV 2.00 20-28 30/01S                                                                                           | 34.663.000 | EUR    | 35.114.798                   | 1,08             |
| AXALTA COATING 3.75 16-25 15/01S                                                                                                | 16.805.000 | EUR    | 17.092.365                   | 0,53             |
| ENERGIZER GAMMA 3.5000 21-29 30/06S                                                                                             | 27.072.000 | EUR    | 27.018.939                   | 0,83             |
| ENERGIZER GAMMA 4.6250 18-26 15/07S                                                                                             | 24.460.000 | EUR    | 25.025.026                   | 0,77             |
| IPD 3 BV 5.5000 20-25 01/12S                                                                                                    | 36.864.000 | EUR    | 38.327.501                   | 1,18             |
| NOBEL BIDCO BV 3.125 21-28 15/06S                                                                                               | 18.656.000 | EUR    | 18.699.562                   | 0,58             |
| OI EUROPEAN GROUP 3.125 16-24 15/11S                                                                                            | 46.618.000 | EUR    | 48.196.579                   | 1,48             |
| Q PARK HOLDING BV 2.0 20-27 01/03S                                                                                              | 26.345.000 | EUR    | 25.059.364                   | 0,77             |
| REPSOL INTL FINANCE 2.5000 21-XX XX/XXA                                                                                         | 14.000.000 | EUR    | 14.070.000                   | 0,43             |
| STARFRUIT FINCO 6.5 18-26 01/10S                                                                                                | 30.390.000 | EUR    | 31.788.001                   | 0,98             |
| TELEFONICA EUROPE BV 2.376 21-99 31/12A                                                                                         | 62.300.000 | EUR    | 60.891.272                   | 1,87             |
| WINTERSHALL DEA FINA 2.4985 21-99 31/12A                                                                                        | 2.800.000  | EUR    | 2.790.088                    | 0,09             |
| WINTERSHALL DEA FINA 3.5 21-99 31/12A                                                                                           | 27.700.000 | EUR    | 27.326.050                   | 0,84             |
| ZF EUROPE FINANCE BV 2.00 19-26 23/02A                                                                                          | 1.400.000  | EUR    | 1.414.193                    | 0,04             |
| ZIGGO BV 4.25 16-27 15/01S                                                                                                      | 14.021.600 | EUR    | 14.522.059                   | 0,45             |
| <b>Reino Unido</b>                                                                                                              |            |        | <b>283.111.250</b>           | <b>8,71</b>      |
| INEOS QUATTRO FINANCE 2.5 21-26 15/01S                                                                                          | 25.895.000 | EUR    | 26.121.581                   | 0,80             |
| JAGUAR LAND ROVER 5.875 20-28 15/01S                                                                                            | 13.770.000 | USD    | 12.221.035                   | 0,38             |
| JAGUAR LAND ROVER 6.8750 19-26 15/11S                                                                                           | 17.309.000 | EUR    | 20.124.482                   | 0,62             |
| NOMAD FOODS BON 2.5000 21-28 24/06S                                                                                             | 7.802.000  | EUR    | 7.880.137                    | 0,24             |
| TI AUTOMOTIVE F 3.7500 21-29 15/04S                                                                                             | 41.412.000 | EUR    | 42.203.797                   | 1,30             |
| VMED O2 UK FINA 4.7500 21-31 15/07S                                                                                             | 5.814.000  | USD    | 4.983.205                    | 0,15             |
| VMED O2 UK FINANCING 3.25 20-31 31/01S                                                                                          | 53.359.000 | EUR    | 53.484.927                   | 1,65             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro High Yield

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                            | Cantidad    | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|-----------------------------------------|-------------|--------|------------------------------|------------------|
| VODAFONE GROUP 3.1 18-79 03/01A         | 111.493.000 | EUR    | 116.092.086                  | 3,57             |
| <b>Francia</b>                          |             |        | <b>246.384.563</b>           | <b>7,58</b>      |
| ALTICE FRANCE SA 3.375 19-28 15/01S     | 16.666.000  | EUR    | 16.237.184                   | 0,50             |
| ALTICE FRANCE SA 4.125 20-29 15/01S     | 6.233.000   | EUR    | 6.240.791                    | 0,19             |
| ALTICE FRANCE SA 5.8750 18-27 01/02S    | 38.221.000  | EUR    | 40.506.310                   | 1,25             |
| CAB 3.3750 21-28 01/02S                 | 42.478.000  | EUR    | 42.265.610                   | 1,30             |
| CROWN EURO HOLDINGS 0.75 19-23 15/02S   | 23.040.000  | EUR    | 23.097.600                   | 0,71             |
| CROWN EURO HOLDINGS 2.25 18-23 01/02S   | 18.130.000  | EUR    | 18.537.925                   | 0,57             |
| DERICHEBOURG 2.2500 21-28 15/07S        | 8.079.000   | EUR    | 8.210.445                    | 0,25             |
| ELIS SA 1.0 19-25 03/04A                | 14.100.000  | EUR    | 14.013.567                   | 0,43             |
| ELIS SA 1.875 18-23 15/02A              | 7.900.000   | EUR    | 8.046.087                    | 0,25             |
| FONCIA MANAGEMENT 3.375 21-28 31/03S    | 28.412.000  | EUR    | 28.240.789                   | 0,87             |
| ORANO SA 2.75 20-28 08/03A              | 11.600.000  | EUR    | 12.110.400                   | 0,37             |
| ORANO SA 3.375 19-26 23/04A             | 21.600.000  | EUR    | 23.392.800                   | 0,72             |
| SPIE SA 2.625 19-26 18/06A              | 5.300.000   | EUR    | 5.485.055                    | 0,17             |
| <b>Alemania</b>                         |             |        | <b>228.669.762</b>           | <b>7,03</b>      |
| CECONOMY AG 1.75 21-26 24/06A           | 19.300.000  | EUR    | 19.186.516                   | 0,59             |
| DEUTSCHE LUFTHA 3.7500 21-28 11/02A     | 3.900.000   | EUR    | 4.017.390                    | 0,12             |
| NIDDA HEALTHCAR 3.50 17-24 30/09S       | 65.341.000  | EUR    | 65.161.835                   | 2,00             |
| NOVELIS SHEET I 3.3750 21-29 15/04S     | 19.450.000  | EUR    | 19.942.085                   | 0,61             |
| SCHAEFFLER AG 3.375 20-28 12/10A        | 24.400.000  | EUR    | 26.897.389                   | 0,83             |
| VERTICAL MIDCO 4.3750 20-27 15/07S      | 29.356.000  | EUR    | 30.656.764                   | 0,94             |
| ZF EUROPE FINANCE 3.75 20-28 21/09A     | 42.800.000  | EUR    | 46.840.320                   | 1,44             |
| ZF FINANCE GMBH 2.75 20-27 25/05A       | 1.700.000   | EUR    | 1.765.875                    | 0,06             |
| ZF FINANCE GMBH 3.0000 20-25 21/09A     | 13.400.000  | EUR    | 14.201.588                   | 0,44             |
| <b>Italia</b>                           |             |        | <b>207.766.943</b>           | <b>6,39</b>      |
| ATLANTIA 5.875 04-24 09/06A             | 27.200.000  | EUR    | 31.348.000                   | 0,96             |
| ATLANTIA SPA 4.375 10-25 16/09A         | 14.682.000  | EUR    | 16.865.771                   | 0,52             |
| AUTOSTRADA 1.75 15-26 26/06A            | 45.037.000  | EUR    | 46.540.335                   | 1,43             |
| AUTOSTRADA 1.875 15-25 04/11A           | 26.416.000  | EUR    | 27.463.553                   | 0,85             |
| AUTOSTRADA PER ITALIA 1.75 16-27 01/02A | 2.600.000   | EUR    | 2.678.000                    | 0,08             |
| NEXI SPA 1.6250 21-26 30/04S            | 40.741.000  | EUR    | 40.534.036                   | 1,25             |
| SOFIMA HOLDING S.P.A. 3.75 20-28 15/01S | 42.135.000  | EUR    | 42.337.248                   | 1,30             |
| <b>España</b>                           |             |        | <b>137.270.586</b>           | <b>4,22</b>      |
| CELLNEX FINANCE 0.00 21-33 15/02A       | 28.200.000  | EUR    | 27.916.816                   | 0,86             |
| CELLNEX FINANCE 1.25 21-29 15/01A       | 32.700.000  | EUR    | 32.004.406                   | 0,98             |
| CELLNEX FINANCE CO SA 1.5 21-28 08/06A  | 34.200.000  | EUR    | 34.279.515                   | 1,05             |
| CELLNEX TELECOM 1.7500 20-30 23/10A     | 8.400.000   | EUR    | 8.358.420                    | 0,26             |
| GRIFOLS SA 1.625 19-25 15/02S           | 8.587.000   | EUR    | 8.655.696                    | 0,27             |
| GRIFOLS SA 2.25 19-27 15/11S            | 3.794.000   | EUR    | 3.860.289                    | 0,12             |
| INTL CONS AIRLINES GR 3.75 21-29 25/03A | 10.700.000  | EUR    | 10.726.750                   | 0,33             |
| LORCA TELECOM BONDCO 4.00 20-27 18/09S  | 9.488.000   | EUR    | 9.654.040                    | 0,30             |
| NN HOTEL GROUP SA 4 21-26 02/07S        | 1.812.000   | EUR    | 1.814.654                    | 0,05             |
| <b>Antillas Neerlandesas</b>            |             |        | <b>109.565.268</b>           | <b>3,37</b>      |
| TEVA PHARMA 1.125 16-24 15/10A          | 15.890.000  | EUR    | 14.896.875                   | 0,46             |
| TEVA PHARMA 1.625 16-28 15/10A          | 47.852.000  | EUR    | 42.171.298                   | 1,30             |
| TEVA PHARMA 1.875 15-27 31/03A          | 57.320.000  | EUR    | 52.497.095                   | 1,61             |
| <b>Luxemburgo</b>                       |             |        | <b>108.644.169</b>           | <b>3,34</b>      |
| BK LC LUX FINCO1 5.25 21-29 30/04S      | 28.182.000  | EUR    | 28.816.095                   | 0,89             |
| FLAMINGO LUX II SCA 5.0 21-29 31/03S    | 13.416.000  | EUR    | 13.319.271                   | 0,41             |
| INPOST SA 2.25 21-27 15/07S             | 20.647.000  | EUR    | 20.824.461                   | 0,64             |
| MATTERHORN TELE 3.1250 19-26 15/09S     | 11.851.000  | EUR    | 11.886.553                   | 0,36             |
| SUMMER BC HOLDC 5.7500 19-26 31/10S     | 19.908.000  | EUR    | 20.827.789                   | 0,64             |
| TELENET INT FIN REGS 3.50 17-28 01/03S  | 12.500.000  | EUR    | 12.970.000                   | 0,40             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro High Yield

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Suecia</b>                            |            |        | <b>89.173.286</b>            | <b>2,74</b>      |
| VERISURE HOLDING AB 3.25 21-27 15/02S    | 13.157.000 | EUR    | 13.159.368                   | 0,40             |
| VERISURE HOLDING AB 3.875 20-26 15/07S   | 6.775.000  | EUR    | 6.922.763                    | 0,21             |
| VERISURE MIDHOL 5.2500 21-29 15/02S      | 67.242.000 | EUR    | 69.091.155                   | 2,13             |
| <b>Irlanda</b>                           |            |        | <b>86.791.575</b>            | <b>2,67</b>      |
| ARDAGH PACKAGING FIN 2.125 19-26 15/08S  | 9.650.000  | EUR    | 9.647.143                    | 0,30             |
| ARDAGH PACKAGING FIN 2.125 20-26 15/08S  | 42.257.000 | EUR    | 42.257.000                   | 1,30             |
| EIRCOM FINA 3.5000 19-26 15/05U          | 34.088.000 | EUR    | 34.887.432                   | 1,07             |
| <b>Canadá</b>                            |            |        | <b>45.515.134</b>            | <b>1,40</b>      |
| BAUSCH HEALTH C 7.0000 19-28 15/01S      | 23.569.000 | USD    | 20.470.588                   | 0,63             |
| BAUSCH HEALTH CO 7.25 19-29 30/05S       | 16.679.000 | USD    | 14.372.575                   | 0,44             |
| BAUSCH HEALTH COMPANIE 5.00 20-29 15/02S | 13.572.000 | USD    | 10.671.971                   | 0,33             |
| <b>Japón</b>                             |            |        | <b>32.019.269</b>            | <b>0,99</b>      |
| SOFTBANK GROUP 4.0000 18-23 20/04S       | 15.930.000 | EUR    | 16.573.572                   | 0,51             |
| SOFTBANK GROUP 4.00 17-29 19/09S         | 2.710.000  | EUR    | 2.857.641                    | 0,09             |
| SOFTBANK GROUP 5.00 18-28 15/04S         | 11.253.000 | EUR    | 12.588.056                   | 0,39             |
| <b>Rumanía</b>                           |            |        | <b>23.208.352</b>            | <b>0,71</b>      |
| RCS & RDS SA 3.25 20-28 05/02S           | 23.200.000 | EUR    | 23.208.352                   | 0,71             |
| <b>Jersey</b>                            |            |        | <b>18.863.800</b>            | <b>0,58</b>      |
| ADIENT GLOBAL HOLD 3.50 16-24 15/08S     | 18.350.000 | EUR    | 18.863.800                   | 0,58             |
| <b>Noruega</b>                           |            |        | <b>15.155.046</b>            | <b>0,47</b>      |
| ADEVINTA ASA 2.625 20-25 25/11A          | 14.771.000 | EUR    | 15.155.046                   | 0,47             |
| <b>Finlandia</b>                         |            |        | <b>6.810.700</b>             | <b>0,21</b>      |
| SPA HOLDINGS 3 OY 3.625 21-28 04/02S     | 6.760.000  | EUR    | 6.810.700                    | 0,21             |
| <b>Dinamarca</b>                         |            |        | <b>3.066.060</b>             | <b>0,09</b>      |
| TDC 3.75 12-22 02/03A                    | 2.974.000  | EUR    | 3.066.060                    | 0,09             |
| <b>Obligaciones convertibles</b>         |            |        | <b>16.657.685</b>            | <b>0,51</b>      |
| <b>Italia</b>                            |            |        | <b>16.657.685</b>            | <b>0,51</b>      |
| TELECOM ITALIA CV 1.125 15-22 26/03S     | 16.600.000 | EUR    | 16.657.685                   | 0,51             |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>     |            |        | <b>428.048.738</b>           | <b>13,17</b>     |
| <b>Países Bajos</b>                      |            |        | <b>298.957.797</b>           | <b>9,20</b>      |
| ELM BV FL.R 20-99 31/12A                 | 50.074.000 | EUR    | 53.984.780                   | 1,66             |
| REPSOL INTL FINANCE FL.R 20-49 31/12A    | 34.849.000 | EUR    | 37.281.878                   | 1,15             |
| REPSOL INTL FINANCE FL.R 20-XX 11/12A    | 55.939.000 | EUR    | 61.527.977                   | 1,89             |
| TELEFONICA EURO FL.R 19-XX XX/XXA        | 36.500.000 | EUR    | 39.595.565                   | 1,22             |
| TELEFONICA EUROPE BV FL.R 13-XX XX/XXA   | 13.900.000 | EUR    | 14.950.812                   | 0,46             |
| TELEFONICA EUROPE BV FL.R 18-XX 22/09A   | 14.000.000 | EUR    | 14.463.344                   | 0,45             |
| TELEFONICA EUROPE BV FL.R 19-XX 24/09A   | 29.200.000 | EUR    | 29.959.843                   | 0,92             |
| VOLKSWAGEN INTL FIN FL.R 15-XX 20/03A    | 46.428.000 | EUR    | 47.193.598                   | 1,45             |
| <b>Francia</b>                           |            |        | <b>105.991.636</b>           | <b>3,26</b>      |
| EDF FL.R 18-99 04/10A                    | 25.800.000 | EUR    | 27.606.000                   | 0,85             |
| EDF FL.R 21-99 31/12A                    | 36.800.000 | EUR    | 37.074.528                   | 1,14             |
| ELECTRICITE DE FL.R 20-XX XX/XXA         | 15.000.000 | EUR    | 15.457.020                   | 0,48             |
| UNIBAIL RODAMCO FL.R 18-XX 25/10A        | 18.200.000 | EUR    | 18.015.088                   | 0,55             |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT FL.R 20-XX XX/XXA   | 7.800.000  | EUR    | 7.839.000                    | 0,24             |
| <b>Alemania</b>                          |            |        | <b>23.099.305</b>            | <b>0,71</b>      |
| VERTICAL MIDCO FL.R 20-27 15/07Q         | 22.776.000 | EUR    | 23.099.305                   | 0,71             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro High Yield

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                           | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Otros valores mobiliarios</b>                       |            |        | <b>53.392.329</b>            | <b>1,64</b>      |
| <b>Obligaciones</b>                                    |            |        | <b>39.725.016</b>            | <b>1,22</b>      |
| <b>Estados Unidos de América</b>                       |            |        | <b>39.725.016</b>            | <b>1,22</b>      |
| SUMMER BC BIDCO B LLC 5.5 21-26 31/10S                 | 1.600.000  | USD    | 1.377.857                    | 0,04             |
| VALEANT PHAR. 8.5 18-27 01/06S                         | 41.840.000 | USD    | 38.347.159                   | 1,18             |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>                   |            |        | <b>13.667.313</b>            | <b>0,42</b>      |
| <b>Italia</b>                                          |            |        | <b>13.667.313</b>            | <b>0,42</b>      |
| SOFIMA HOLDING S.P.A. FL.R 20-28 15/01Q                | 13.591.000 | EUR    | 13.667.313                   | 0,42             |
| <b>Organismos de Inversión Colectiva</b>               |            |        | <b>30.008.440</b>            | <b>0,92</b>      |
| <b>Acciones/Participaciones en fondos de inversión</b> |            |        | <b>30.008.440</b>            | <b>0,92</b>      |
| <b>Luxemburgo</b>                                      |            |        | <b>15.094.181</b>            | <b>0,46</b>      |
| CANDRIAM BONDS CREDIT ALPHA Z EUR C                    | 9.982      | EUR    | 15.094.181                   | 0,46             |
| <b>Francia</b>                                         |            |        | <b>14.914.259</b>            | <b>0,46</b>      |
| CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV V EUR C                       | 150        | EUR    | 14.914.259                   | 0,46             |
| <b>Total de la cartera de valores</b>                  |            |        | <b>3.128.654.523</b>         | <b>96,23</b>     |
| Coste de adquisición                                   |            |        | 3.092.080.658                |                  |

# Candriam Bonds

---

## Candriam Bonds Euro High Yield

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

### Distribución geográfica (en % activo neto)

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| Países Bajos              | 23,34        |
| Estados Unidos de América | 16,56        |
| Francia                   | 11,30        |
| Reino Unido               | 8,71         |
| Alemania                  | 7,74         |
| Italia                    | 7,32         |
| España                    | 4,22         |
| Luxemburgo                | 3,81         |
| Antillas Neerlandesas     | 3,37         |
| Suecia                    | 2,74         |
| Irlanda                   | 2,67         |
| Canadá                    | 1,40         |
| Japón                     | 0,99         |
| Rumanía                   | 0,71         |
| Jersey                    | 0,58         |
| Noruega                   | 0,47         |
| Finlandia                 | 0,21         |
| Dinamarca                 | 0,09         |
|                           | <b>96,23</b> |

### Distribución económica (en % activo neto)

|                                          |              |
|------------------------------------------|--------------|
| Holdings y entidades financieras         | 45,50        |
| Telecomunicaciones                       | 13,08        |
| Servicios sociales y de sanidad pública  | 5,93         |
| Transporte                               | 5,45         |
| Energía y servicio de aguas              | 4,69         |
| Internet y servicios de Internet         | 4,19         |
| Farmacia y cosméticos                    | 3,69         |
| Industria del embalaje                   | 3,07         |
| Industria automovilística                | 1,82         |
| Bienes de consumo diversos               | 1,26         |
| Servicios varios                         | 1,08         |
| Fondos de inversión                      | 0,92         |
| Construcción de máquinas y aparatos      | 0,80         |
| Textiles y vestido                       | 0,77         |
| Varios bienes de capital                 | 0,61         |
| Comercio minorista y grandes almacenes   | 0,59         |
| Sociedades inmobiliarias                 | 0,55         |
| Química                                  | 0,53         |
| Industrias agro-alimentarias             | 0,51         |
| Biotecnología                            | 0,38         |
| Industria aeronáutica y espacial         | 0,33         |
| Servicios del medio ambiente & reciclado | 0,25         |
| Construcción, material de construcción   | 0,17         |
| Restaurantes, hoteles                    | 0,06         |
|                                          | <b>96,23</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Long Term

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |           |        | <b>100.717.757</b>           | <b>98,23</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |           |        | <b>94.929.684</b>            | <b>92,58</b>     |
| <b>Francia</b>                                                                                                                  |           |        | <b>21.703.820</b>            | <b>21,17</b>     |
| AGENCE FRANCAISE DVP 0.25 19-29 29/06A                                                                                          | 500.000   | EUR    | 507.835                      | 0,50             |
| BFCM 1.75 19-29 15/03A                                                                                                          | 100.000   | EUR    | 108.937                      | 0,11             |
| BFCM 2.5 18-28 25/05A                                                                                                           | 200.000   | EUR    | 223.825                      | 0,22             |
| BNP PARIBAS 1.375 19-29 28/05A                                                                                                  | 400.000   | EUR    | 424.532                      | 0,41             |
| BPCE 0.625 20-30 15/01A                                                                                                         | 400.000   | EUR    | 406.946                      | 0,40             |
| BPCE SFH 0.125 21-30 03/12A                                                                                                     | 400.000   | EUR    | 401.712                      | 0,39             |
| CAPGEMINI SE 1.125 20-30 23/06A                                                                                                 | 400.000   | EUR    | 422.262                      | 0,41             |
| CNP ASSURANCES EMTN 2.75 19-29 05/02A                                                                                           | 100.000   | EUR    | 113.844                      | 0,11             |
| COUNCIL OF EURO 0.0000 21-31 20/01A                                                                                             | 500.000   | EUR    | 500.237                      | 0,49             |
| CREDIT AGRICOLE 0.8750 20-32 14/01A                                                                                             | 300.000   | EUR    | 304.880                      | 0,30             |
| CREDIT AGRICOLE 1.3750 17-32 03/02A                                                                                             | 300.000   | EUR    | 338.634                      | 0,33             |
| CREDIT AGRICOLE SA 2.0000 19-29 25/03A                                                                                          | 200.000   | EUR    | 216.057                      | 0,21             |
| ENGIE SA 0.5 19-30 24/10A                                                                                                       | 400.000   | EUR    | 402.884                      | 0,39             |
| FRANCE 0.50 21-44 25/06A                                                                                                        | 403.000   | EUR    | 385.127                      | 0,38             |
| FRANCE 1.50 15-31 25/05A                                                                                                        | 1.350.000 | EUR    | 1.542.287                    | 1,50             |
| FRANCE 1.75 17-39 25/06A                                                                                                        | 4.200.000 | EUR    | 5.099.913                    | 4,97             |
| FRANCE 2.00 17-48 25/05A                                                                                                        | 50.000    | EUR    | 64.398                       | 0,06             |
| FRANCE 4.00 04-55 25/04A                                                                                                        | 811.000   | EUR    | 1.537.311                    | 1,50             |
| FRANCE 4.50 09-41 25/04A                                                                                                        | 300.000   | EUR    | 520.313                      | 0,51             |
| FRANCE OAT 1.5 18-50 25/05A                                                                                                     | 3.500.000 | EUR    | 4.068.470                    | 3,97             |
| GECINA 1.625 19-34 29/05A                                                                                                       | 200.000   | EUR    | 222.280                      | 0,22             |
| GROUPAMA SA 2.125 19-29 16/09A                                                                                                  | 200.000   | EUR    | 210.314                      | 0,21             |
| ICADE SANTE SAS 1.375 20-30 17/09A                                                                                              | 300.000   | EUR    | 315.397                      | 0,31             |
| LA BANQUE POSTALE 0.75 21-31 23/06A                                                                                             | 200.000   | EUR    | 199.230                      | 0,19             |
| LA BANQUE POSTALE 1.375 19-29 24/04A                                                                                            | 100.000   | EUR    | 106.771                      | 0,10             |
| LVMH MOET HENNESSY 0.375 20-31 11/02A                                                                                           | 200.000   | EUR    | 203.126                      | 0,20             |
| RFF S95 3.30 12-42 18/12A                                                                                                       | 600.000   | EUR    | 870.573                      | 0,85             |
| SOCIETE DU GRAND PARI 1.125 19-34 25/05A                                                                                        | 500.000   | EUR    | 540.612                      | 0,53             |
| SOCIETE GENERALE 1.7500 19-29 22/03A                                                                                            | 200.000   | EUR    | 214.562                      | 0,21             |
| SOCIETE GENERALE SFH 0.01 20-30 11/02A                                                                                          | 300.000   | EUR    | 300.071                      | 0,29             |
| SUEZ 1.625 17-32 21/09A                                                                                                         | 200.000   | EUR    | 220.496                      | 0,21             |
| TOTAL CAPITAL INTERN 0.696 19-28 31/05A                                                                                         | 200.000   | EUR    | 207.637                      | 0,20             |
| UNION NAT.INTERPRO.EMP 0.0 20-28 25/11U                                                                                         | 500.000   | EUR    | 502.347                      | 0,49             |
| <b>Italia</b>                                                                                                                   |           |        | <b>15.687.525</b>            | <b>15,30</b>     |
| ASSICURAZIONI GENERALI 2.429 20-31 14/07A                                                                                       | 351.000   | EUR    | 378.762                      | 0,37             |
| AUTOSTRADe PER l'ITAL 2.65 20-28 08/03A                                                                                         | 400.000   | EUR    | 417.434                      | 0,41             |
| BUONI POLIENNAL 2.45 20-50 01/09S                                                                                               | 450.000   | EUR    | 515.635                      | 0,50             |
| ENI 0.375 21-28 14/06A                                                                                                          | 100.000   | EUR    | 100.324                      | 0,10             |
| ENI SPA 0.625 20-30 23/01A                                                                                                      | 339.000   | EUR    | 342.107                      | 0,33             |
| INTESA SANPAOLO 1.75 19-29 04/07A                                                                                               | 317.000   | EUR    | 339.865                      | 0,33             |
| INTESA SANPAOLO SPA 1.75 18-28 20/03A                                                                                           | 100.000   | EUR    | 106.917                      | 0,10             |
| ITALY 1.65 15-32 01/03S                                                                                                         | 850.000   | EUR    | 917.932                      | 0,90             |
| ITALY 2.95 17-38 01/09S                                                                                                         | 1.100.000 | EUR    | 1.363.753                    | 1,33             |
| ITALY 3.25 14-46 01/09S                                                                                                         | 2.150.000 | EUR    | 2.826.369                    | 2,76             |
| ITALY 5.00 03-34 01/08S                                                                                                         | 1.788.000 | EUR    | 2.636.406                    | 2,57             |
| ITALY 5.00 07-39 01/08S                                                                                                         | 1.000.000 | EUR    | 1.574.270                    | 1,54             |
| ITALY 6.00 00-31 01/05S                                                                                                         | 1.900.000 | EUR    | 2.846.153                    | 2,78             |
| ITALY BUONI POLIENNALI 0.95 20-30 01/08S                                                                                        | 300.000   | EUR    | 306.663                      | 0,30             |
| SNAM SPA 0.00 20-28 07/12A                                                                                                      | 300.000   | EUR    | 290.547                      | 0,28             |
| TERNA SPA 0.75 20-32 24/09S                                                                                                     | 300.000   | EUR    | 300.406                      | 0,29             |
| TRASMISSIONE ELETTRI 0.375 21-29 23/06A                                                                                         | 112.000   | EUR    | 112.020                      | 0,11             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Long Term

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| UNICREDIT SPA 1.8000 20-30 20/01A        | 300.000   | EUR    | 311.962                      | 0,30             |
| <b>España</b>                            |           |        | <b>10.289.897</b>            | <b>10,04</b>     |
| ADIF ALTA VELOC 0.5500 20-30 30/04A      | 200.000   | EUR    | 202.287                      | 0,20             |
| CAIXABANK SA 0.50 21-29 09/02A           | 300.000   | EUR    | 295.788                      | 0,29             |
| CAIXABANK SA 0.7500 21-28 26/05A         | 300.000   | EUR    | 301.989                      | 0,29             |
| CORES 1.7500 17-27 24/11A                | 100.000   | EUR    | 110.032                      | 0,11             |
| SPAIN 1.45 19-29 29/01A                  | 576.000   | EUR    | 634.182                      | 0,62             |
| SPAIN 1.95 15-30 30/07A                  | 900.000   | EUR    | 1.032.817                    | 1,01             |
| SPAIN 2.35 17-33 30/07A                  | 1.500.000 | EUR    | 1.804.073                    | 1,76             |
| SPAIN 2.90 16-46 31/10A                  | 1.150.000 | EUR    | 1.554.058                    | 1,51             |
| SPAIN 4.90 07-40 30/07A                  | 800.000   | EUR    | 1.341.856                    | 1,31             |
| SPAIN 5.15 13-44 31/10A                  | 1.600.000 | EUR    | 2.892.264                    | 2,82             |
| TELEFONICA EMISIONES 2.932 14-29 17/10A  | 100.000   | EUR    | 120.551                      | 0,12             |
| <b>Países Bajos</b>                      |           |        | <b>7.569.032</b>             | <b>7,38</b>      |
| ASML HOLDING NV 0.6250 20-29 07/05A      | 532.000   | EUR    | 549.032                      | 0,54             |
| HEINEKEN NV 1.75 18-31 17/03A            | 400.000   | EUR    | 447.392                      | 0,44             |
| ING GROEP NV 2.5000 18-30 15/11A         | 200.000   | EUR    | 238.395                      | 0,23             |
| NEDER WATERSCHAPSBANK 1.25 17-32 07/06A  | 700.000   | EUR    | 784.280                      | 0,77             |
| NETHERLANDS 0.00 20-30 15/07A            | 1.100.000 | EUR    | 1.117.958                    | 1,09             |
| NETHERLANDS 0.25 19-29 14/02A            | 1.500.000 | EUR    | 1.562.250                    | 1,52             |
| NETHERLANDS 3.75 10-42 15/01A            | 800.000   | EUR    | 1.373.712                    | 1,34             |
| ROYAL PHILIPS NV 2.00 20-30 30/03A       | 100.000   | EUR    | 113.476                      | 0,11             |
| SIEMENS FINANCIERING 1.75 19-39 28/02A   | 300.000   | EUR    | 347.196                      | 0,34             |
| SIEMENS FIN NV 0.50 19-34 05/09A         | 200.000   | EUR    | 199.524                      | 0,19             |
| TELEFONICA EUROPE BV 2.376 21-99 31/12A  | 200.000   | EUR    | 195.837                      | 0,19             |
| VOLKSWAGEN INTL 1.2500 20-32 23/09A      | 100.000   | EUR    | 104.826                      | 0,10             |
| VONOVIA FINANCE 0.5000 19-29 14/09A      | 100.000   | EUR    | 99.746                       | 0,10             |
| VW INTL FINANCE 1.625 15-30 16/01A       | 400.000   | EUR    | 435.408                      | 0,42             |
| <b>Estados Unidos de América</b>         |           |        | <b>6.720.177</b>             | <b>6,55</b>      |
| ABBVIE INC 1.25 19-31 18/11A             | 400.000   | EUR    | 421.206                      | 0,41             |
| APPLE INC 0.5 19-31 15/11A               | 300.000   | EUR    | 304.789                      | 0,30             |
| AT&T INC 2.60 14-29 17/12A               | 600.000   | EUR    | 694.449                      | 0,68             |
| BIRD 1.50 16-36 14/01A                   | 500.000   | EUR    | 580.063                      | 0,57             |
| BUONI POLIENNAL 1.5000 21-45 30/04S      | 385.000   | EUR    | 374.528                      | 0,36             |
| CITIGROUP EMTN 1.50 16-28 26/10A         | 400.000   | EUR    | 430.858                      | 0,42             |
| EQUINIX INC 0.2500 21-27 15/03A          | 217.000   | EUR    | 215.681                      | 0,21             |
| IBM CORP 0.3 20-21 11/02A                | 200.000   | EUR    | 200.754                      | 0,20             |
| IBM CORP 1.75 19-31 31/01A               | 500.000   | EUR    | 557.015                      | 0,54             |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC 1.0 19-31 25/06A | 200.000   | EUR    | 211.851                      | 0,21             |
| INTL BK FOR RECONS 0.00 20-30 21/02U     | 500.000   | EUR    | 500.512                      | 0,49             |
| JOHNSON A JOHNSON 1.65 16-35 20/05A      | 200.000   | EUR    | 229.344                      | 0,22             |
| KELLOGG CO 0.5000 21-29 20/05A           | 184.000   | EUR    | 184.156                      | 0,18             |
| MCDONALD'S CORP 1.6000 19-31 15/03A      | 300.000   | EUR    | 329.274                      | 0,32             |
| MONDELEZ INTERNATIONAL 0.25 21-28 17/03A | 391.000   | EUR    | 388.736                      | 0,38             |
| PROLOGIS LP 1.625 20-32 17/06A           | 125.000   | EUR    | 135.386                      | 0,13             |
| THERMO FISHER SCIEN 0.50 19-28 01/03A    | 268.000   | EUR    | 271.128                      | 0,26             |
| VERIZON COMMUNICATION 1.875 17-29 26/10A | 400.000   | EUR    | 443.516                      | 0,43             |
| VERIZON COMMUNICATION 2.875 17-38 15/01A | 200.000   | EUR    | 246.931                      | 0,24             |
| <b>Bélgica</b>                           |           |        | <b>6.556.573</b>             | <b>6,40</b>      |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV 1.50 15-30 18/04A   | 300.000   | EUR    | 326.619                      | 0,32             |
| BELGIUM 1.25 18-33 22/04A                | 900.000   | EUR    | 1.015.299                    | 0,99             |
| BELGIUM 1.7 19-50 05/02A                 | 600.000   | EUR    | 725.457                      | 0,71             |
| BELGIUM 3.75 13-45 22/06A                | 800.000   | EUR    | 1.330.428                    | 1,30             |
| BELGIUM 4.25 10-41 28/03A                | 1.050.000 | EUR    | 1.764.346                    | 1,72             |
| COMMUNAUTE EUROPEENNE 0.00 20-30 04/10A  | 300.000   | EUR    | 301.025                      | 0,29             |
| EUROPEAN UNION 0.00 21-31 04/07A         | 280.000   | EUR    | 279.565                      | 0,27             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Long Term

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| KBC GROUP NV 0.7500 20-30 24/01A         | 400.000   | EUR    | 410.048                      | 0,40             |
| UCB SA 1.0000 21-28 30/03A               | 400.000   | EUR    | 403.786                      | 0,40             |
| <b>Alemania</b>                          |           |        | <b>6.451.379</b>             | <b>6,29</b>      |
| ADIDAS AG 0.00 20-28 05/10U              | 200.000   | EUR    | 198.698                      | 0,19             |
| DAILMLER AG 0.75 19-30 08/02A            | 300.000   | EUR    | 307.335                      | 0,30             |
| DEUTSCHE TELEKOM AG 1.75 19-31 25/03A    | 500.000   | EUR    | 561.052                      | 0,55             |
| GERMANY 2.50 12-44 04/07A                | 300.000   | EUR    | 460.437                      | 0,45             |
| GERMANY 3.25 10-42 04/07A                | 750.000   | EUR    | 1.243.114                    | 1,21             |
| GERMANY 4.75 08-40 04/07A                | 300.000   | EUR    | 568.394                      | 0,55             |
| KFW 0.375 15-30 23/04A                   | 680.000   | EUR    | 706.921                      | 0,69             |
| LAND BERLIN 0.75 19-34 03/04A            | 600.000   | EUR    | 635.295                      | 0,62             |
| LAND NORDRHEIN- 0.5000 19-39 25/11A      | 100.000   | EUR    | 100.337                      | 0,10             |
| LANDWIRT RENTENBANK 0.625 16-36 31/10A   | 400.000   | EUR    | 415.862                      | 0,40             |
| STATE OF RHINELAND 0.05 20-30 23/01A     | 800.000   | EUR    | 805.528                      | 0,79             |
| STATE OF SCHLESWIG-HO 0.200 19-39 15/08A | 471.000   | EUR    | 448.406                      | 0,44             |
| <b>Luxemburgo</b>                        |           |        | <b>5.932.396</b>             | <b>5,79</b>      |
| BEI 1.75 14-45 15/09A                    | 500.000   | EUR    | 632.505                      | 0,62             |
| DH EUROPE FIN 0.45 19-28 18/03A          | 281.000   | EUR    | 283.487                      | 0,28             |
| DH EUROPE FIN 0.75 19-31 18/09A          | 400.000   | EUR    | 400.818                      | 0,39             |
| EIB 1.125 17-33 13/04A                   | 1.300.000 | EUR    | 1.444.339                    | 1,41             |
| ESM 1.125 16-32 03/05A                   | 400.000   | EUR    | 444.546                      | 0,43             |
| EUROPEAN FINANCIAL 0.7 20-50 20/01A      | 500.000   | EUR    | 508.660                      | 0,49             |
| EUROPEAN FINANCIAL 0.875 19-35 10/04A    | 600.000   | EUR    | 646.158                      | 0,63             |
| EUROPEAN UNION 1.375 14-29 04/10A        | 300.000   | EUR    | 337.322                      | 0,33             |
| MEDTRONIC GLOBAL HOLD 1.00 19-31 02/07A  | 500.000   | EUR    | 520.762                      | 0,51             |
| NESTLE FINANCE 0.00 20-33 03/03U         | 343.000   | EUR    | 324.140                      | 0,32             |
| PROLOGIS INTL FUND II 0.75 21-33 23/03A  | 397.000   | EUR    | 389.659                      | 0,38             |
| <b>Austria</b>                           |           |        | <b>3.015.999</b>             | <b>2,94</b>      |
| AUSTRIA 0.75 20-51 20/03A                | 700.000   | EUR    | 723.814                      | 0,71             |
| AUSTRIA 1.50 16-47 20/02A                | 730.000   | EUR    | 896.093                      | 0,87             |
| AUSTRIA 3.80 12-62 26/01A                | 140.000   | EUR    | 291.663                      | 0,28             |
| AUSTRIA 4.15 06-37 15/03A                | 500.000   | EUR    | 800.182                      | 0,78             |
| OMV AG 1.00 19-24 03/07A                 | 300.000   | EUR    | 304.247                      | 0,30             |
| <b>Portugal</b>                          |           |        | <b>1.626.281</b>             | <b>1,59</b>      |
| ENERGIAS DE PORTUGAL 1.70 20-80 20/07A   | 200.000   | EUR    | 201.400                      | 0,20             |
| PORTUGAL 4.10 06-37 15/04A               | 950.000   | EUR    | 1.424.881                    | 1,39             |
| <b>Canadá</b>                            |           |        | <b>1.387.096</b>             | <b>1,35</b>      |
| CPPIB CAPITAL INC 0.75 19-49 15/07A      | 400.000   | EUR    | 396.596                      | 0,39             |
| QUEBEC 0.00 19-29 15/10U                 | 1.000.000 | EUR    | 990.500                      | 0,96             |
| <b>Australia</b>                         |           |        | <b>1.044.899</b>             | <b>1,02</b>      |
| MACQUARIE GROUP 0.35 20-28 03/03A        | 232.000   | EUR    | 228.449                      | 0,22             |
| MACQUARIE GROUP LTD 0.95 21-31 21/05A    | 400.000   | EUR    | 399.006                      | 0,39             |
| TELSTRA CORP LTD 1.00 20-30 23/04A       | 400.000   | EUR    | 417.444                      | 0,41             |
| <b>Rumanía</b>                           |           |        | <b>1.017.555</b>             | <b>0,99</b>      |
| ROMANIA 2.124 19-31 16/07A               | 800.000   | EUR    | 827.600                      | 0,81             |
| ROMANIAN GOVT INTL BD 2.0 21-33 14/04A   | 191.000   | EUR    | 189.955                      | 0,18             |
| <b>Irlanda</b>                           |           |        | <b>1.010.797</b>             | <b>0,99</b>      |
| IRELAND 1.70 17-37 15/05A                | 600.000   | EUR    | 713.682                      | 0,70             |
| KERRY GROUP FIN SERV 0.625 19-29 20/09A  | 294.000   | EUR    | 297.115                      | 0,29             |
| <b>Finlandia</b>                         |           |        | <b>976.841</b>               | <b>0,95</b>      |
| FINLAND 0.75 15-31 15/04A                | 400.000   | EUR    | 431.106                      | 0,42             |
| FINLAND 1.375 17-47 15/04A               | 320.000   | EUR    | 391.201                      | 0,38             |
| KOJAMO OYJ 0.875 21-29 28/05A            | 154.000   | EUR    | 154.534                      | 0,15             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Long Term

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                            | Cantidad | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|-----------------------------------------|----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Reino Unido</b>                      |          |        | <b>836.118</b>               | <b>0,82</b>      |
| BP CAPITAL MARKETS 1.231 19-31 08/05A   | 100.000  | EUR    | 104.364                      | 0,10             |
| BP CAPITAL MARKETS 3.625 20-XX 22/06A   | 200.000  | EUR    | 217.986                      | 0,21             |
| CREDIT AGRICOLE 1.00 19-29 03/07A       | 200.000  | EUR    | 211.058                      | 0,21             |
| HSBC HOLDINGS PLC 4.00 21-99 31/12S     | 352.000  | USD    | 302.710                      | 0,30             |
| <b>México</b>                           |          |        | <b>649.553</b>               | <b>0,63</b>      |
| MEXICO 1.45 21-33 25/10S                | 192.000  | EUR    | 183.779                      | 0,18             |
| MEXICO 3.375 16-31 23/02A               | 400.000  | EUR    | 465.774                      | 0,45             |
| <b>Filipinas</b>                        |          |        | <b>556.792</b>               | <b>0,54</b>      |
| PHILIPPINES 1.20 21-33 28/04A           | 556.000  | EUR    | 556.792                      | 0,54             |
| <b>Eslovenia</b>                        |          |        | <b>434.796</b>               | <b>0,42</b>      |
| SLOVENIA 0.1250 21-31 01/07A            | 186.000  | EUR    | 185.889                      | 0,18             |
| SLOVENIA 0.275 20-30 17/02A             | 243.000  | EUR    | 248.907                      | 0,24             |
| <b>Dinamarca</b>                        |          |        | <b>403.878</b>               | <b>0,39</b>      |
| CARLSBERG BREWERIES 0.625 20-30 09/03A  | 400.000  | EUR    | 403.878                      | 0,39             |
| <b>Suiza</b>                            |          |        | <b>282.524</b>               | <b>0,28</b>      |
| CREDIT SUISSE 0.625 21-33 18/01A        | 300.000  | EUR    | 282.524                      | 0,28             |
| <b>Japón</b>                            |          |        | <b>239.578</b>               | <b>0,23</b>      |
| TAKEDA PHARMACEUTICAL 3.00 18-30 21/11A | 200.000  | EUR    | 239.578                      | 0,23             |
| <b>Indonesia</b>                        |          |        | <b>237.938</b>               | <b>0,23</b>      |
| INDONESIA REGS 3.75 16-28 14/06A        | 200.000  | EUR    | 237.938                      | 0,23             |
| <b>Estonia</b>                          |          |        | <b>185.467</b>               | <b>0,18</b>      |
| ESTONIA 0.125 20-30 10/06A              | 185.000  | EUR    | 185.467                      | 0,18             |
| <b>Emiratos Arabes Unidos</b>           |          |        | <b>112.773</b>               | <b>0,11</b>      |
| EMIRATES TELECO 0.3750 21-28 17/05A     | 112.000  | EUR    | 112.773                      | 0,11             |
| <b>Obligaciones convertibles</b>        |          |        | <b>1.582.251</b>             | <b>1,55</b>      |
| <b>Francia</b>                          |          |        | <b>1.093.627</b>             | <b>1,07</b>      |
| EDENRED SA CV 0.00 19-24 06/09U         | 5.000    | EUR    | 314.490                      | 0,31             |
| VEOLIA ENV CV 0.00 19-25 01/01U         | 10.000   | EUR    | 322.495                      | 0,31             |
| WORLDLINE SA DIRTY CV 0.00 19-26 30/07U | 4.000    | EUR    | 456.642                      | 0,45             |
| <b>Alemania</b>                         |          |        | <b>488.624</b>               | <b>0,48</b>      |
| DEUTSCHE POST AG CV 0.05 17-25 30/06A   | 400.000  | EUR    | 488.624                      | 0,48             |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>    |          |        | <b>4.205.822</b>             | <b>4,10</b>      |
| <b>Alemania</b>                         |          |        | <b>1.226.405</b>             | <b>1,20</b>      |
| ALLIANZ SE FL.R 20-XX XX/XXA            | 200.000  | USD    | 174.687                      | 0,17             |
| GERMANY INDEX 0.1 21-33 15/04A          | 700.000  | EUR    | 848.442                      | 0,83             |
| MUNICH RE FLR 20-41 26/05A              | 200.000  | EUR    | 203.276                      | 0,20             |
| <b>Países Bajos</b>                     |          |        | <b>1.212.545</b>             | <b>1,18</b>      |
| COOPERATIVE RABOBANK FL.R 18-XX XX/XXS  | 600.000  | EUR    | 660.285                      | 0,64             |
| NN GROUP NV FL.R 17-48 13/01A           | 283.000  | EUR    | 337.779                      | 0,33             |
| REPSOL INTL FINANCE FL.R 20-49 31/12A   | 200.000  | EUR    | 214.481                      | 0,21             |
| <b>Francia</b>                          |          |        | <b>1.077.825</b>             | <b>1,05</b>      |
| AXA SA FL.R 21-41 07/10A                | 457.000  | EUR    | 457.153                      | 0,45             |
| CREDIT MUTUEL ARKEA FL.R 20-29 11/06A   | 200.000  | EUR    | 208.698                      | 0,20             |
| ELECTRICITE DE FRANCE FL.R 19-XX XX/XXA | 200.000  | EUR    | 207.310                      | 0,20             |
| ORANGE SA FL.R 20-49 31/12A             | 200.000  | EUR    | 204.664                      | 0,20             |

## Candriam Bonds

### Candriam Bonds Euro Long Term

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                           | Cantidad | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------------------|----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Bélgica</b>                                         |          |        | <b>396.508</b>               | <b>0,39</b>      |
| BELFIUS BANK SA FL.R 18-XX XX/XXS                      | 400.000  | EUR    | 396.508                      | 0,39             |
| <b>Estados Unidos de América</b>                       |          |        | <b>292.539</b>               | <b>0,28</b>      |
| BANK OF AMERICA CORP FL.R 21-31 22/03A                 | 293.000  | EUR    | 292.539                      | 0,28             |
| <b>Organismos de Inversión Colectiva</b>               |          |        | <b>830.978</b>               | <b>0,81</b>      |
| <b>Acciones/Participaciones en fondos de inversión</b> |          |        | <b>830.978</b>               | <b>0,81</b>      |
| <b>Luxemburgo</b>                                      |          |        | <b>828.012</b>               | <b>0,81</b>      |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO Z EUR C                 | 763      | EUR    | 828.012                      | 0,81             |
| <b>Francia</b>                                         |          |        | <b>2.966</b>                 | <b>0,00</b>      |
| CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV Z EUR C                       | 2        | EUR    | 2.966                        | 0,00             |
| <b>Total de la cartera de valores</b>                  |          |        | <b>101.548.735</b>           | <b>99,04</b>     |
| Coste de adquisición                                   |          |        | 100.324.462                  |                  |

# Candriam Bonds

---

## Candriam Bonds Euro Long Term

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

### Distribución geográfica (en % activo neto)

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| Francia                   | 23,29        |
| Italia                    | 15,30        |
| España                    | 10,04        |
| Países Bajos              | 8,57         |
| Alemania                  | 7,97         |
| Estados Unidos de América | 6,84         |
| Bélgica                   | 6,78         |
| Luxemburgo                | 6,59         |
| Austria                   | 2,94         |
| Portugal                  | 1,59         |
| Canadá                    | 1,35         |
| Australia                 | 1,02         |
| Irlanda                   | 0,99         |
| Rumanía                   | 0,99         |
| Finlandia                 | 0,95         |
| Reino Unido               | 0,82         |
| México                    | 0,63         |
| Filipinas                 | 0,54         |
| Eslovenia                 | 0,42         |
| Dinamarca                 | 0,39         |
| Suiza                     | 0,28         |
| Indonesia                 | 0,23         |
| Japón                     | 0,23         |
| Estonia                   | 0,18         |
| Emiratos Arabes Unidos    | 0,11         |
|                           | <b>99,04</b> |

### Distribución económica (en % activo neto)

|                                                                |              |
|----------------------------------------------------------------|--------------|
| Obligaciones del Estado, de las provincias y de los municipios | 57,74        |
| Bancos y otras entidades financieras                           | 9,90         |
| Organizaciones supranacionales                                 | 5,06         |
| Holdings y entidades financieras                               | 5,03         |
| Telecomunicaciones                                             | 2,92         |
| Energía y servicio de aguas                                    | 2,01         |
| Seguros                                                        | 1,83         |
| Farmacia y cosméticos                                          | 1,77         |
| Transporte                                                     | 1,61         |
| Servicios varios                                               | 1,30         |
| Tabaco y alcohol                                               | 1,15         |
| Sociedades inmobiliarias                                       | 1,12         |
| Artículos de oficina y ordenadores                             | 1,04         |
| Servicios sociales y de sanidad pública                        | 0,96         |
| Electrónica y semiconductores                                  | 0,91         |
| Varios                                                         | 0,85         |
| Petróleo                                                       | 0,84         |
| Fondos de inversión                                            | 0,81         |
| Industrias agro-alimentarias                                   | 0,56         |
| Internet y servicios de Internet                               | 0,41         |
| Textiles y vestido                                             | 0,39         |
| Restaurantes, hoteles                                          | 0,32         |
| Industria automovilística                                      | 0,30         |
| Construcción de máquinas y aparatos                            | 0,21         |
|                                                                | <b>99,04</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Short Term

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |            |        | <b>1.412.109.093</b>         | <b>97,36</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |            |        | <b>1.218.741.269</b>         | <b>84,03</b>     |
| <b>Italia</b>                                                                                                                   |            |        | <b>268.006.521</b>           | <b>18,48</b>     |
| ACEA SPA 0.0000 21-25 28/09A                                                                                                    | 1.400.000  | EUR    | 1.400.427                    | 0,10             |
| ASSICURAZ GENERALI 7.75 12-42 12/12A                                                                                            | 6.000.000  | EUR    | 6.675.810                    | 0,46             |
| BUONI POLIENNALI DEL 1.8500 20-25 01/07S                                                                                        | 10.000.000 | EUR    | 10.752.800                   | 0,74             |
| ENI EMTN 3.25 13-23 10/07A                                                                                                      | 4.000.000  | EUR    | 4.288.300                    | 0,30             |
| INTESA SANPAOLO 0.75 19-24 04/12A                                                                                               | 3.113.000  | EUR    | 3.193.642                    | 0,22             |
| INTESA SANPAOLO 1.0000 19-24 04/07A                                                                                             | 7.440.000  | EUR    | 7.663.609                    | 0,53             |
| INTESA SANPAOLO 1.125 15-22 04/03A                                                                                              | 2.000.000  | EUR    | 2.019.770                    | 0,14             |
| ITALGAS SPA 0.2500 20-25 24/06A                                                                                                 | 3.000.000  | EUR    | 3.019.155                    | 0,21             |
| ITALY 0.95 18-23 01/03S                                                                                                         | 72.500.000 | EUR    | 74.124.363                   | 5,11             |
| ITALY 1.00 19-22 15/07S                                                                                                         | 4.000.000  | EUR    | 4.060.320                    | 0,28             |
| ITALY 1.45 18-25 15-05S                                                                                                         | 3.000.000  | EUR    | 3.176.220                    | 0,22             |
| ITALY 4.75 08-23 01/08S                                                                                                         | 65.000.000 | EUR    | 71.943.625                   | 4,96             |
| ITALY BTP 0.65 16-23 15/10S                                                                                                     | 9.000.000  | EUR    | 9.198.945                    | 0,63             |
| ITALY BUONI POLIENNALI 0.00 20-24 15/01S                                                                                        | 45.000.000 | EUR    | 45.286.650                   | 3,12             |
| SNAM SPA 0.00 19-24 12/05A                                                                                                      | 6.474.000  | EUR    | 6.501.320                    | 0,45             |
| TERNA SPA 1.00 18-23 23/07A                                                                                                     | 4.000.000  | EUR    | 4.107.640                    | 0,28             |
| UNICREDIT SPA 1.00 18-23 18/01A                                                                                                 | 2.000.000  | EUR    | 2.034.440                    | 0,14             |
| UNICREDIT SPA 2.00 16-23 04/03A                                                                                                 | 3.000.000  | EUR    | 3.106.935                    | 0,21             |
| UNICREDIT SPA REGS 6.95 12-22 31/10A                                                                                            | 5.000.000  | EUR    | 5.452.550                    | 0,38             |
| <b>Francia</b>                                                                                                                  |            |        | <b>181.200.848</b>           | <b>12,49</b>     |
| ALD SA 0.375 19-23 18/07A                                                                                                       | 3.000.000  | EUR    | 3.031.350                    | 0,21             |
| APRR SA 0.00 20-23 20/01A                                                                                                       | 7.800.000  | EUR    | 7.846.878                    | 0,54             |
| AXA SA 5.125 13-43 04/07A                                                                                                       | 12.000.000 | EUR    | 13.208.760                   | 0,91             |
| BANQUE FEDERATIVE 0.65 20-24 27/02S                                                                                             | 2.071.000  | USD    | 1.743.314                    | 0,12             |
| BFCM 0.125 19-24 05/02Y                                                                                                         | 5.000.000  | EUR    | 5.043.750                    | 0,35             |
| BFCM 0.50 18-22 16/11A                                                                                                          | 5.100.000  | EUR    | 5.167.218                    | 0,36             |
| BNP PARIBAS 1.125 16-23 15/01A                                                                                                  | 7.000.000  | EUR    | 7.161.805                    | 0,49             |
| BNP PARIBAS 1.125 17-23 10/10A                                                                                                  | 7.000.000  | EUR    | 7.212.870                    | 0,50             |
| BPCE SA 1.125 17-23 18/01A                                                                                                      | 5.000.000  | EUR    | 5.105.150                    | 0,35             |
| CAPGEMINI SE 0.50 16-21 09/11A                                                                                                  | 2.000.000  | EUR    | 2.001.820                    | 0,14             |
| CAPGEMINI SE 0.6250 20-25 23/06A                                                                                                | 4.200.000  | EUR    | 4.306.407                    | 0,30             |
| CAPGEMINI SE 2.50 15-23 01/07A                                                                                                  | 6.000.000  | EUR    | 6.288.780                    | 0,43             |
| CARREFOUR BANQUE 0.107 21-25 14/06A                                                                                             | 2.300.000  | EUR    | 2.304.922                    | 0,16             |
| CARREFOUR SA 0.875 18-23 12/06A                                                                                                 | 6.000.000  | EUR    | 6.111.480                    | 0,42             |
| CNP ASSUR. 1.875 16-22 20/10A                                                                                                   | 6.900.000  | EUR    | 7.078.330                    | 0,49             |
| DANONE SA 0.424 16-22 03/11A                                                                                                    | 3.000.000  | EUR    | 3.027.570                    | 0,21             |
| DANONE SA EMTN 0.00 21-25 01/12A                                                                                                | 4.000.000  | EUR    | 4.019.340                    | 0,28             |
| DASSAULT SYSTEM 0.00 19-22 16/09U                                                                                               | 4.400.000  | EUR    | 4.418.678                    | 0,30             |
| DASSAULT SYSTEM 0.00 19-24 16/09A                                                                                               | 1.600.000  | EUR    | 1.609.712                    | 0,11             |
| EDF SA 2.75 12-23 10/03A                                                                                                        | 4.000.000  | EUR    | 4.206.180                    | 0,29             |
| ENGIE 0.375 17-23 28/02A                                                                                                        | 6.000.000  | EUR    | 6.058.530                    | 0,42             |
| ESSILORLUXOTTIC 0.00 19-23 27/05U                                                                                               | 3.000.000  | EUR    | 3.018.225                    | 0,21             |
| KERING 0.2500 20-23 13/05A                                                                                                      | 7.000.000  | EUR    | 7.069.650                    | 0,49             |
| KLEPIERRE EMTN 1.00 15-23 17/04A                                                                                                | 8.000.000  | EUR    | 8.153.320                    | 0,56             |
| ORANGE 1.00 16-25 12/05A                                                                                                        | 2.000.000  | EUR    | 2.082.610                    | 0,14             |
| ORANGE 3.125 13-24 09/01A                                                                                                       | 2.000.000  | EUR    | 2.172.000                    | 0,15             |
| ORANGE SA 0.75 17-23 11/09A                                                                                                     | 6.000.000  | EUR    | 6.127.260                    | 0,42             |
| PERNOD RICARD SA 0.00 19-23 24/10U                                                                                              | 5.800.000  | EUR    | 5.830.015                    | 0,40             |
| PSA BANQUE FRAN 0.6250 19-24 21/06A                                                                                             | 3.574.000  | EUR    | 3.637.313                    | 0,25             |
| SAFRAN SA 0.1250 21-26 16/03A                                                                                                   | 4.700.000  | EUR    | 4.711.257                    | 0,32             |
| SCHNEIDER ELECT 0.00 20-23 12/06U                                                                                               | 7.300.000  | EUR    | 7.350.115                    | 0,51             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Short Term

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| SODEXO SA 0.5000 20-24 17/01A            | 3.542.000  | EUR    | 3.601.931                    | 0,25             |
| TOTAL CAPITAL EMTN 2.125 12-23 15/03A    | 700.000    | EUR    | 730.548                      | 0,05             |
| TOTAL CAPITAL SA 0.25 16-23 12/07A       | 5.000.000  | EUR    | 5.061.700                    | 0,35             |
| TOTAL SE FL.R 16-XX 05/05A               | 4.000.000  | EUR    | 4.168.940                    | 0,29             |
| UNIBAIL RODAMCO 2.50 14-24 26/02A        | 6.000.000  | EUR    | 6.437.640                    | 0,44             |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT 0.892 19-24 14/01A  | 4.000.000  | EUR    | 4.095.480                    | 0,28             |
| <b>Estados Unidos de América</b>         |            |        | <b>151.713.884</b>           | <b>10,46</b>     |
| AMERICAN HONDA 0.35 19-22 26/02A         | 10.149.000 | EUR    | 10.235.825                   | 0,71             |
| APPLE INC 1.00 14-22 10/11A              | 6.000.000  | EUR    | 6.117.600                    | 0,42             |
| AT&T INC 1.30 15-23 05/09A               | 4.000.000  | EUR    | 4.114.220                    | 0,28             |
| AT&T INC 1.45 14-22 01/06A               | 3.000.000  | EUR    | 3.035.430                    | 0,21             |
| AT&T INC 2.50 13-23 15/03A               | 3.000.000  | EUR    | 3.120.705                    | 0,22             |
| BANK OF AMERICA CORP 0.75 16-23 26/07A   | 10.000.000 | EUR    | 10.204.250                   | 0,70             |
| CITIGROUP 0.75 16-23 26/10A              | 7.000.000  | EUR    | 7.136.535                    | 0,49             |
| EXXON MOBIL COR 0.1420 20-24 26/06A      | 4.027.000  | EUR    | 4.061.169                    | 0,28             |
| FIDELITY NATL I 0.1250 19-22 03/12A      | 3.000.000  | EUR    | 3.015.090                    | 0,21             |
| FISERV INC 0.3750 19-23 01/07A           | 3.065.000  | EUR    | 3.095.006                    | 0,21             |
| GOLDMAN SACHS G 0.1250 19-24 19/08A      | 4.889.000  | EUR    | 4.904.620                    | 0,34             |
| HONEYWELL INTERNATIONAL 0.0 20-24 10/03A | 2.000.000  | EUR    | 2.009.850                    | 0,14             |
| IBM 1.25 14-23 26/05A                    | 4.000.000  | EUR    | 4.117.980                    | 0,28             |
| ILLINOIS TOOL WORKS 1.25 15-23 22/05A    | 2.000.000  | EUR    | 2.050.870                    | 0,14             |
| JPM CHASE BK NA 2.75 13-23 01/02A        | 7.000.000  | EUR    | 7.345.800                    | 0,51             |
| JPMORGAN CHASE & CO 0.625 16-24 25/01A   | 1.000.000  | EUR    | 1.019.055                    | 0,07             |
| JPMORGAN CHASE 1.50 15-22 26/10A         | 3.500.000  | EUR    | 3.589.180                    | 0,25             |
| MASTERCARD 1.10 15-22 01/12S             | 10.000.000 | EUR    | 10.174.200                   | 0,70             |
| MC DONALD S 1.125 15-22 26/05A           | 2.000.000  | EUR    | 2.026.210                    | 0,14             |
| MCKESSON CORP 0.625 17-21 17/08A         | 4.000.000  | EUR    | 4.000.200                    | 0,28             |
| MORGAN STANLEY 0.5290 21-24 25/01S       | 2.710.000  | USD    | 2.284.567                    | 0,16             |
| MORGAN STANLEY 1.00 16-22 02/12A         | 2.000.000  | EUR    | 2.037.000                    | 0,14             |
| MORGAN STANLEY 1.875 14-23 30/03A        | 9.000.000  | EUR    | 9.337.140                    | 0,64             |
| NATIONAL GRID 0.75 18-23 08/08A          | 2.921.000  | EUR    | 2.975.068                    | 0,21             |
| PEPSI 0.25 20-24 06/05A                  | 3.410.000  | EUR    | 3.462.804                    | 0,24             |
| PRAXAIR INC 1.20 16-24 12/02A            | 2.000.000  | EUR    | 2.076.620                    | 0,14             |
| PROCTER GAMB REGS 2.00 12-22 16/08A      | 5.000.000  | EUR    | 5.140.625                    | 0,35             |
| SODEXO INC 1.634 21-26 16/04S            | 8.000.000  | USD    | 6.793.895                    | 0,47             |
| STRYKER CORP 0.25 19-24 03/12A           | 6.435.000  | EUR    | 6.502.246                    | 0,45             |
| STRYKER CORP 0.60 20-23 01/12S           | 900.000    | USD    | 758.944                      | 0,05             |
| TOYOTA MOTOR CREDIT 0.75 15-22 21/07A    | 1.000.000  | EUR    | 1.012.465                    | 0,07             |
| VERIZON COMMUNICATION 1.625 14-24 01/03A | 7.000.000  | EUR    | 7.325.255                    | 0,50             |
| VOLKSWAGEN GROU 1.2500 20-25 24/11S      | 2.935.000  | USD    | 2.463.120                    | 0,17             |
| WELLS FARGO CO 2.25 13-23 02/05A         | 3.000.000  | EUR    | 3.136.410                    | 0,22             |
| WELLS FARGO REGS 2.625 12-22 16/08A      | 1.000.000  | EUR    | 1.033.930                    | 0,07             |
| <b>Países Bajos</b>                      |            |        | <b>125.185.406</b>           | <b>8,63</b>      |
| ABN AMRO BANK 1.25 20-25 28/05A          | 4.500.000  | EUR    | 4.703.603                    | 0,32             |
| ABN AMRO BANK SUB 2.875 16-28 18/01A     | 6.000.000  | EUR    | 6.256.890                    | 0,43             |
| ADECCO SA 1.50 15-22 22/11A              | 2.000.000  | EUR    | 2.039.430                    | 0,14             |
| ASML HOLDING NV 0.625 16-22 07/07S       | 3.000.000  | EUR    | 3.023.490                    | 0,21             |
| ASML HOLDING NV 3.375 13-23 19/09A       | 3.000.000  | EUR    | 3.249.495                    | 0,22             |
| BMW FINANCE 2.375 13-23 24/01A           | 2.000.000  | EUR    | 2.087.230                    | 0,14             |
| BMW FINANCE 2.625 14-24 17/01A           | 2.000.000  | EUR    | 2.147.140                    | 0,15             |
| BMW FINANCE NV 0.0000 21-26 11/01A       | 3.871.000  | EUR    | 3.877.097                    | 0,27             |
| BMW FINANCE NV 1.25 14-22 05/09A         | 2.000.000  | EUR    | 2.039.510                    | 0,14             |
| CRH FUNDING 1.875 15-24 09/01A           | 2.000.000  | EUR    | 2.093.760                    | 0,15             |
| DAIMLER INTERNATIONAL 0.625 19-23 27/02A | 4.000.000  | EUR    | 4.062.100                    | 0,28             |
| DEUTSCHE TEL.INTL FIN 0.625 16-23 03/04A | 7.000.000  | EUR    | 7.113.085                    | 0,49             |
| DT ANNINGTON FINANCE 2.125 14-22 09/07A  | 2.000.000  | EUR    | 2.049.510                    | 0,14             |
| EDP FINANCE 2.375 16-23 23/03A           | 5.000.000  | EUR    | 5.229.750                    | 0,36             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Short Term

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                            | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|-----------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| ENEL FIN INTL 0.00 19-24 17/06A         | 2.545.000  | EUR    | 2.562.090                    | 0,18             |
| IBERDROLA INTL REGS 1.125 15-23 27/01A  | 5.000.000  | EUR    | 5.116.075                    | 0,35             |
| KONINKLIJKE AHOLD 0.875 17-24 19/09A    | 4.000.000  | EUR    | 4.119.180                    | 0,28             |
| NN GROUP NV 0.875 17-23 13/01A          | 2.000.000  | EUR    | 2.030.660                    | 0,14             |
| RABOBANK 2.375 13-23 22/05A             | 4.000.000  | EUR    | 4.210.780                    | 0,29             |
| RABOBANK SUB 3.875 13-23 25/07A         | 3.000.000  | EUR    | 3.248.715                    | 0,22             |
| RELX FINANCE BV 1.00 17-24 22/03A       | 3.000.000  | EUR    | 3.087.060                    | 0,21             |
| REPSOL INTL FIN 0.125 20-24 05/10A      | 5.000.000  | EUR    | 5.033.950                    | 0,35             |
| ROYAL PHILIPS NV 0.50 17-23 06/09A      | 4.000.000  | EUR    | 4.060.660                    | 0,28             |
| SCHLUMBERGER FIN 0.00 19-24 15/10U      | 2.548.000  | EUR    | 2.559.746                    | 0,18             |
| SIEMENS FIN 0.00 20-23 20/02U           | 7.800.000  | EUR    | 7.848.750                    | 0,54             |
| SIEMENS FINANCIER 0.375 18-23 06/09A    | 1.000.000  | EUR    | 1.016.085                    | 0,07             |
| TENNET HOLDING EMTN 4.625 11-23 21/02A  | 4.770.000  | EUR    | 5.165.242                    | 0,36             |
| UNILEVER NV 0.375 17-23 14/02A          | 2.000.000  | EUR    | 2.024.830                    | 0,14             |
| UPJOHN FINANCE 0.8160 20-22 23/06A      | 2.620.000  | EUR    | 2.645.833                    | 0,18             |
| VONOVIA FINANCE BV 0.125 19-23 06/04A   | 8.000.000  | EUR    | 8.041.720                    | 0,56             |
| VW INTL FINANCE 1.125 17-23 02/10A      | 8.000.000  | EUR    | 8.224.520                    | 0,57             |
| WOLTERS KLUWER NV2.875 13-23 21/03A     | 4.000.000  | EUR    | 4.217.420                    | 0,29             |
| <b>España</b>                           |            |        | <b>90.364.290</b>            | <b>6,23</b>      |
| BANCO BILBAO VI 0.3750 19-24 02/10A     | 6.800.000  | EUR    | 6.892.956                    | 0,48             |
| BANCO SANTANDER SA 0.25 19-24 19/06A    | 5.800.000  | EUR    | 5.863.191                    | 0,40             |
| BANKIA SA 1.0000 19-24 25/06A           | 4.000.000  | EUR    | 4.107.660                    | 0,28             |
| CAIXABANK SA 0.625 19-24 01/10A         | 6.300.000  | EUR    | 6.404.549                    | 0,44             |
| CAIXABANK SA 0.75 18-23 18/04A          | 3.000.000  | EUR    | 3.049.890                    | 0,21             |
| INSTITUT CREDIT 0.2500 20-24 30/04A     | 3.344.000  | EUR    | 3.406.800                    | 0,24             |
| NT CONS FIN 0.00 21-26 23/02A           | 4.200.000  | EUR    | 4.170.579                    | 0,29             |
| SANTAN CONSUMER 1.1250 18-23 09/10A     | 3.000.000  | EUR    | 3.091.095                    | 0,21             |
| SANTANDER CONS FIN 0.3750 19-24 27/06A  | 4.700.000  | EUR    | 4.759.055                    | 0,33             |
| SPAIN 0.00 20-23 30/04U                 | 20.000.000 | EUR    | 20.188.300                   | 1,39             |
| SPAIN 4.65 10-25 30/07A                 | 6.000.000  | EUR    | 7.237.050                    | 0,50             |
| SPAIN 4.80 08-24 31/01A                 | 13.000.000 | EUR    | 14.784.445                   | 1,02             |
| TELEFONICA EMISIONES 3.987 13-23 23/01A | 6.000.000  | EUR    | 6.408.720                    | 0,44             |
| <b>Reino Unido</b>                      |            |        | <b>66.607.140</b>            | <b>4,59</b>      |
| BARCLAYS 1.5 18-23 03/09A               | 2.000.000  | EUR    | 2.073.980                    | 0,14             |
| BARCLAYS BANK 1.50 14-22 01/04A         | 2.000.000  | EUR    | 2.027.990                    | 0,14             |
| BARCLAYS PLC 0.625 17-23 14/11A         | 1.000.000  | EUR    | 1.011.880                    | 0,07             |
| BRITISH TELECOM 1.125 16-23 10/03A      | 3.000.000  | EUR    | 3.068.400                    | 0,21             |
| CREDIT AGRICOLE LDN 0.50 19-24 24/06A   | 12.500.000 | EUR    | 12.704.125                   | 0,87             |
| CS AG LDN EMTN 3.125 13-23 17/07A       | 4.000.000  | EUR    | 4.292.760                    | 0,30             |
| DIAGEO FINANCE PLC 0.125 19-23 12/10A   | 8.000.000  | EUR    | 8.067.200                    | 0,56             |
| GLAXOSMITHKLINE 0.00 19-23 23/09A       | 2.000.000  | EUR    | 2.011.230                    | 0,14             |
| GLAXOSMITHKLINE 0.1250 20-23 12/05A     | 3.264.000  | EUR    | 3.292.283                    | 0,23             |
| LLOYDS BANK GROUP 1.00 16-23 09/11A     | 8.000.000  | EUR    | 8.218.440                    | 0,57             |
| NATIONWIDE BUILDING 0.5500 21-24 22/01S | 1.400.000  | USD    | 1.176.111                    | 0,08             |
| NATIONWIDE BUILDING 0.625 17-23 19/04A  | 5.418.000  | EUR    | 5.516.553                    | 0,38             |
| NATWEST MARKETS PLC 0.125 21-26 18/06A  | 8.084.000  | EUR    | 8.055.463                    | 0,55             |
| VODAFONE GROUP 0.50 16-24 30/01A        | 5.000.000  | EUR    | 5.090.725                    | 0,35             |
| <b>Alemania</b>                         |            |        | <b>59.477.040</b>            | <b>4,10</b>      |
| BASF SE 0.1010 20-23 05/06A             | 6.000.000  | EUR    | 6.042.420                    | 0,42             |
| DAIMLER AG 1.40 16-24 12/01A            | 3.000.000  | EUR    | 3.119.280                    | 0,22             |
| DEUTSCHE BANK 2.375 13-23 11/01A        | 3.500.000  | EUR    | 3.640.648                    | 0,25             |
| DEUTSCHE BOERSE AG 0.0 21-26 22/02A     | 2.300.000  | EUR    | 2.311.178                    | 0,16             |
| E.ON 0.00 19-24 28/08U                  | 1.154.000  | EUR    | 1.158.922                    | 0,08             |
| E.ON SE 0.00 20-23 18/12A               | 5.109.000  | EUR    | 5.138.785                    | 0,35             |
| EUROGRID GMBH 1.625 15-23 03/11A        | 3.000.000  | EUR    | 3.117.795                    | 0,22             |
| EVONIK INDUSTRIES 1.00 15-23 23/01A     | 6.000.000  | EUR    | 6.099.180                    | 0,42             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Short Term

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| FRESENIUS REGS 4.00 14-24 01/02S         | 2.400.000  | EUR    | 2.649.252                    | 0,18             |
| MERCK FINANCIAL 0.005 19-23 15/12A       | 6.500.000  | EUR    | 6.537.342                    | 0,45             |
| MUNICH RE EMTN 6.25 12-42 26/05A         | 3.000.000  | EUR    | 3.167.460                    | 0,22             |
| SAP SE 0.0 20-23 17/05A                  | 2.000.000  | EUR    | 2.011.930                    | 0,14             |
| VANTAGE TOWERS 0.0000 21-25 31/03A       | 5.300.000  | EUR    | 5.284.259                    | 0,36             |
| VOLKSWAGEN LEASING 0.00 21-24 19/07A     | 5.366.000  | EUR    | 5.362.941                    | 0,37             |
| VOLKSWAGEN LEASING 0.50 19-22 20/06A     | 3.807.000  | EUR    | 3.835.648                    | 0,26             |
| <b>Bélgica</b>                           |            |        | <b>42.006.816</b>            | <b>2,90</b>      |
| BELFIUS BANK SA 0.01 20-25 15/10A        | 4.500.000  | EUR    | 4.504.298                    | 0,31             |
| BELFIUS BANK SA 0.3750 20-25 02/09A      | 5.600.000  | EUR    | 5.648.188                    | 0,39             |
| BELFIUS BANQUE 0.75 17-22 12/09A         | 10.000.000 | EUR    | 10.131.050                   | 0,70             |
| BELFIUS BANQUE 2.125 13-23 30/01A        | 2.000.000  | EUR    | 2.082.940                    | 0,15             |
| BELGACOM 2.375 14-24 01/04A              | 3.000.000  | EUR    | 3.216.975                    | 0,22             |
| KBC GROEP 0.75 16-23 18/10A              | 6.000.000  | EUR    | 6.140.490                    | 0,42             |
| KBC GROUP NV 1.125 19-24 25/01A          | 5.000.000  | EUR    | 5.168.775                    | 0,36             |
| SOLVAY SA 1.625 15-22 02/12A             | 5.000.000  | EUR    | 5.114.100                    | 0,35             |
| <b>Irlanda</b>                           |            |        | <b>32.226.910</b>            | <b>2,22</b>      |
| ABBOTT IRELAND 0.1000 19-24 19/11A       | 3.595.000  | EUR    | 3.626.007                    | 0,25             |
| ABBOTT IRELAND FIN 0.875 18-23 27/09A    | 1.000.000  | EUR    | 1.025.325                    | 0,07             |
| CLOVERIE PLC SWISS RE 6.625 12-42 01/09A | 7.000.000  | EUR    | 7.544.460                    | 0,52             |
| CRH FINANCE 3.125 13-23 03/04A           | 4.000.000  | EUR    | 4.234.800                    | 0,29             |
| FCA BANK S.P.A. 0.125 20-23 16/11A       | 1.000.000  | EUR    | 1.003.420                    | 0,07             |
| FCA BANK SPA 0.50 20-23 18/09A           | 1.500.000  | EUR    | 1.516.583                    | 0,10             |
| FCA BANK SPA IR 0.0000 21-24 16/04A      | 2.076.000  | EUR    | 2.076.363                    | 0,14             |
| FRESENIUS FINANCE IRL 0.0 21-25 01/10A   | 3.746.000  | EUR    | 3.738.826                    | 0,26             |
| RYANAIR LTD 0.875 21-26 25/05A           | 2.264.000  | EUR    | 2.274.426                    | 0,16             |
| WILLOW 3.375 12-22 27/06A                | 5.000.000  | EUR    | 5.186.700                    | 0,36             |
| <b>Japón</b>                             |            |        | <b>30.979.671</b>            | <b>2,14</b>      |
| ASAHI GROUP HOL 0.0100 21-24 19/04A      | 2.832.000  | EUR    | 2.839.774                    | 0,20             |
| MITSUBISHI UFJ 0.872 17-24 07/09A        | 4.000.000  | EUR    | 4.123.680                    | 0,28             |
| MIZUHO FINANCIAL 0.118 19-24 06/09A      | 5.273.000  | EUR    | 5.303.953                    | 0,37             |
| MIZUHO FINANCIAL GR 0.214 20-25 07/10A   | 2.143.000  | EUR    | 2.158.665                    | 0,15             |
| MIZUHO FINANCIAL GR 0.523 19-24 10/06A   | 5.898.000  | EUR    | 6.002.424                    | 0,41             |
| MIZUHO FINANCIAL GRP 0.184 21-26 13/04A  | 3.418.000  | EUR    | 3.418.735                    | 0,24             |
| TAKEDA PHARMACE 1.1250 18-22 21/11A      | 7.000.000  | EUR    | 7.132.440                    | 0,49             |
| <b>Luxemburgo</b>                        |            |        | <b>28.675.234</b>            | <b>1,98</b>      |
| BECTON DICKINSON EUR 0.632 19-23 04/06A  | 2.000.000  | EUR    | 2.028.530                    | 0,14             |
| MEDTRONIC GLOBAL HOLD 0.00 19-22 02/12U  | 6.667.000  | EUR    | 6.704.035                    | 0,46             |
| MEDTRONIC GLOBAL HOLD 0.00 20-23 15/03U  | 6.161.000  | EUR    | 6.197.751                    | 0,43             |
| MEDTRONIC GLOBAL HOLD 0.00 20-25 15/10U  | 3.176.000  | EUR    | 3.184.559                    | 0,22             |
| NESTLE FINANCE 0.00001 20-25 3/12A       | 5.419.000  | EUR    | 5.451.893                    | 0,38             |
| TYCO ELECTRONICS 0.00 20-25 14/02U       | 5.089.000  | EUR    | 5.108.466                    | 0,35             |
| <b>Dinamarca</b>                         |            |        | <b>22.235.292</b>            | <b>1,53</b>      |
| CARLSBERG BREW 0.50 17-23 06/09A         | 3.000.000  | EUR    | 3.041.565                    | 0,21             |
| CARLSBERG BREWERIES 2.625 12-22 15/11A   | 5.000.000  | EUR    | 5.202.625                    | 0,36             |
| NYKREDIT REALKREDIT 0.1250 19-24 10/07A  | 2.769.000  | EUR    | 2.782.194                    | 0,19             |
| NYKREDIT REALKREDIT 0.2500 19-23 20/01A  | 3.000.000  | EUR    | 3.022.815                    | 0,21             |
| ORSTED 2.625 12-22 19/09A                | 3.000.000  | EUR    | 3.109.470                    | 0,21             |
| VESTAS WIND SYSTEMS 2.75 15-22 11/03A    | 5.007.000  | EUR    | 5.076.623                    | 0,35             |
| <b>Canadá</b>                            |            |        | <b>20.921.665</b>            | <b>1,44</b>      |
| CANADIAN IMPERIAL 0.4800 20-XX XX/XXQ    | 6.329.000  | USD    | 5.343.471                    | 0,37             |
| CANADIAN IMPERIAL BAN 0.375 19-24 03/05A | 6.411.000  | EUR    | 6.502.774                    | 0,45             |
| ROYAL BANK OF CANADA 0.1250 19-24 23/07A | 9.000.000  | EUR    | 9.075.420                    | 0,62             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Short Term

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Finlandia</b>                         |           |        | <b>16.254.640</b>            | <b>1,12</b>      |
| NORDEA BK 0.875 18-23 26/06A             | 8.000.000 | EUR    | 8.175.320                    | 0,56             |
| OP CORPORATE BANK 0.125 20-24 01/07A     | 8.000.000 | EUR    | 8.079.320                    | 0,56             |
| <b>Noruega</b>                           |           |        | <b>15.260.299</b>            | <b>1,05</b>      |
| DNB BANK ASA 1.125 16-23 01/03A          | 4.000.000 | EUR    | 4.098.960                    | 0,28             |
| SANTANDER CONSUMER BK 0.125 21-26 14/04A | 5.100.000 | EUR    | 5.075.979                    | 0,35             |
| TELENOR ASA 0.00 19-23 25/09U            | 4.000.000 | EUR    | 4.023.680                    | 0,28             |
| TELENOR ASA 2.75 12-22 27/06A            | 2.000.000 | EUR    | 2.061.680                    | 0,14             |
| <b>Suecia</b>                            |           |        | <b>14.378.097</b>            | <b>0,99</b>      |
| SCANIA CV AB 0.00 20-22 23/11U           | 4.894.000 | EUR    | 4.905.525                    | 0,34             |
| SCANIA CV AB 0.5000 20-23 06/10A         | 1.148.000 | EUR    | 1.162.178                    | 0,08             |
| VOLVO TREASURY 0.00 20-23 11/02U         | 2.727.000 | EUR    | 2.740.362                    | 0,19             |
| VOLVO TREASURY 0.125 20-24 17/09A        | 2.210.000 | EUR    | 2.227.249                    | 0,15             |
| VOLVO TREASURY AB 0.00 21-26 18/05A      | 3.347.000 | EUR    | 3.342.783                    | 0,23             |
| <b>Australia</b>                         |           |        | <b>12.529.435</b>            | <b>0,86</b>      |
| NATIONAL AUSTRALIA 0.25 19-24 20/05A     | 3.076.000 | EUR    | 3.119.110                    | 0,21             |
| NATIONAL AUSTRALIA BK 0.625 18-23 30/08A | 2.000.000 | EUR    | 2.042.020                    | 0,14             |
| TELSTRA CORP EMTN 2.50 13-23 15/09A      | 3.000.000 | EUR    | 3.180.885                    | 0,22             |
| TELSTRA CORP LTD 3.50 12-22 21/09A       | 4.000.000 | EUR    | 4.187.420                    | 0,29             |
| <b>Guernsey</b>                          |           |        | <b>9.098.640</b>             | <b>0,63</b>      |
| CREDIT SUISSE GRP FDG 1.25 15-22 14/04A  | 9.000.000 | EUR    | 9.098.640                    | 0,63             |
| <b>Austria</b>                           |           |        | <b>8.638.337</b>             | <b>0,60</b>      |
| ERSTE GROUP BAN 0.0500 20-25 16/09A      | 3.500.000 | EUR    | 3.517.167                    | 0,24             |
| OMV AG 0.0000 20-23 16/06A               | 2.000.000 | EUR    | 2.009.240                    | 0,14             |
| OMV AG 2.625 12-22 27/09A                | 3.000.000 | EUR    | 3.111.930                    | 0,22             |
| <b>Nueva Zelanda</b>                     |           |        | <b>5.078.000</b>             | <b>0,35</b>      |
| BNZ INT FUNDING 0.50 18-23 13/05A        | 5.000.000 | EUR    | 5.078.000                    | 0,35             |
| <b>Filipinas</b>                         |           |        | <b>4.422.264</b>             | <b>0,30</b>      |
| PHILIPPINES 0.2500 21-25 28/04A          | 4.400.000 | EUR    | 4.422.264                    | 0,30             |
| <b>Rumanía</b>                           |           |        | <b>3.310.350</b>             | <b>0,23</b>      |
| ROMANIA EMTN 3.625 14-24 24/04A          | 3.000.000 | EUR    | 3.310.350                    | 0,23             |
| <b>México</b>                            |           |        | <b>3.132.555</b>             | <b>0,22</b>      |
| MEXICO 1.625 15-24 06/03A                | 3.000.000 | EUR    | 3.132.555                    | 0,22             |
| <b>Suiza</b>                             |           |        | <b>3.114.990</b>             | <b>0,21</b>      |
| UBS GROUP FUNDING 1.50 16-24 30/11A      | 3.000.000 | EUR    | 3.114.990                    | 0,21             |
| <b>Indonesia</b>                         |           |        | <b>2.103.270</b>             | <b>0,15</b>      |
| INDONESIE REGS 2.625 16-23 14/06A        | 2.000.000 | EUR    | 2.103.270                    | 0,15             |
| <b>Polonia</b>                           |           |        | <b>1.819.675</b>             | <b>0,13</b>      |
| POLAND 0.00 20-23 07/07U                 | 1.805.000 | EUR    | 1.819.675                    | 0,13             |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>     |           |        | <b>193.367.824</b>           | <b>13,33</b>     |
| <b>Francia</b>                           |           |        | <b>58.295.946</b>            | <b>4,02</b>      |
| BNP PARIBAS FL.R 18-23 22/05Q            | 6.000.000 | EUR    | 6.053.670                    | 0,42             |
| BPCE SA FL.R 18-23 23/03Q                | 5.000.000 | EUR    | 5.032.725                    | 0,35             |
| BPCE SA SUB FL.R 15-27 30/11A            | 5.000.000 | EUR    | 5.192.875                    | 0,36             |
| DANONE SA EMTN FL.R 17-XX 23/06A         | 2.000.000 | EUR    | 2.053.850                    | 0,14             |
| ENGIE SA FL.R 18-XX 16/04A               | 2.000.000 | EUR    | 2.039.150                    | 0,14             |
| FRANCE 0.10 15-25 01/03A                 | 9.000.000 | EUR    | 10.072.706                   | 0,69             |
| FRANCE 0.1 20-26 01/03A                  | 9.000.000 | EUR    | 9.791.595                    | 0,68             |
| LA BANQUE POSTALE FL.R 15-27 19/11A      | 3.000.000 | EUR    | 3.114.750                    | 0,21             |
| ORANGE FL.R 14-XX 07/02A                 | 2.000.000 | EUR    | 2.248.760                    | 0,16             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Short Term

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| SOCIETE GENERALE FL.R 18-23 06/03Q       | 5.000.000  | EUR    | 5.031.425                    | 0,35             |
| SOCIETE GENERALE SUB FL.R 14-26 16/09A   | 1.500.000  | EUR    | 1.508.100                    | 0,10             |
| SUEZ FL.R 15-XX 30/03A                   | 2.000.000  | EUR    | 2.023.700                    | 0,14             |
| TOTAL SE FL.R 16-49 18/05A               | 4.000.000  | EUR    | 4.132.640                    | 0,28             |
| <b>Estados Unidos de América</b>         |            |        | <b>42.874.167</b>            | <b>2,96</b>      |
| BANK OF AMERICA CORP FL.R 17-25 07/02A   | 1.000.000  | EUR    | 1.037.660                    | 0,07             |
| BANK OF AMERICA CORP FL.R 21-24 14/06S   | 2.555.000  | USD    | 2.153.211                    | 0,15             |
| BANK OF AMERICA CORP FL.R 21-25 24/08Q   | 10.000.000 | EUR    | 10.176.450                   | 0,70             |
| BANK OF NY MELL FL.R 21-24 26/04Q        | 3.365.000  | USD    | 2.843.050                    | 0,20             |
| CITIGROUP INC FL.R 21-25 01/05Q          | 2.663.000  | USD    | 2.251.794                    | 0,16             |
| GOLDMAN SACHS G FL.R 21-24 10/09Q        | 5.500.000  | USD    | 4.636.460                    | 0,32             |
| GOLDMAN SACHS G FL.R 21-26 19/03Q        | 8.334.000  | EUR    | 8.483.554                    | 0,58             |
| TOYOTA MOTOR CREDIT FL.R 21-23 06/04Q    | 4.854.000  | USD    | 4.100.298                    | 0,28             |
| TOYOTA MOTOR CREDIT FL.R 21-24 18/06Q    | 8.523.000  | USD    | 7.191.690                    | 0,50             |
| <b>España</b>                            |            |        | <b>16.662.783</b>            | <b>1,15</b>      |
| BANCO BILBAO VIZC.ARG. FL.R 18-23 03/09Q | 7.300.000  | EUR    | 7.352.268                    | 0,51             |
| BANCO BILBAO VIZCAYA FL.R 19-29 22/02A   | 4.000.000  | EUR    | 4.218.240                    | 0,29             |
| BANCO DE SABADE FL.R 20-23 29/06A        | 5.000.000  | EUR    | 5.092.275                    | 0,35             |
| <b>Canadá</b>                            |            |        | <b>15.769.959</b>            | <b>1,09</b>      |
| BANK OF MONTREAL FL.R 20-23 08/12Q       | 2.609.000  | USD    | 2.205.550                    | 0,15             |
| BANK OF NOVA SCOTIA T FL.R 21-24 15/04Q  | 4.402.000  | USD    | 3.722.398                    | 0,26             |
| ROYAL BANK OF CANADA FL.R 21-24 19/01Q   | 5.490.000  | USD    | 4.635.876                    | 0,32             |
| ROYAL BANK OF C FL.R 21-26 27/04Q        | 3.784.000  | USD    | 3.194.452                    | 0,22             |
| TORONTO DOMINION BANK FL.R 21-24 04/03Q  | 2.381.000  | USD    | 2.011.683                    | 0,14             |
| <b>Países Bajos</b>                      |            |        | <b>15.627.653</b>            | <b>1,08</b>      |
| DIGITAL DUTCH FINCO FL.R 20-22 23/09Q    | 3.141.000  | EUR    | 3.150.863                    | 0,22             |
| IBERDROLA INTL BV FL.R 17-XX 22/02A      | 6.000.000  | EUR    | 6.167.490                    | 0,42             |
| ING GROUP NV FL.R 17-28 11/04A           | 4.000.000  | EUR    | 4.198.480                    | 0,29             |
| SIEMENS FINANCI FL.R 21-24 11/03Q        | 2.490.000  | USD    | 2.110.820                    | 0,15             |
| <b>Alemania</b>                          |            |        | <b>13.024.525</b>            | <b>0,90</b>      |
| ALLIANZ SE FL.R 12-42 17/10A             | 7.000.000  | EUR    | 7.507.675                    | 0,52             |
| ALLIANZ SE FL.R 13-XX 24/10A             | 5.000.000  | EUR    | 5.516.850                    | 0,38             |
| <b>Reino Unido</b>                       |            |        | <b>11.682.595</b>            | <b>0,80</b>      |
| HSBC HOLDINGS PLC 1.5 18-24 04/12A       | 7.000.000  | EUR    | 7.273.000                    | 0,50             |
| UBS AG LONDON FL.R 21-24 09/02Q          | 5.217.000  | USD    | 4.409.595                    | 0,30             |
| <b>Italia</b>                            |            |        | <b>9.272.190</b>             | <b>0,64</b>      |
| ENEL SPA FL.R 18-78 24/05A               | 5.000.000  | EUR    | 5.246.650                    | 0,36             |
| INTESA SAN PAOLO FL.R 17-22 19/04Q       | 4.000.000  | EUR    | 4.025.540                    | 0,28             |
| <b>Tailandia</b>                         |            |        | <b>4.566.744</b>             | <b>0,31</b>      |
| JP MORGAN CHASE FL.R 21-24 16/03Q        | 5.383.000  | USD    | 4.566.744                    | 0,31             |
| <b>Bélgica</b>                           |            |        | <b>3.544.642</b>             | <b>0,24</b>      |
| KBC GROEP FL.R 15-27 11/03A              | 3.500.000  | EUR    | 3.544.642                    | 0,24             |
| <b>Austria</b>                           |            |        | <b>2.046.620</b>             | <b>0,14</b>      |
| OMV AG FL.R 15-XX 09/12A                 | 2.000.000  | EUR    | 2.046.620                    | 0,14             |
| <b>Otros valores mobiliarios</b>         |            |        | <b>4.131.700</b>             | <b>0,28</b>      |
| <b>Obligaciones</b>                      |            |        | <b>4.131.700</b>             | <b>0,28</b>      |
| <b>Francia</b>                           |            |        | <b>4.131.700</b>             | <b>0,28</b>      |
| CGNIE DE ST GOBAIN 1.75 20-23 03/04A     | 4.000.000  | EUR    | 4.131.700                    | 0,28             |

## Candriam Bonds

### Candriam Bonds Euro Short Term

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                           | Cantidad | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------------------|----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Organismos de Inversión Colectiva</b>               |          |        | <b>28.225.512</b>            | <b>1,95</b>      |
| <b>Acciones/Participaciones en fondos de inversión</b> |          |        | <b>28.225.512</b>            | <b>1,95</b>      |
| <b>Luxemburgo</b>                                      |          |        | <b>17.988.376</b>            | <b>1,24</b>      |
| CANDRIAM BONDS FLOATING RATE NOTES I EUR C             | 8.000    | EUR    | 12.002.000                   | 0,83             |
| CANDRIAM MONEY MARKET EURO Z EUR C                     | 5.900    | EUR    | 5.986.376                    | 0,41             |
| <b>Francia</b>                                         |          |        | <b>10.237.136</b>            | <b>0,71</b>      |
| CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV Z EUR C                       | 6.903    | EUR    | 10.237.136                   | 0,71             |
| <b>Total de la cartera de valores</b>                  |          |        | <b>1.444.466.305</b>         | <b>99,59</b>     |
| Coste de adquisición                                   |          |        | 1.445.868.609                |                  |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Euro Short Term

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

### Distribución geográfica (en % activo neto)

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| Italia                    | 19,12        |
| Francia                   | 17,50        |
| Estados Unidos de América | 13,42        |
| Países Bajos              | 9,71         |
| España                    | 7,38         |
| Reino Unido               | 5,40         |
| Alemania                  | 5,00         |
| Luxemburgo                | 3,22         |
| Bélgica                   | 3,14         |
| Canadá                    | 2,53         |
| Irlanda                   | 2,22         |
| Japón                     | 2,14         |
| Dinamarca                 | 1,53         |
| Finlandia                 | 1,12         |
| Noruega                   | 1,05         |
| Suecia                    | 0,99         |
| Australia                 | 0,86         |
| Austria                   | 0,74         |
| Guernsey                  | 0,63         |
| Nueva Zelanda             | 0,35         |
| Tailandia                 | 0,31         |
| Filipinas                 | 0,30         |
| Rumanía                   | 0,23         |
| México                    | 0,22         |
| Suiza                     | 0,21         |
| Indonesia                 | 0,14         |
| Polonia                   | 0,13         |
|                           | <b>99,59</b> |

### Distribución económica (en % activo neto)

|                                                                |              |
|----------------------------------------------------------------|--------------|
| Bancos y otras entidades financieras                           | 29,49        |
| Obligaciones del Estado, de las provincias y de los municipios | 20,37        |
| Holdings y entidades financieras                               | 16,42        |
| Telecomunicaciones                                             | 4,60         |
| Energía y servicio de aguas                                    | 3,57         |
| Seguros                                                        | 3,12         |
| Farmacia y cosméticos                                          | 3,09         |
| Petróleo                                                       | 2,23         |
| Fondos de inversión                                            | 1,95         |
| Internet y servicios de Internet                               | 1,73         |
| Sociedades inmobiliarias                                       | 1,70         |
| Electrotecnia y electrónica                                    | 1,64         |
| Química                                                        | 1,33         |
| Comercio minorista y grandes almacenes                         | 1,19         |
| Tabaco y alcohol                                               | 1,17         |
| Industrias agro-alimentarias                                   | 1,01         |
| Industria automovilística                                      | 0,80         |
| Electrónica y semiconductores                                  | 0,71         |
| Artículos de oficina y ordenadores                             | 0,71         |
| Transporte                                                     | 0,70         |
| Industria aeronáutica y espacial                               | 0,46         |
| Bienes de consumo diversos                                     | 0,35         |
| Artes gráficas y editoriales                                   | 0,29         |
| Construcción, material de construcción                         | 0,28         |
| Servicios varios                                               | 0,22         |
| Instituciones inclasificables / no clasificadas                | 0,18         |
| Restaurantes, hoteles                                          | 0,14         |
| Construcción de máquinas y aparatos                            | 0,14         |
|                                                                | <b>99,59</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Floating Rate Notes

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |            |        | <b>517.124.227</b>           | <b>94,07</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |            |        | <b>110.928.024</b>           | <b>20,18</b>     |
| <b>Estados Unidos de América</b>                                                                                                |            |        | <b>35.156.044</b>            | <b>6,40</b>      |
| FIDELITY NATIONAL 0.75 19-23 21/05A                                                                                             | 8.000.000  | EUR    | 8.132.560                    | 1,48             |
| GENERAL ELECTRIC CO 0.875 17-25 17/05A                                                                                          | 5.300.000  | EUR    | 5.448.453                    | 0,99             |
| HJ HEINZ CO 2.00 15-23 30/06A                                                                                                   | 2.400.000  | EUR    | 2.483.364                    | 0,45             |
| MC DONALD S CORP 1.00 16-23 15/11A                                                                                              | 11.400.000 | EUR    | 11.728.662                   | 2,13             |
| MCKESSON CORP 1.50 17-25 17/11A                                                                                                 | 5.000.000  | EUR    | 5.300.275                    | 0,97             |
| NASDAQ 1.75 16-23 19/05A                                                                                                        | 2.000.000  | EUR    | 2.062.730                    | 0,38             |
| <b>Países Bajos</b>                                                                                                             |            |        | <b>19.164.691</b>            | <b>3,49</b>      |
| TOYOTA MOTOR FI 0.6250 18-23 26/09A                                                                                             | 9.000.000  | EUR    | 9.181.530                    | 1,67             |
| UPJOHN FINANCE 0.8160 20-22 23/06A                                                                                              | 5.386.000  | EUR    | 5.439.106                    | 0,99             |
| WINTERSHALL DEA SCHWE 0.452 19-23 25/09A                                                                                        | 4.500.000  | EUR    | 4.544.055                    | 0,83             |
| <b>España</b>                                                                                                                   |            |        | <b>16.232.179</b>            | <b>2,95</b>      |
| BANCO DE SABADELL SA 1.625 18-24 07/09A                                                                                         | 5.300.000  | EUR    | 5.519.712                    | 1,00             |
| CAIXABANK SA 1.125 17-23 12/01A                                                                                                 | 10.500.000 | EUR    | 10.712.467                   | 1,95             |
| <b>Reino Unido</b>                                                                                                              |            |        | <b>12.384.217</b>            | <b>2,25</b>      |
| BARCLAYS BANK PLC 6.625 11-22 30/03A                                                                                            | 4.000.000  | EUR    | 4.201.840                    | 0,76             |
| NATIONWIDE BLGD SOC 0.25 20-25 22/07A                                                                                           | 8.100.000  | EUR    | 8.182.377                    | 1,49             |
| <b>Italia</b>                                                                                                                   |            |        | <b>12.173.633</b>            | <b>2,21</b>      |
| FINMECCANICA FINANCE 5.25 09-22 21/01A                                                                                          | 2.700.000  | EUR    | 2.780.933                    | 0,50             |
| INTESA SAN PAOLO 4.00 13-23 30/11A                                                                                              | 3.000.000  | EUR    | 3.289.380                    | 0,60             |
| UNICREDIT SPA 1.00 18-23 18/01A                                                                                                 | 6.000.000  | EUR    | 6.103.320                    | 1,11             |
| <b>Luxemburgo</b>                                                                                                               |            |        | <b>8.218.379</b>             | <b>1,49</b>      |
| ARCELOORMITTAL SA 3.125 15-22 14/01A                                                                                            | 2.600.000  | EUR    | 2.645.721                    | 0,48             |
| FIAT FINANCE TR 4.75 14-22 15/07A                                                                                               | 5.300.000  | EUR    | 5.572.658                    | 1,01             |
| <b>Alemania</b>                                                                                                                 |            |        | <b>5.470.570</b>             | <b>1,00</b>      |
| FRESENIUS MED CARE 0.25 19-23 29/11A                                                                                            | 5.425.000  | EUR    | 5.470.570                    | 1,00             |
| <b>Bélgica</b>                                                                                                                  |            |        | <b>2.026.210</b>             | <b>0,37</b>      |
| BELFIUS BANQUE 0.75 17-22 12/09A                                                                                                | 2.000.000  | EUR    | 2.026.210                    | 0,37             |
| <b>Australia</b>                                                                                                                |            |        | <b>102.101</b>               | <b>0,02</b>      |
| NATIONAL AUSTRALIA BK 0.625 18-23 30/08A                                                                                        | 100.000    | EUR    | 102.101                      | 0,02             |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>                                                                                            |            |        | <b>406.196.203</b>           | <b>73,89</b>     |
| <b>Estados Unidos de América</b>                                                                                                |            |        | <b>93.635.123</b>            | <b>17,03</b>     |
| AT&T INC FL.R 18-23 05/09Q                                                                                                      | 10.200.000 | EUR    | 10.331.988                   | 1,88             |
| BANK OF AMERICA CORP FL.R 18-24 25/04Q                                                                                          | 1.000.000  | EUR    | 1.006.670                    | 0,18             |
| BANK OF AMERICA CORP FL.R 21-25 24/08Q                                                                                          | 14.000.000 | EUR    | 14.247.030                   | 2,59             |
| BANK OF NY MELL FL.R 21-24 26/04Q                                                                                               | 4.808.000  | USD    | 4.062.225                    | 0,74             |
| CITIGROUP FL.R 18-27 01/06Q                                                                                                     | 10.000.000 | USD    | 8.556.565                    | 1,56             |
| CITIGROUP INC FL.R 18-23 21/03Q                                                                                                 | 3.500.000  | EUR    | 3.523.205                    | 0,64             |
| CITIGROUP INC FL.R 21-25 01/05Q                                                                                                 | 2.663.000  | USD    | 2.251.794                    | 0,41             |
| GOLDMAN SACHS G FL.R 21-24 30/04Q                                                                                               | 8.604.000  | EUR    | 8.695.073                    | 1,58             |
| GOLDMAN SACHS G FL.R 21-26 19/03Q                                                                                               | 8.000.000  | EUR    | 8.143.560                    | 1,48             |
| INTERCONTINENTALEXCHANG FLR 20-23 15/06Q                                                                                        | 6.000.000  | USD    | 5.067.367                    | 0,92             |
| JPMORGAN FL.R 17-25 29/11Q                                                                                                      | 12.000.000 | USD    | 10.262.181                   | 1,87             |
| MORGAN STANLEY FL.R 17-24 08/05Q                                                                                                | 12.000.000 | USD    | 10.295.775                   | 1,87             |
| TOYOTA MOTOR CREDIT FL.R 21-24 18/06Q                                                                                           | 8.523.000  | USD    | 7.191.690                    | 1,31             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Floating Rate Notes

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Reino Unido</b>                       |            |        | <b>75.610.164</b>            | <b>13,76</b>     |
| BARCLAYS BANK PLC FLR 21-26 12/05Q       | 6.000.000  | EUR    | 6.114.030                    | 1,11             |
| COCA COLA EUROPEAN FL.R 17-21 16/11Q     | 1.500.000  | EUR    | 1.502.378                    | 0,28             |
| CREDIT AGRICOLE LDN FL.R 18-23 06/03Q    | 12.000.000 | EUR    | 12.096.600                   | 2,20             |
| HSBC HOLDING FL.R 17-23 05/10Q           | 10.000.000 | EUR    | 10.041.450                   | 1,83             |
| HSBC HOLDINGS PLC FL.R 19-25 11/03Q      | 7.675.000  | USD    | 6.603.451                    | 1,20             |
| LLOYDS BANK GRP FL.R 17-24 21/06Q        | 16.500.000 | EUR    | 16.722.832                   | 3,04             |
| NATWEST GROUP PLC FL.R 17-23 08/03A      | 7.000.000  | EUR    | 7.104.440                    | 1,29             |
| SANTANDER UK PLC FL.R 17-23 18/05Q       | 1.800.000  | EUR    | 1.809.081                    | 0,33             |
| UBS AG LONDON FL.R 21-24 09/02Q          | 16.109.000 | USD    | 13.615.902                   | 2,48             |
| <b>Países Bajos</b>                      |            |        | <b>56.538.221</b>            | <b>10,29</b>     |
| BMW FINANCE NV FL.R 20-23 02/10Q         | 9.000.000  | EUR    | 9.090.000                    | 1,66             |
| DEUTSCHE TELEKOM FL.R 18-22 01/12Q       | 1.043.000  | EUR    | 1.049.253                    | 0,19             |
| DIGITAL DUTCH FINCO FL.R 20-22 23/09Q    | 10.700.000 | EUR    | 10.733.598                   | 1,95             |
| ING GROUP NV FL.R 18-23 20/09Q           | 10.000.000 | EUR    | 10.158.650                   | 1,85             |
| STEDIN HOLDING NV FL.R 17-22 24/10Q      | 968.000    | EUR    | 971.460                      | 0,18             |
| VOLKSWAGEN INTERNATI FL.R 18-24 16/11Q   | 12.000.000 | EUR    | 12.477.540                   | 2,27             |
| VONOVIA FINANCE BV FL.R 18-22 22/12Q     | 12.000.000 | EUR    | 12.057.720                   | 2,19             |
| <b>Francia</b>                           |            |        | <b>50.924.384</b>            | <b>9,26</b>      |
| BNP PARIBAS FL.R 17-24 07/06Q            | 6.500.000  | EUR    | 6.593.340                    | 1,20             |
| BNP PARIBAS FL.R 18-23 22/05Q            | 1.200.000  | EUR    | 1.210.734                    | 0,22             |
| BNP PARIBAS FL.R 19-25 15/07A            | 9.000.000  | EUR    | 9.121.950                    | 1,66             |
| BPCE SA FL.R 18-23 23/03Q                | 10.500.000 | EUR    | 10.568.722                   | 1,92             |
| CARREFOUR BQ FL.R 19-23 12/09Q           | 11.100.000 | EUR    | 11.176.035                   | 2,03             |
| GECINA FL.R 17-22 30/06Q                 | 1.000.000  | EUR    | 1.003.475                    | 0,18             |
| LVMH MOET HENNE FL.R 20-22 11/02Q        | 100.000    | EUR    | 100.293                      | 0,02             |
| SOCIETE GENERALE FL.R 17-24 22/05Q       | 10.000.000 | EUR    | 10.143.550                   | 1,85             |
| SOCIETE GENERALE FL.R 18-23 06/03Q       | 1.000.000  | EUR    | 1.006.285                    | 0,18             |
| <b>España</b>                            |            |        | <b>26.839.990</b>            | <b>4,88</b>      |
| BANCO BILBAO VIZC.ARG. FL.R 18-23 03/09Q | 12.500.000 | EUR    | 12.589.500                   | 2,29             |
| BANCO SANTANDER FL.R 17-23 28/03Q        | 300.000    | EUR    | 302.899                      | 0,05             |
| BANCO SANTANDER SA FL.R 17-24 21/11Q     | 13.800.000 | EUR    | 13.947.591                   | 2,54             |
| <b>Italia</b>                            |            |        | <b>26.130.680</b>            | <b>4,75</b>      |
| ACEA SPA FL.R 18-23 08/02Q               | 9.000.000  | EUR    | 9.035.055                    | 1,64             |
| INTESA SAN PAOLO FL.R 17-22 19/04Q       | 6.800.000  | EUR    | 6.843.418                    | 1,25             |
| MEDIOBANCA FL.R 17-22 18/05Q             | 5.088.000  | EUR    | 5.113.542                    | 0,93             |
| UNICREDIT FL.R 16-23 30/06Q              | 1.000.000  | EUR    | 1.005.085                    | 0,18             |
| UNICREDIT SPA FL.R 19-22 15/01Q          | 4.820.000  | USD    | 4.133.580                    | 0,75             |
| <b>Japón</b>                             |            |        | <b>24.978.289</b>            | <b>4,54</b>      |
| MITSUBISHI FL.R 18-23 26/07Q             | 3.000.000  | USD    | 2.564.059                    | 0,46             |
| MITSUBISHI UFJ FL.R 18-23 30/05Q         | 2.500.000  | EUR    | 2.519.125                    | 0,46             |
| MIZUHO FINAN GRP INC FL.R 18-23 10/04Q   | 10.000.000 | EUR    | 10.072.500                   | 1,83             |
| SUMITOMO MITSUI BANK FL.R 17-22 14/06Q   | 200.000    | EUR    | 200.863                      | 0,04             |
| TAKEDA PHARMACE FL.R 18-22 21/11Q        | 9.500.000  | EUR    | 9.621.742                    | 1,75             |
| <b>Canadá</b>                            |            |        | <b>21.535.051</b>            | <b>3,92</b>      |
| BANK OF MONTREAL FL.R 20-23 08/12Q       | 5.000.000  | USD    | 4.226.811                    | 0,77             |
| BANK OF NOVA SCOTIA T FL.R 21-24 15/04Q  | 6.289.000  | USD    | 5.318.074                    | 0,97             |
| ROYAL BANK OF CANADA FL.R 21-24 19/01Q   | 9.490.000  | USD    | 8.013.564                    | 1,46             |
| ROYAL BANK OF C FL.R 21-26 27/04Q        | 2.703.000  | USD    | 2.281.872                    | 0,41             |
| TORONTO DOMINION BAN FL.R 20-23 27/01Q   | 2.000.000  | USD    | 1.694.730                    | 0,31             |
| <b>Alemania</b>                          |            |        | <b>17.959.288</b>            | <b>3,27</b>      |
| DAIMLER FL.R 17-24 03/07Q                | 7.000.000  | EUR    | 7.046.480                    | 1,28             |
| DEUTSCHE BAHN FIN FL.R 15-23 13/10Q      | 3.635.000  | EUR    | 3.668.315                    | 0,67             |
| DEUTSCHE BANK AG FL.R 17-22 16/05Q       | 5.700.000  | EUR    | 5.724.738                    | 1,04             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Floating Rate Notes

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                           | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| VOLKSWAGEN BANK GMBH FL.R 19-22 01/08Q                                 | 1.500.000 | EUR    | 1.519.755                    | 0,28             |
| <b>Luxemburgo</b>                                                      |           |        | <b>6.224.903</b>             | <b>1,13</b>      |
| DH EUROPE FIN FL.R 17-22 30/06Q                                        | 3.700.000 | EUR    | 3.712.228                    | 0,67             |
| JOHN DEERE BANK FL.R 17-22 03/10Q                                      | 2.500.000 | EUR    | 2.512.675                    | 0,46             |
| <b>Dinamarca</b>                                                       |           |        | <b>4.017.350</b>             | <b>0,73</b>      |
| JYSKE BANK AS FL.R 17/22 01/12Q                                        | 500.000   | EUR    | 503.473                      | 0,09             |
| NYKREDIT REGS FL.R 17-22 02/06Q                                        | 3.500.000 | EUR    | 3.513.877                    | 0,64             |
| <b>Suecia</b>                                                          |           |        | <b>1.502.332</b>             | <b>0,27</b>      |
| SCANIA CV AB FL.R 19-21 10/12Q                                         | 1.500.000 | EUR    | 1.502.332                    | 0,27             |
| <b>Suiza</b>                                                           |           |        | <b>300.428</b>               | <b>0,06</b>      |
| UBS GROUP FUNDING FL.R 17-22 20/09Q                                    | 300.000   | EUR    | 300.428                      | 0,06             |
| <b>Instrumentos del mercado monetario</b>                              |           |        | <b>2.250.600</b>             | <b>0,41</b>      |
| <b>Commercial papers, certificados de depósito, títulos de crédito</b> |           |        | <b>2.250.600</b>             | <b>0,41</b>      |
| <b>Bélgica</b>                                                         |           |        | <b>2.250.600</b>             | <b>0,41</b>      |
| UMICORE FINAN. SERV ZCP 240821                                         | 2.250.000 | EUR    | 2.250.600                    | 0,41             |
| <b>Organismos de Inversión Colectiva</b>                               |           |        | <b>31.765.519</b>            | <b>5,78</b>      |
| <b>Acciones/Participaciones en fondos de inversión</b>                 |           |        | <b>31.765.519</b>            | <b>5,78</b>      |
| <b>Francia</b>                                                         |           |        | <b>31.765.519</b>            | <b>5,78</b>      |
| CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV Z EUR C                                       | 21.421    | EUR    | 31.765.519                   | 5,78             |
| <b>Total de la cartera de valores</b>                                  |           |        | <b>551.140.346</b>           | <b>100,26</b>    |
| Coste de adquisición                                                   |           |        | 549.649.015                  |                  |

## Candriam Bonds

---

### Candriam Bonds Floating Rate Notes

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

**Distribución geográfica (en % activo neto)**

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| Estados Unidos de América | 23,43         |
| Reino Unido               | 16,01         |
| Francia                   | 15,04         |
| Países Bajos              | 13,77         |
| España                    | 7,84          |
| Italia                    | 6,97          |
| Japón                     | 4,54          |
| Alemania                  | 4,26          |
| Canadá                    | 3,92          |
| Luxemburgo                | 2,63          |
| Bélgica                   | 0,78          |
| Dinamarca                 | 0,73          |
| Suecia                    | 0,27          |
| Suiza                     | 0,05          |
| Australia                 | 0,02          |
|                           | <b>100,26</b> |

**Distribución económica (en % activo neto)**

|                                                 |               |
|-------------------------------------------------|---------------|
| Bancos y otras entidades financieras            | 56,87         |
| Holdings y entidades financieras                | 19,13         |
| Fondos de inversión                             | 5,78          |
| Farmacia y cosméticos                           | 3,71          |
| Sociedades inmobiliarias                        | 2,38          |
| Restaurantes, hoteles                           | 2,13          |
| Telecomunicaciones                              | 1,88          |
| Energía y servicio de aguas                     | 1,64          |
| Industria automovilística                       | 1,55          |
| Internet y servicios de Internet                | 1,48          |
| Instituciones inclasificables / no clasificadas | 0,99          |
| Electrotecnia y electrónica                     | 0,99          |
| Industrias agro-alimentarias                    | 0,72          |
| Industria aeronáutica y espacial                | 0,51          |
| Minas                                           | 0,48          |
| Textiles y vestido                              | 0,02          |
|                                                 | <b>100,26</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Global Government

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad    | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |             |        | <b>126.885.372</b>           | <b>96,48</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |             |        | <b>120.444.890</b>           | <b>91,58</b>     |
| <b>Estados Unidos de América</b>                                                                                                |             |        | <b>50.798.550</b>            | <b>38,62</b>     |
| BUONI POLIENNAL 1.5000 21-45 30/04S                                                                                             | 550.000     | EUR    | 535.040                      | 0,41             |
| UNITED STATES 0.125 21-23 28/02S                                                                                                | 2.000.000   | USD    | 1.684.572                    | 1,28             |
| UNITED STATES 0.375 20-25 30/04S                                                                                                | 3.600.000   | USD    | 3.003.059                    | 2,28             |
| UNITED STATES 0.875% 20-30 15/11U                                                                                               | 2.350.000   | USD    | 1.882.537                    | 1,43             |
| UNITED STATES 2.25 17-27 15/11S                                                                                                 | 4.700.000   | USD    | 4.237.100                    | 3,22             |
| UNITED STATES 2.375 19-26 30/04S                                                                                                | 2.000.000   | USD    | 1.807.897                    | 1,37             |
| UNITED STATES 2.50 13-23 15/08S                                                                                                 | 2.000.000   | USD    | 1.766.064                    | 1,34             |
| UNITED STATES 2.50 15-45 15/02S                                                                                                 | 2.000.000   | USD    | 1.819.030                    | 1,38             |
| UNITED STATES 2.50 16-46 15/05S                                                                                                 | 2.040.000   | USD    | 1.857.561                    | 1,41             |
| UNITED STATES 2.875 13-43 15/05S                                                                                                | 2.000.000   | USD    | 1.933.131                    | 1,47             |
| UNITED STATES 3.00 18-48 15/02S                                                                                                 | 1.250.000   | USD    | 1.251.851                    | 0,95             |
| UNITED STATES 3.50 09-39 15/02S                                                                                                 | 1.750.000   | USD    | 1.841.478                    | 1,40             |
| UNITED STATES 3.75 11-41 15/08S                                                                                                 | 1.800.000   | USD    | 1.966.070                    | 1,50             |
| UNITED STATES TREASUR 1.375 20-50 15/08S                                                                                        | 850.000     | USD    | 601.738                      | 0,46             |
| US TREASURY 3.875 10-40 15/08S                                                                                                  | 1.100.000   | USD    | 1.216.125                    | 0,93             |
| US TREASURY BONDS 2.25 17-27 15/02S                                                                                             | 3.850.000   | USD    | 3.468.153                    | 2,64             |
| US TREASURY BONDS 6.875 95-25 15/08S                                                                                            | 2.000.000   | USD    | 2.109.224                    | 1,60             |
| US TREASURY N/B 1.5000 20-30 15/02S                                                                                             | 625.000     | USD    | 531.761                      | 0,40             |
| US TREASURY N/B 2.00 15-22 31/07S                                                                                               | 2.000.000   | USD    | 1.721.069                    | 1,31             |
| US TREASURY N/B 3.0000 18-25 31/10S                                                                                             | 1.350.000   | USD    | 1.247.055                    | 0,95             |
| US TREASURY NOTE 1.625 16-23 31/10S                                                                                             | 2.500.000   | USD    | 2.172.170                    | 1,65             |
| US TREASURY NOTE 2.00 17-24 30/04S                                                                                              | 5.000.000   | USD    | 4.403.795                    | 3,35             |
| US TREASURY NOTE 2.25 17-24 31/12S                                                                                              | 3.700.000   | USD    | 3.301.709                    | 2,51             |
| US TREASURY NOTE 5.00 07-37 15/05S                                                                                              | 1.100.000   | USD    | 1.349.173                    | 1,03             |
| WI TREASURY SEC. 2.625 18-23 30/06S                                                                                             | 3.500.000   | USD    | 3.091.188                    | 2,35             |
| <b>Japón</b>                                                                                                                    |             |        | <b>24.284.157</b>            | <b>18,46</b>     |
| JAPAN 0.10 20-30 20/09S                                                                                                         | 15.000.000  | JPY    | 114.753                      | 0,09             |
| JAPAN 0.30 16-46 20/06S                                                                                                         | 120.000.000 | JPY    | 855.083                      | 0,65             |
| JAPAN 0.60 13-23 20/12S                                                                                                         | 120.000.000 | JPY    | 927.982                      | 0,70             |
| JAPAN 018 JGB 2.30 05-35 20/03S                                                                                                 | 200.000.000 | JPY    | 1.948.640                    | 1,48             |
| JAPAN 061 JGB 1.00 03-23 20/03S                                                                                                 | 200.000.000 | JPY    | 1.548.513                    | 1,18             |
| JAPAN 073 JGB 2.00 04-24 20/12S                                                                                                 | 150.000.000 | JPY    | 1.223.870                    | 0,93             |
| JAPAN 106 JGB 2.20 08-28 20/09S                                                                                                 | 210.000.000 | JPY    | 1.857.401                    | 1,41             |
| JAPAN -108- 1.90 08-28 20/12S                                                                                                   | 200.000.000 | JPY    | 1.742.210                    | 1,32             |
| JAPAN 121 1.90 10-30 20/09S                                                                                                     | 10.000.000  | JPY    | 89.085                       | 0,07             |
| JAPAN -156- 0.40 16-36 20/03S                                                                                                   | 180.000.000 | JPY    | 1.397.751                    | 1,06             |
| JAPAN 157 0.20 16-36 20/06S                                                                                                     | 160.000.000 | JPY    | 1.205.600                    | 0,92             |
| JAPAN -167- 0.5 18-38 20/12S                                                                                                    | 200.000.000 | JPY    | 1.555.989                    | 1,18             |
| JAPAN 2.00 12-52 20/03S                                                                                                         | 155.000.000 | JPY    | 1.601.272                    | 1,22             |
| JAPAN 2.10 07-27 20/12S                                                                                                         | 150.000.000 | JPY    | 1.301.091                    | 0,99             |
| JAPAN 2.10 09-29 20/06S                                                                                                         | 200.000.000 | JPY    | 1.778.404                    | 1,35             |
| JAPAN 30 YEAR ISSUE 0.5 19-49 20/03S                                                                                            | 135.000.000 | JPY    | 989.522                      | 0,75             |
| JAPAN -320- 2.30 06-26 20/03S                                                                                                   | 210.000.000 | JPY    | 1.776.878                    | 1,35             |
| JAPAN -38- JGB 1.80 13-43 20/03S                                                                                                | 50.000.000  | JPY    | 482.045                      | 0,37             |
| JAPAN 65 1.90 03-23 20/12S                                                                                                      | 140.000.000 | JPY    | 1.116.794                    | 0,85             |
| JAPAN GOVT 055 2.00 02-22 21/03S                                                                                                | 100.000.000 | JPY    | 771.274                      | 0,59             |
| <b>Francia</b>                                                                                                                  |             |        | <b>8.793.529</b>             | <b>6,69</b>      |
| FRANCE 0.00 17-23 25/03A                                                                                                        | 750.000     | EUR    | 758.411                      | 0,58             |
| FRANCE 0.00 19-29 25/11A                                                                                                        | 600.000     | EUR    | 603.465                      | 0,46             |
| FRANCE 0.50 15-25 25/05A                                                                                                        | 1.050.000   | EUR    | 1.092.242                    | 0,83             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Global Government

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| FRANCE 1.00 16-27 25/05A                    | 1.000.000 | EUR    | 1.078.955                    | 0,82             |
| FRANCE 1.25 16-36 25/05A                    | 1.000.000 | EUR    | 1.120.375                    | 0,85             |
| FRANCE 1.25 18-34 25/05A                    | 625.000   | EUR    | 700.300                      | 0,53             |
| FRANCE 2.00 17-48 25/05A                    | 500.000   | EUR    | 643.975                      | 0,49             |
| FRANCE 2.25 11-22 25/10A                    | 650.000   | EUR    | 675.103                      | 0,51             |
| FRANCE OAT 1.5 18-50 25/05A                 | 525.000   | EUR    | 610.270                      | 0,47             |
| SOCIETE DE FINANCE LOCALE 0.00 19-24 24/05U | 500.000   | EUR    | 505.738                      | 0,39             |
| UNION NAT.INTERPRO.EMP 0.0 20-28 25/11U     | 1.000.000 | EUR    | 1.004.695                    | 0,76             |
| <b>Reino Unido</b>                          |           |        | <b>8.779.571</b>             | <b>6,68</b>      |
| UK TREASURY GILT 1.75 16-37 07/09S          | 1.200.000 | GBP    | 1.529.617                    | 1,16             |
| UK TSY 0 1/8% 2 0.1250 20-26 30/01S         | 550.000   | GBP    | 634.747                      | 0,48             |
| UK TSY 0 3/8% 2030 0.3750 20-30 22/10S      | 700.000   | GBP    | 788.111                      | 0,60             |
| UNITED KINGDOM 0.625 19-25 07/06S           | 500.000   | GBP    | 591.237                      | 0,45             |
| UNITED KINGDOM 2.25 13-23 07/09S            | 650.000   | GBP    | 793.217                      | 0,61             |
| UNITED KINGDOM 3.50 14-45 22/01S            | 630.000   | GBP    | 1.076.416                    | 0,82             |
| UNITED KINGDOM 4.25 05-55 07/12S            | 1.170.000 | GBP    | 2.535.750                    | 1,93             |
| UNITED KINGDOM 4.25 06-27 07/12S            | 575.000   | GBP    | 830.476                      | 0,63             |
| <b>Italia</b>                               |           |        | <b>7.354.340</b>             | <b>5,59</b>      |
| BUONI POLIENNAL 3.8500 18-49 01/09S         | 200.000   | EUR    | 291.783                      | 0,22             |
| CASSA DEPOSITI 1.00 20-30 11/02A            | 1.000.000 | EUR    | 1.019.555                    | 0,77             |
| ITALY 1.65 20-30 01/12S                     | 300.000   | EUR    | 324.871                      | 0,25             |
| ITALY 2.50 18-25 15/11S                     | 1.150.000 | EUR    | 1.275.511                    | 0,97             |
| ITALY 2.95 17-38 01/09S                     | 600.000   | EUR    | 743.865                      | 0,56             |
| ITALY 4.50 13-24 01/03S                     | 1.200.000 | EUR    | 1.351.650                    | 1,03             |
| ITALY BTP 6.50 97-27 01/11S                 | 700.000   | EUR    | 970.407                      | 0,74             |
| ITALY TB 2.10 19-26 15/07S                  | 300.000   | EUR    | 329.809                      | 0,25             |
| ITALY TREASURY BONDS 2.45 16-33 01/09S      | 900.000   | EUR    | 1.046.889                    | 0,80             |
| <b>España</b>                               |           |        | <b>4.407.005</b>             | <b>3,35</b>      |
| BONOS Y OBLIG DEL 1.45 17-27 31/10A         | 700.000   | EUR    | 766.084                      | 0,58             |
| BONOS Y OBLIG DEL EST 0.0 20-26 31/01A      | 300.000   | EUR    | 303.422                      | 0,23             |
| SPAIN 1.45 19-29 29/01A                     | 1.100.000 | EUR    | 1.211.111                    | 0,92             |
| SPAIN 1.85 19-35 05/03A                     | 450.000   | EUR    | 514.471                      | 0,39             |
| SPAIN 1.95 16-26 30/04A                     | 300.000   | EUR    | 331.980                      | 0,25             |
| SPAIN 2.35 17-33 30/07A                     | 300.000   | EUR    | 360.814                      | 0,28             |
| SPAIN 4.40 13-23 31/10A                     | 750.000   | EUR    | 836.430                      | 0,64             |
| SPAIN 4.70 09-41 30/07A                     | 50.000    | EUR    | 82.693                       | 0,06             |
| <b>Bélgica</b>                              |           |        | <b>2.861.436</b>             | <b>2,18</b>      |
| BELGIUM 0.375 20-30 15/04A                  | 500.000   | EUR    | 510.923                      | 0,39             |
| BELGIUM 0.40 20-40 22/06A                   | 150.000   | EUR    | 144.437                      | 0,11             |
| BELGIUM 0.50 17-24 22/10A                   | 400.000   | EUR    | 414.948                      | 0,32             |
| BELGIUM 3.75 13-45 22/06A                   | 300.000   | EUR    | 498.911                      | 0,38             |
| BELGIUM 4.25 12-22 28/09A                   | 250.000   | EUR    | 265.436                      | 0,20             |
| BELGIUM 5.00 04-35 28/03A                   | 200.000   | EUR    | 327.870                      | 0,25             |
| EUROPEAN UNION 0.00 21-31 04/07A            | 700.000   | EUR    | 698.911                      | 0,53             |
| <b>Canadá</b>                               |           |        | <b>2.463.509</b>             | <b>1,87</b>      |
| CANADA 1.00 17-22 01/09S                    | 800.000   | CAD    | 549.170                      | 0,42             |
| CANADA 1.25 19-30 01/06S                    | 250.000   | CAD    | 169.000                      | 0,13             |
| CANADA 2.25 14-25 01/06S                    | 700.000   | CAD    | 503.402                      | 0,38             |
| CANADA 2.25 18-24 01/03S                    | 250.000   | CAD    | 177.676                      | 0,13             |
| CANADA 2.75 11-22 01/06S                    | 400.000   | CAD    | 278.592                      | 0,21             |
| CANADA 3.50 11-45 01/12S                    | 200.000   | CAD    | 182.067                      | 0,14             |
| CANADA 4.00 08-41 01/06S                    | 310.000   | CAD    | 292.334                      | 0,22             |
| CANADA 5.00 04-37 01/06S                    | 50.000    | CAD    | 50.195                       | 0,04             |
| CANADA 8.00 96-27 01/06S                    | 275.000   | CAD    | 261.073                      | 0,20             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Global Government

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                         | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Australia</b>                     |           |        | <b>2.094.959</b>             | <b>1,59</b>      |
| AUSTRALIA 2.50 18-30 21/05S          | 1.000.000 | AUD    | 692.926                      | 0,53             |
| AUSTRALIA 3.00 16-47 21/03S          | 150.000   | AUD    | 108.896                      | 0,08             |
| AUSTRALIA 3.25 13-25 21/04S          | 600.000   | AUD    | 418.811                      | 0,32             |
| AUSTRALIA 3.25 15-39 21/06S          | 550.000   | AUD    | 411.956                      | 0,31             |
| AUSTRALIA 4.75 11-27 21/04S          | 600.000   | AUD    | 462.370                      | 0,35             |
| <b>Alemania</b>                      |           |        | <b>1.727.647</b>             | <b>1,31</b>      |
| GERMANY 0.00 19-50 15/08U            | 400.000   | EUR    | 367.886                      | 0,28             |
| GERMANY 4.75 08-40 04/07A            | 375.000   | EUR    | 710.492                      | 0,54             |
| LANDWIRTSCH REN 0.000 21-31 30/06A   | 650.000   | EUR    | 649.269                      | 0,49             |
| <b>Países Bajos</b>                  |           |        | <b>1.652.694</b>             | <b>1,26</b>      |
| NETHERLANDS 0.00 17-24 15/01U        | 150.000   | EUR    | 152.683                      | 0,12             |
| NETHERLANDS 0.50 16-26 15/07A        | 225.000   | EUR    | 236.737                      | 0,18             |
| NETHERLANDS 0.75 18-28 15/07A        | 300.000   | EUR    | 323.532                      | 0,25             |
| NETHERLANDS 2.00 14-24 15/07A        | 250.000   | EUR    | 270.523                      | 0,20             |
| NETHERLANDS 2.50 12-33 15/01A        | 100.000   | EUR    | 129.661                      | 0,10             |
| NETHERLANDS 2.75 14-47 15/01A        | 185.000   | EUR    | 298.806                      | 0,23             |
| NETHERLANDS 4.00 05-37 15/01A        | 150.000   | EUR    | 240.752                      | 0,18             |
| <b>Portugal</b>                      |           |        | <b>1.238.919</b>             | <b>0,94</b>      |
| PORTUGAL 0.30 21-31 17/10A           | 1.250.000 | EUR    | 1.238.919                    | 0,94             |
| <b>Rumanía</b>                       |           |        | <b>839.970</b>               | <b>0,64</b>      |
| ROMANIA 3.6240 20-30 26/05A          | 725.000   | EUR    | 839.970                      | 0,64             |
| <b>Estonia</b>                       |           |        | <b>718.810</b>               | <b>0,55</b>      |
| ESTONIA 0.125 20-30 10/06A           | 717.000   | EUR    | 718.810                      | 0,55             |
| <b>Eslovenia</b>                     |           |        | <b>718.539</b>               | <b>0,55</b>      |
| SLOVENIA 0.1250 21-31 01/07A         | 309.000   | EUR    | 308.815                      | 0,24             |
| SLOVENIA 0.275 20-30 17/02A          | 400.000   | EUR    | 409.724                      | 0,31             |
| <b>Luxemburgo</b>                    |           |        | <b>569.491</b>               | <b>0,43</b>      |
| LUXEMBOURG 0.00 20-32 14/09U         | 575.000   | EUR    | 569.491                      | 0,43             |
| <b>Dinamarca</b>                     |           |        | <b>489.660</b>               | <b>0,37</b>      |
| DENMARK 0.5 17-27 15/11A             | 1.000.000 | DKK    | 141.014                      | 0,11             |
| DENMARK 1.75 13-25 15/11A            | 1.000.000 | DKK    | 147.473                      | 0,11             |
| DENMARK 4.50 07-39 15/11A            | 850.000   | DKK    | 201.173                      | 0,15             |
| <b>Chile</b>                         |           |        | <b>405.912</b>               | <b>0,31</b>      |
| CHILE 0.83 19-31 02/07A              | 400.000   | EUR    | 405.912                      | 0,31             |
| <b>Suecia</b>                        |           |        | <b>246.192</b>               | <b>0,19</b>      |
| SWEDEN 0.1250 20-30 09/09A           | 500.000   | SEK    | 48.749                       | 0,04             |
| SWEDEN 2.25 11-32 01/06A             | 750.000   | SEK    | 88.642                       | 0,07             |
| SWEDEN 2.50 13-25 12/05A             | 1.000.000 | SEK    | 108.801                      | 0,08             |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b> |           |        | <b>6.440.482</b>             | <b>4,90</b>      |
| <b>Alemania</b>                      |           |        | <b>4.087.522</b>             | <b>3,11</b>      |
| GERMANY 0.10 15-26 15/04A            | 3.480.000 | EUR    | 4.087.522                    | 3,11             |
| <b>Estados Unidos de América</b>     |           |        | <b>2.352.960</b>             | <b>1,79</b>      |
| UNITED STATES 0.125 20-30 15/01S     | 2.450.000 | USD    | 2.352.960                    | 1,79             |

## Candriam Bonds

---

### Candriam Bonds Global Government

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                          | Cantidad | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------|----------|--------|------------------------------|------------------|
| Otros valores mobiliarios             |          |        | 542.733                      | 0,41             |
| Obligaciones                          |          |        | 542.733                      | 0,41             |
| España                                |          |        | 542.733                      | 0,41             |
| BONOS Y OBLIG DEL 1.00 20-50 31/10A   | 600.000  | EUR    | 542.733                      | 0,41             |
| <b>Total de la cartera de valores</b> |          |        | <b>127.428.105</b>           | <b>96,89</b>     |
| Coste de adquisición                  |          |        | 130.191.422                  |                  |

## Candriam Bonds

---

### Candriam Bonds Global Government

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

**Distribución geográfica (en % activo neto)**

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| Estados Unidos de América | 40,41        |
| Japón                     | 18,46        |
| Francia                   | 6,69         |
| Reino Unido               | 6,68         |
| Italia                    | 5,59         |
| Alemania                  | 4,42         |
| España                    | 3,76         |
| Bélgica                   | 2,18         |
| Canadá                    | 1,87         |
| Australia                 | 1,59         |
| Países Bajos              | 1,26         |
| Portugal                  | 0,94         |
| Rumanía                   | 0,64         |
| Estonia                   | 0,55         |
| Eslovenia                 | 0,55         |
| Luxemburgo                | 0,43         |
| Dinamarca                 | 0,37         |
| Chile                     | 0,31         |
| Suecia                    | 0,19         |
|                           | <b>96,89</b> |

**Distribución económica (en % activo neto)**

|                                                                |              |
|----------------------------------------------------------------|--------------|
| Obligaciones del Estado, de las provincias y de los municipios | 93,53        |
| Servicios varios                                               | 1,17         |
| Bancos y otras entidades financieras                           | 0,88         |
| Holdings y entidades financieras                               | 0,78         |
| Organizaciones supranacionales                                 | 0,53         |
|                                                                | <b>96,89</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Global High Yield

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |           |        | <b>250.908.875</b>           | <b>81,06</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |           |        | <b>245.281.568</b>           | <b>79,24</b>     |
| <b>Estados Unidos de América</b>                                                                                                |           |        | <b>155.874.476</b>           | <b>50,36</b>     |
| ALBERTSONS COMPANIES 5.875 19-28 15/02S                                                                                         | 4.000.000 | USD    | 3.634.927                    | 1,17             |
| ALBERTSONS COS 7.5 19-26 05/02S                                                                                                 | 1.500.000 | USD    | 1.388.186                    | 0,45             |
| ALLIED UNI HLD LLC 3.625 21-28 01/06S                                                                                           | 3.914.000 | EUR    | 3.882.297                    | 1,25             |
| ARAMARK SERVICES INC 6.375 20-25 01/05S                                                                                         | 3.874.000 | USD    | 3.470.887                    | 1,12             |
| AVANTOR FUNDING INC 2.625 20-25 01/11S                                                                                          | 1.956.000 | EUR    | 2.001.497                    | 0,65             |
| AXALTA COAT/DUTCH HLD 4.75 20-27 15/06S                                                                                         | 2.572.000 | USD    | 2.271.836                    | 0,73             |
| BUILDERS FIRSTS 5.000 20-30 01/03S                                                                                              | 2.817.000 | USD    | 2.497.626                    | 0,81             |
| BUILDERS FIRSTS 6.750 19-27 01/06S                                                                                              | 2.143.000 | USD    | 1.935.820                    | 0,63             |
| CCO HLDG LLC/CAPITAL 5.75 16-26 15/02S                                                                                          | 1.789.000 | USD    | 1.559.186                    | 0,50             |
| CCO HOLDINGS LLC 5.125 17-27 01/05S                                                                                             | 3.000.000 | USD    | 2.653.428                    | 0,86             |
| CENTENE CORP 5.375 20-26 15/08S                                                                                                 | 3.000.000 | USD    | 2.643.562                    | 0,85             |
| CENTENE ESCROW CORP 5.375 18-26 01/06S                                                                                          | 2.000.000 | USD    | 1.760.300                    | 0,57             |
| CENTURYLINK INC 4.5 20-29 15/01S                                                                                                | 3.529.000 | USD    | 2.904.231                    | 0,94             |
| CHENIERE ENERGY 4.625 20-28 15/10S                                                                                              | 4.091.000 | USD    | 3.639.434                    | 1,18             |
| CHENIERE ENERGY PART 5.625 19-26 01/10S                                                                                         | 5.000.000 | USD    | 4.374.315                    | 1,41             |
| CSC HOLDINGS LLC 4.5 21-31 15/11S                                                                                               | 4.000.000 | USD    | 3.393.676                    | 1,10             |
| EQM MIDSTREAM PARTNERS 6.50 20-27 01/07S                                                                                        | 3.000.000 | USD    | 2.820.643                    | 0,91             |
| EQT CORP 3.125 21-26 15/05S                                                                                                     | 4.923.000 | USD    | 4.243.477                    | 1,37             |
| FORD MOTOR CO 8.50 20-23 21/04S                                                                                                 | 4.159.000 | USD    | 3.913.682                    | 1,26             |
| FORD MOTOR CREDIT CO 2.33 19-25 25/11A                                                                                          | 3.507.000 | EUR    | 3.622.843                    | 1,17             |
| GOODYEAR TIRE & RUBB 5.000 21-29 15/07S                                                                                         | 1.500.000 | USD    | 1.324.311                    | 0,43             |
| GOODYEAR TIRE AND RUBB 5.25 21-31 15/07S                                                                                        | 1.500.000 | USD    | 1.321.781                    | 0,43             |
| HILTON GRAND VACATION 4.875 21-31 01/07S                                                                                        | 1.888.000 | USD    | 1.591.506                    | 0,51             |
| IQVIA INC 2.875 20-28 15/06S                                                                                                    | 2.611.000 | EUR    | 2.689.539                    | 0,87             |
| L BRANDS 6.875 16-35 01/11S                                                                                                     | 2.000.000 | USD    | 2.137.617                    | 0,69             |
| L BRANDS INC 6.75 16-36 01/07S                                                                                                  | 2.000.000 | USD    | 2.112.320                    | 0,68             |
| LEVEL 3 FINANCING INC 3.75 21-29 15/07S                                                                                         | 5.274.000 | USD    | 4.324.956                    | 1,40             |
| MACYS INC. 8.375 20-25 15/06S                                                                                                   | 2.346.000 | USD    | 2.178.443                    | 0,70             |
| MACYS RET HLDG INC 4.50 14-34 15/12S                                                                                            | 2.975.000 | USD    | 2.364.396                    | 0,76             |
| MARRIOTT OWNERSHIP RE 4.500 21-29 15/06S                                                                                        | 1.285.000 | USD    | 1.098.464                    | 0,36             |
| MATTEL 6.75 17-25 31/12S                                                                                                        | 97.000    | USD    | 85.941                       | 0,03             |
| MATTEL INC 3.75 21-29 01/04S                                                                                                    | 2.500.000 | USD    | 2.192.428                    | 0,71             |
| MATTEL INC 5.875 19-27 15/12S                                                                                                   | 2.000.000 | USD    | 1.838.266                    | 0,59             |
| NCR CORP 5.125 21-29 15/04S                                                                                                     | 3.894.000 | USD    | 3.386.194                    | 1,09             |
| NETFLIX INC 4.625 18-29 15/05S                                                                                                  | 2.000.000 | EUR    | 2.497.500                    | 0,81             |
| NEXSTAR BROADCAST 4.750 20-28 01/11S                                                                                            | 3.500.000 | USD    | 3.032.507                    | 0,98             |
| NIELSEN FINANCE 5.625 20-28 01/10S                                                                                              | 2.000.000 | USD    | 1.782.106                    | 0,58             |
| NIELSEN FINANCE LLC 4.5 21-29 15/07S                                                                                            | 3.879.000 | USD    | 3.283.199                    | 1,06             |
| NIELSEN FINANCE LLC 4.75 21-31 15/07S                                                                                           | 3.284.000 | USD    | 2.776.128                    | 0,90             |
| NOVELIS 144A 5.875 16-26 30/09S                                                                                                 | 3.500.000 | USD    | 3.070.150                    | 0,99             |
| OCCIDENTAL PETROL 6.20 19-40 15/03S                                                                                             | 3.000.000 | USD    | 2.860.410                    | 0,92             |
| OCCIDENTAL PETROLE 3.50 15-25 15/06S                                                                                            | 2.500.000 | USD    | 2.155.536                    | 0,70             |
| PILGRIMS PRIDE CORP 5.875 17-27 30/09S                                                                                          | 3.505.000 | USD    | 3.147.673                    | 1,02             |
| POST HOLDINGS 144A 5.75 17-27 01/03S                                                                                            | 2.980.000 | USD    | 2.629.079                    | 0,85             |
| POST HOLDINGS INC 4.625 20-30 15/04S                                                                                            | 1.625.000 | USD    | 1.390.821                    | 0,45             |
| PRIME SECURITY SERVICE 3.375 20-27 31/08S                                                                                       | 5.275.000 | USD    | 4.314.656                    | 1,39             |
| PTC INC 3.625 20-25 15/02S                                                                                                      | 1.493.000 | USD    | 1.296.728                    | 0,42             |
| SBA COMMUNICATIONS 4.875 17-24 01/09S                                                                                           | 4.000.000 | USD    | 3.431.993                    | 1,11             |
| SIRIUS SATELLITE 4.00 21-28 15/07S                                                                                              | 2.000.000 | USD    | 1.741.833                    | 0,56             |
| SIRIUS XM HOLDINGS 4.625 19-24 15/07S                                                                                           | 4.250.000 | USD    | 3.678.388                    | 1,19             |
| SIRIUS XM RADIO INC 5.375 16-26 15/07S                                                                                          | 2.500.000 | USD    | 2.176.617                    | 0,70             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Global High Yield

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| SPRINT CORP 7.875 14-23 15/09S           | 7.000.000 | USD    | 6.705.904                    | 2,17             |
| TARGA RESOURCES PARTN 5.00 18-28 15/01S  | 1.500.000 | USD    | 1.334.430                    | 0,43             |
| TARGA RES PART ELEC 6.50 19-27 15/07S    | 1.500.000 | USD    | 1.370.756                    | 0,44             |
| TEGNA INC 5.00 20-29 15/09S              | 3.000.000 | USD    | 2.647.306                    | 0,86             |
| TENET HEALTHCARE 7.50 20-25 01/04S       | 2.000.000 | USD    | 1.819.293                    | 0,59             |
| TENET HEALTHCARE CORP 4.25 21-29 01/06S  | 2.641.000 | USD    | 2.255.562                    | 0,73             |
| T-MOBILE USA IN 5.3750 17-27 15/04S      | 2.525.000 | USD    | 2.267.624                    | 0,73             |
| WESTERN GAS PARTNERS 3.95 15-25 01/06S   | 2.510.000 | USD    | 2.199.187                    | 0,71             |
| YUM! BRANDS INC 7.7500 20-25 01/04S      | 3.000.000 | USD    | 2.751.075                    | 0,89             |
| <b>Países Bajos</b>                      |           |        | <b>27.762.323</b>            | <b>8,97</b>      |
| ABERTIS FINANCE BV 3.248 20-XX XX/XXA    | 2.000.000 | EUR    | 2.067.500                    | 0,67             |
| ALCOA NEDERLAND 5.50 20-27 15/12S        | 2.500.000 | USD    | 2.286.871                    | 0,74             |
| ALCOA NEDERLAND HLD 7.00 16-26 30/09S    | 2.983.000 | USD    | 2.628.582                    | 0,85             |
| AXALTA COATING 3.75 16-25 15/01S         | 500.000   | EUR    | 508.550                      | 0,16             |
| ENERGIZER GAMMA 3.5000 21-29 30/06S      | 2.970.000 | EUR    | 2.964.179                    | 0,96             |
| ENERGIZER GAMMA 4.6250 18-26 15/07S      | 833.000   | EUR    | 852.242                      | 0,28             |
| OI EUROPEAN GRO 2.8750 19-25 15/02S      | 1.349.000 | EUR    | 1.368.199                    | 0,44             |
| OI EUROPEAN GROUP 3.125 16-24 15/11S     | 2.260.000 | EUR    | 2.336.528                    | 0,75             |
| REPSOL INTL FINANCE 2.5000 21-XX XX/XXA  | 3.822.000 | EUR    | 3.841.110                    | 1,24             |
| TELEFONICA EUROPE BV 2.376 21-99 31/12A  | 4.700.000 | EUR    | 4.593.724                    | 1,48             |
| UPC BROADBAND FINCO B 4.875 21-31 15/07S | 2.363.000 | USD    | 1.997.162                    | 0,65             |
| ZIGGO SEC FIN 144A 5.50 16-27 15/01S     | 2.646.000 | USD    | 2.317.676                    | 0,75             |
| <b>Reino Unido</b>                       |           |        | <b>19.287.000</b>            | <b>6,23</b>      |
| JAGUAR LAND ROVER 5.875 20-28 15/01S     | 2.000.000 | USD    | 1.775.023                    | 0,57             |
| MARKS SPENCER 3.7500 20-26 19/05A        | 1.598.000 | GBP    | 1.933.266                    | 0,62             |
| TARGA RESOURCES 5.875 18-26 15/04S       | 3.080.000 | USD    | 2.727.848                    | 0,88             |
| VIRGIN MEDIA SE 4.5000 20-30 15/08S      | 2.000.000 | USD    | 1.699.131                    | 0,55             |
| VMED O2 UK FINA 4.7500 21-31 15/07S      | 3.000.000 | USD    | 2.571.313                    | 0,83             |
| VMED O2 UK FINANCING 4.25 20-31 31/01S   | 2.000.000 | USD    | 1.656.767                    | 0,54             |
| VMED O2 UK FINANCING I 4.5 21-31 15/07S  | 2.000.000 | GBP    | 2.342.152                    | 0,76             |
| VODAFONE GROUP 3.1 18-79 03/01A          | 4.400.000 | EUR    | 4.581.500                    | 1,48             |
| <b>Canadá</b>                            |           |        | <b>11.807.267</b>            | <b>3,81</b>      |
| 1011778 BC/NEW RED FIN 5.75 20-25 15/04S | 2.530.000 | USD    | 2.258.759                    | 0,73             |
| 1011778 BC UNLIMITED 3.875 19-28 15/01S  | 4.000.000 | USD    | 3.415.128                    | 1,10             |
| BAUSCH HEALTH C 7.0000 19-28 15/01S      | 2.000.000 | USD    | 1.737.077                    | 0,56             |
| BAUSCH HEALTH COMPANIE 5.00 20-29 15/02S | 4.000.000 | USD    | 3.145.291                    | 1,02             |
| BAUSCH HEALTH COS INC6.2500 20-29 15/02S | 1.500.000 | USD    | 1.251.012                    | 0,40             |
| <b>Francia</b>                           |           |        | <b>6.160.384</b>             | <b>1,99</b>      |
| ALTICE FRANCE S 8.1250 18-27 01/02S      | 3.000.000 | USD    | 2.756.135                    | 0,89             |
| ALTICE FRANCE SA 7.375 16-26 01/05S      | 2.265.000 | USD    | 1.986.206                    | 0,64             |
| FAURECIA 2.625 18-25 15/06S              | 1.400.000 | EUR    | 1.418.043                    | 0,46             |
| <b>Irlanda</b>                           |           |        | <b>5.455.937</b>             | <b>1,76</b>      |
| ARDAGH PACKAGING FIN 2.125 20-26 15/08S  | 1.342.000 | EUR    | 1.342.000                    | 0,43             |
| ARDAGH PACKAGING FIN 4.125 19-26 15/08S  | 1.577.000 | USD    | 1.373.010                    | 0,44             |
| ARDAGH PACKAGING FIN 5.25 20-25 30/04S   | 3.092.000 | USD    | 2.740.927                    | 0,89             |
| <b>Luxemburgo</b>                        |           |        | <b>4.520.903</b>             | <b>1,46</b>      |
| ALTICE FINANCING 144A 7.50 16-26 15/05S  | 3.168.000 | USD    | 2.781.717                    | 0,90             |
| DANA FINANCING LUX 5.75 17-25 15/04S     | 2.000.000 | USD    | 1.739.186                    | 0,56             |
| <b>Antillas Neerlandesas</b>             |           |        | <b>4.471.510</b>             | <b>1,45</b>      |
| TEVA PHARMA 1.625 16-28 15/10A           | 3.515.000 | EUR    | 3.097.720                    | 1,00             |
| TEVA PHARMA 1.875 15-27 31/03A           | 1.500.000 | EUR    | 1.373.790                    | 0,45             |
| <b>México</b>                            |           |        | <b>3.805.454</b>             | <b>1,23</b>      |
| CEMEX SAB DE CV 7.375 20-27 05/06S       | 4.001.000 | USD    | 3.805.454                    | 1,23             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Global High Yield

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                           | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Suecia</b>                                          |           |        | <b>3.385.239</b>             | <b>1,09</b>      |
| VERISURE HOLDING AB 3.25 21-27 15/02S                  | 1.330.000 | EUR    | 1.330.239                    | 0,43             |
| VERISURE MIDHOL 5.2500 21-29 15/02S                    | 2.000.000 | EUR    | 2.055.000                    | 0,66             |
| <b>Australia</b>                                       |           |        | <b>2.751.075</b>             | <b>0,89</b>      |
| FMG RESOURCES 4.50 19-27 15/09S                        | 3.000.000 | USD    | 2.751.075                    | 0,89             |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>                   |           |        | <b>5.627.307</b>             | <b>1,82</b>      |
| <b>Países Bajos</b>                                    |           |        | <b>3.498.277</b>             | <b>1,13</b>      |
| REPSOL INTL FINANCE FL.R 20-XX 11/12A                  | 1.302.000 | EUR    | 1.432.085                    | 0,46             |
| TELEFONICA EUROPE BV FL.R 18-XX 22/09A                 | 2.000.000 | EUR    | 2.066.192                    | 0,67             |
| <b>Italia</b>                                          |           |        | <b>2.129.030</b>             | <b>0,69</b>      |
| ENI SPA FL.R 20-49 31/12A                              | 2.000.000 | EUR    | 2.129.030                    | 0,69             |
| <b>Otros valores mobiliarios</b>                       |           |        | <b>13.217.472</b>            | <b>4,27</b>      |
| <b>Obligaciones</b>                                    |           |        | <b>13.217.472</b>            | <b>4,27</b>      |
| <b>Estados Unidos de América</b>                       |           |        | <b>13.217.472</b>            | <b>4,27</b>      |
| ANTERO RESOURCES CORP 5.375 21-30 01/03S               | 4.000.000 | USD    | 3.438.317                    | 1,11             |
| CSC HOLDINGS LLC 7.5 18-28 01/04S                      | 4.000.000 | USD    | 3.701.830                    | 1,20             |
| SUMMER BC BIDCO B LLC 5.5 21-26 31/10S                 | 2.800.000 | USD    | 2.411.249                    | 0,78             |
| VALEANT PHAR. 8.5 18-27 01/06S                         | 4.000.000 | USD    | 3.666.076                    | 1,18             |
| <b>Organismos de Inversión Colectiva</b>               |           |        | <b>28.834.233</b>            | <b>9,31</b>      |
| <b>Acciones/Participaciones en fondos de inversión</b> |           |        | <b>28.834.233</b>            | <b>9,31</b>      |
| <b>Francia</b>                                         |           |        | <b>28.834.233</b>            | <b>9,31</b>      |
| CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV V EUR C                       | 290       | EUR    | 28.834.233                   | 9,31             |
| <b>Total de la cartera de valores</b>                  |           |        | <b>292.960.580</b>           | <b>94,64</b>     |
| Coste de adquisición                                   |           |        | 289.764.899                  |                  |

# Candriam Bonds

---

## Candriam Bonds Global High Yield

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

### Distribución geográfica (en % activo neto)

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| Estados Unidos de América | 54,63        |
| Francia                   | 11,31        |
| Países Bajos              | 10,10        |
| Reino Unido               | 6,23         |
| Canadá                    | 3,81         |
| Irlanda                   | 1,76         |
| Luxemburgo                | 1,46         |
| Antillas Neerlandesas     | 1,44         |
| México                    | 1,23         |
| Suecia                    | 1,09         |
| Australia                 | 0,89         |
| Italia                    | 0,69         |
|                           | <b>94,64</b> |

### Distribución económica (en % activo neto)

|                                                 |              |
|-------------------------------------------------|--------------|
| Holdings y entidades financieras                | 27,08        |
| Telecomunicaciones                              | 13,02        |
| Fondos de inversión                             | 9,31         |
| Petróleo                                        | 6,22         |
| Servicios sociales y de sanidad pública         | 4,73         |
| Artículos de oficina y ordenadores              | 3,63         |
| Comercio minorista y grandes almacenes          | 3,46         |
| Farmacia y cosméticos                           | 3,17         |
| Construcción, material de construcción          | 2,66         |
| Servicios varios                                | 2,57         |
| Industria automovilística                       | 2,30         |
| Industria del embalaje                          | 1,76         |
| Industrias agro-alimentarias                    | 1,75         |
| Energía y servicio de aguas                     | 1,37         |
| Bienes de consumo diversos                      | 1,33         |
| Internet y servicios de Internet                | 1,23         |
| Transporte                                      | 1,20         |
| Sociedades inmobiliarias                        | 1,11         |
| Instituciones inclasificables / no clasificadas | 1,10         |
| Agricultura y pesca                             | 1,02         |
| Minas                                           | 0,99         |
| Restaurantes, hoteles                           | 0,89         |
| Bancos y otras entidades financieras            | 0,88         |
| Artes gráficas y editoriales                    | 0,85         |
| Caucho y neumáticos                             | 0,85         |
| Química                                         | 0,16         |
|                                                 | <b>94,64</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Global Inflation Short Duration

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad    | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |             |        | <b>246.611.464</b>           | <b>96,84</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |             |        | <b>1.494.078</b>             | <b>0,59</b>      |
| <b>Alemania</b>                                                                                                                 |             |        | <b>1.494.078</b>             | <b>0,59</b>      |
| GERMANY 0.50 14-30 15/04A                                                                                                       | 1.150.000   | EUR    | 1.494.078                    | 0,59             |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>                                                                                            |             |        | <b>245.117.386</b>           | <b>96,25</b>     |
| <b>Estados Unidos de América</b>                                                                                                |             |        | <b>154.086.456</b>           | <b>60,51</b>     |
| UNITED STATES 0.125 13-23 15/01S                                                                                                | 5.000.000   | USD    | 5.095.631                    | 2,00             |
| UNITED STATES 0.125 14-24 15/07S                                                                                                | 6.500.000   | USD    | 6.629.731                    | 2,60             |
| UNITED STATES 0.125 19-24 15/10S                                                                                                | 6.500.000   | USD    | 6.149.958                    | 2,42             |
| UNITED STATES 0.125 20-30 15/01S                                                                                                | 4.775.000   | USD    | 4.585.872                    | 1,80             |
| UNITED STATES 0.25 15-25 15/01S                                                                                                 | 8.000.000   | USD    | 8.233.239                    | 3,23             |
| UNITED STATES 0.375 15-25 15/07S                                                                                                | 7.500.000   | USD    | 7.822.233                    | 3,07             |
| UNITED STATES 0.50 19-24 15/04S                                                                                                 | 15.000.000  | USD    | 14.436.841                   | 5,67             |
| UNITED STATES 0.625 14-24 15/01S                                                                                                | 11.750.000  | USD    | 12.214.088                   | 4,80             |
| UNITED STATES 0.625 18-23 15/04S                                                                                                | 10.000.000  | USD    | 9.587.941                    | 3,77             |
| UNITED STATES FL.R 20-25 15/10S                                                                                                 | 8.500.000   | USD    | 8.029.468                    | 3,15             |
| UNITED STATES IND 0.125 21-26 15/04S                                                                                            | 12.500.000  | USD    | 11.468.577                   | 4,50             |
| USA T NOTES INDEX 0.125 16-26 15/07S                                                                                            | 5.000.000   | USD    | 5.145.215                    | 2,02             |
| USA T NOTES INDEX 0.375 13-23 15/07S                                                                                            | 11.800.000  | USD    | 12.144.887                   | 4,77             |
| USA T NOTES INDEX 2.00 06-26 15/01S                                                                                             | 10.000.000  | USD    | 13.354.919                   | 5,25             |
| USA T NOTES INDEX 2.375 04-25 15/01S                                                                                            | 6.500.000   | USD    | 9.025.107                    | 3,54             |
| US TREASURY INDEX 0.125 20-25 15/04S                                                                                            | 8.000.000   | USD    | 7.529.246                    | 2,96             |
| US TREASURY INDEXE 0.625 16-26 15/01S                                                                                           | 12.000.000  | USD    | 12.633.503                   | 4,96             |
| <b>Reino Unido</b>                                                                                                              |             |        | <b>23.194.962</b>            | <b>9,11</b>      |
| UK TSY(RPI INDEXED) 0.125 12-24 22/03S                                                                                          | 6.000.000   | GBP    | 9.472.948                    | 3,72             |
| UK TSY (RPI INDEXE FL.R 15-26 22/03S                                                                                            | 3.700.000   | GBP    | 5.811.445                    | 2,28             |
| UNITED KINGDOM INDEX 2.50 86-24 17/07S                                                                                          | 1.900.000   | GBP    | 7.910.569                    | 3,11             |
| <b>Francia</b>                                                                                                                  |             |        | <b>18.090.488</b>            | <b>7,10</b>      |
| FRANCE 0.10 15-25 01/03A                                                                                                        | 2.200.000   | EUR    | 2.462.217                    | 0,97             |
| FRANCE 0.1 20-26 01/03A                                                                                                         | 5.500.000   | EUR    | 5.983.752                    | 2,35             |
| FRANCE 0.25 13-24 25/07A                                                                                                        | 4.100.000   | EUR    | 4.740.091                    | 1,86             |
| RESEAU FERRE INDEXEE 2.45 03-23 28/02A                                                                                          | 3.500.000   | EUR    | 4.904.428                    | 1,92             |
| <b>Italia</b>                                                                                                                   |             |        | <b>14.614.912</b>            | <b>5,74</b>      |
| ITALY 2.35 14-24 15/09S                                                                                                         | 4.000.000   | EUR    | 4.797.837                    | 1,88             |
| ITALY 2.60 07-23 15/09S                                                                                                         | 5.750.000   | EUR    | 7.634.693                    | 3,00             |
| ITALY BUONI POLIENNA 0.65 20-26 15/05S                                                                                          | 1.300.000   | EUR    | 1.424.908                    | 0,56             |
| TRASMISSIONE ELETTRI 2.731 07-23 15/09S                                                                                         | 600.000     | EUR    | 757.474                      | 0,30             |
| <b>Alemania</b>                                                                                                                 |             |        | <b>13.028.415</b>            | <b>5,12</b>      |
| GERMANY 0.10 12-23 15/04A                                                                                                       | 4.500.000   | EUR    | 5.100.033                    | 2,00             |
| GERMANY 0.10 15-26 15/04A                                                                                                       | 6.750.000   | EUR    | 7.928.382                    | 3,12             |
| <b>Japón</b>                                                                                                                    |             |        | <b>9.372.278</b>             | <b>3,68</b>      |
| JAPAN (INDEXED) 0.10 14-24 10/03S                                                                                               | 340.000.000 | JPY    | 2.732.229                    | 1,07             |
| JAPAN (INDEXED) 0.10 14-24 10/09S                                                                                               | 200.000.000 | JPY    | 1.565.485                    | 0,61             |
| JAPAN 0.10 15-25 10/03S                                                                                                         | 255.000.000 | JPY    | 2.002.873                    | 0,79             |
| JAPAN 0.10 16-26 10/03S                                                                                                         | 390.000.000 | JPY    | 3.071.691                    | 1,21             |
| <b>España</b>                                                                                                                   |             |        | <b>5.839.724</b>             | <b>2,29</b>      |
| SPAIN 0.15 17-23 30/11A                                                                                                         | 1.500.000   | EUR    | 1.643.057                    | 0,64             |
| SPAIN INDEXED 1.80 13-24 30/11A                                                                                                 | 3.500.000   | EUR    | 4.196.667                    | 1,65             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Global Inflation Short Duration

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                           | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Australia</b>                                       |            |        | <b>2.043.483</b>             | <b>0,80</b>      |
| AUSTRALIA 3.00 11-16 05/04Q                            | 2.150.000  | AUD    | 2.043.483                    | 0,80             |
| <b>Suecia</b>                                          |            |        | <b>1.630.782</b>             | <b>0,64</b>      |
| SWEDEN NR 3112 INDEX 0.125 15-26 01/06A                | 14.000.000 | SEK    | 1.630.782                    | 0,64             |
| <b>Canadá</b>                                          |            |        | <b>1.459.182</b>             | <b>0,57</b>      |
| CANADA 4.00 99-31 01/12S                               | 950.000    | CAD    | 1.459.182                    | 0,57             |
| <b>Nueva Zelanda</b>                                   |            |        | <b>917.833</b>               | <b>0,36</b>      |
| NEW ZEALAND 2.00 12-25 20/09Q                          | 1.250.000  | NZD    | 917.833                      | 0,36             |
| <b>Dinamarca</b>                                       |            |        | <b>838.871</b>               | <b>0,33</b>      |
| DENMARK 0.10 11-23 15/11A                              | 5.500.000  | DKK    | 838.871                      | 0,33             |
| <b>Otros valores mobiliarios</b>                       |            |        | <b>2.538.562</b>             | <b>1,00</b>      |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>                   |            |        | <b>2.538.562</b>             | <b>1,00</b>      |
| <b>México</b>                                          |            |        | <b>2.538.562</b>             | <b>1,00</b>      |
| MEXICO UDIBONOS INDEX 4.50 06-25 12/04S                | 80.000     | MXN    | 2.538.562                    | 1,00             |
| <b>Organismos de Inversión Colectiva</b>               |            |        | <b>2.625.511</b>             | <b>1,03</b>      |
| <b>Acciones/Participaciones en fondos de inversión</b> |            |        | <b>2.625.511</b>             | <b>1,03</b>      |
| <b>Luxemburgo</b>                                      |            |        | <b>2.625.511</b>             | <b>1,03</b>      |
| G FUND EUROPEAN CONVERTIBLE BONDS I EUR CAP            | 1.530      | EUR    | 2.625.511                    | 1,03             |
| <b>Total de la cartera de valores</b>                  |            |        | <b>251.775.537</b>           | <b>98,87</b>     |
| Coste de adquisición                                   |            |        | 247.255.857                  |                  |

## Candriam Bonds

---

### Candriam Bonds Global Inflation Short Duration

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

**Distribución geográfica (en % activo neto)**

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| Estados Unidos de América | 60,51        |
| Reino Unido               | 9,11         |
| Francia                   | 7,11         |
| Italia                    | 5,74         |
| Alemania                  | 5,70         |
| Japón                     | 3,68         |
| España                    | 2,29         |
| Luxemburgo                | 1,03         |
| México                    | 1,00         |
| Australia                 | 0,80         |
| Suecia                    | 0,64         |
| Canadá                    | 0,57         |
| Nueva Zelanda             | 0,36         |
| Dinamarca                 | 0,33         |
|                           | <b>98,87</b> |

**Distribución económica (en % activo neto)**

|                                                                |              |
|----------------------------------------------------------------|--------------|
| Obligaciones del Estado, de las provincias y de los municipios | 95,61        |
| Varios                                                         | 1,93         |
| Fondos de inversión                                            | 1,03         |
| Energía y servicio de aguas                                    | 0,30         |
|                                                                | <b>98,87</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds International

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad    | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |             |        | <b>97.115.766</b>            | <b>88,62</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |             |        | <b>84.397.857</b>            | <b>77,01</b>     |
| <b>Estados Unidos de América</b>                                                                                                |             |        | <b>27.701.204</b>            | <b>25,28</b>     |
| ABBOTT LABORATORIES 1.15 20-28 30/01S                                                                                           | 400.000     | USD    | 330.777                      | 0,30             |
| AMEX CREDIT CORP 3.30 17-27 03/05S                                                                                              | 800.000     | USD    | 746.282                      | 0,68             |
| AT&AMP T INC 2.55 20-33 01/12S                                                                                                  | 1.440.000   | USD    | 1.199.581                    | 1,09             |
| AT&T INC 4.125 16-26 17/02S                                                                                                     | 744.000     | USD    | 705.526                      | 0,64             |
| AVANTOR FUNDING INC 2.62520-25 01/11S                                                                                           | 600.000     | EUR    | 615.078                      | 0,56             |
| BERRY GLOBAL IN 1.5000 20-27 15/01S                                                                                             | 500.000     | EUR    | 509.923                      | 0,47             |
| BUONI POLIENNAL 1.5000 21-45 30/04S                                                                                             | 350.000     | EUR    | 340.480                      | 0,31             |
| CISCO SYSTEMS I 2.5000 16-26 20/09S                                                                                             | 1.316.000   | USD    | 1.190.342                    | 1,09             |
| COLGATE-PALMOLIVE CO 0.875 19-29 12/11S                                                                                         | 300.000     | EUR    | 302.918                      | 0,28             |
| CRH AMERICA INC RE 3.875 15-25 18/05                                                                                            | 500.000     | USD    | 462.510                      | 0,42             |
| ELI LILLY & CO 3.3750 19-29 15/03S                                                                                              | 800.000     | USD    | 756.809                      | 0,69             |
| EQUINIX INC 1.5500 20-28 15/03S                                                                                                 | 600.000     | USD    | 496.595                      | 0,45             |
| HOME DEPOT INC 5.875 06-36 16/12S                                                                                               | 400.000     | USD    | 481.587                      | 0,44             |
| INTEL CORP 2.45 19-29 15/11S                                                                                                    | 800.000     | USD    | 710.030                      | 0,65             |
| INTER-AM.DEV.BK TR.4 6.75 97-27 15/07S                                                                                          | 100.000     | USD    | 108.751                      | 0,10             |
| IQVIA INC 1.7500 21-26 15/03S                                                                                                   | 500.000     | EUR    | 505.700                      | 0,46             |
| KELLOGG CO 3.25 16-26 01/04S                                                                                                    | 800.000     | USD    | 737.209                      | 0,67             |
| MANPOWERGROUP INC 1.75 18-26 22/06A                                                                                             | 527.000     | EUR    | 565.716                      | 0,52             |
| METLIFE INC 4.5500 20-30 23/03S                                                                                                 | 500.000     | USD    | 505.837                      | 0,46             |
| MONDELEZ INTERNATIONAL0.25 21-28 17/03A                                                                                         | 701.000     | EUR    | 696.941                      | 0,64             |
| PEPSICO 3.50 15-25 17/07S                                                                                                       | 1.116.000   | USD    | 1.033.785                    | 0,94             |
| PEPSICO INC 0.7500 19-27 18/03A                                                                                                 | 500.000     | EUR    | 521.150                      | 0,48             |
| PROCTER & GAMBLE CO 0.55 20-25 29/10S                                                                                           | 526.000     | USD    | 438.227                      | 0,40             |
| PROLOGIS EURO FINANCE 0.375 20-28 06/02A                                                                                        | 406.000     | EUR    | 409.786                      | 0,37             |
| PROLOGIS LP 1.625 20-32 17/06A                                                                                                  | 146.000     | EUR    | 158.130                      | 0,14             |
| PRUDENTIAL FIN INC 3.878 18-28 27/03S                                                                                           | 600.000     | USD    | 579.302                      | 0,53             |
| ROCHE HOLDINGS INC 3 15-25 10/11S                                                                                               | 1.450.000   | USD    | 1.325.223                    | 1,21             |
| STARBUCKS CORP 3.5500 19-29 15/08S                                                                                              | 500.000     | USD    | 471.857                      | 0,43             |
| THE WALT DISNEY COMP 2.75 19-49 01/09S                                                                                          | 900.000     | USD    | 746.498                      | 0,68             |
| TOYOTA MOTOR CR 0.8000 20-25 16/10S                                                                                             | 207.000     | USD    | 173.222                      | 0,16             |
| UNITED STATES 2.00 15-25 15/08S                                                                                                 | 1.100.000   | USD    | 975.900                      | 0,89             |
| UNITED STATES 2.00 16-26 15/11S                                                                                                 | 900.000     | USD    | 800.539                      | 0,73             |
| UNITED STATES 2.125 11-21 15/08S                                                                                                | 800.000     | USD    | 940.214                      | 0,86             |
| UNITED STATES 2.50 15-45 15/02S                                                                                                 | 968.000     | USD    | 880.410                      | 0,80             |
| UNITED STATES 2.875 13-43 15/05S                                                                                                | 855.600     | USD    | 826.993                      | 0,76             |
| UNITED STATES 3.00 14-44 15/11S                                                                                                 | 800.000     | USD    | 791.698                      | 0,72             |
| UNITED STATES 5.25 99-29 15/02S                                                                                                 | 653.800     | USD    | 710.244                      | 0,65             |
| UNITED STATES OF AMER 0.375 20-25 31/12S                                                                                        | 600.000     | USD    | 496.241                      | 0,45             |
| USA T NOTES 2.50 16-46 15/02S                                                                                                   | 450.000     | USD    | 409.756                      | 0,37             |
| USA TREASURY NOTES 6.00 96-26 15/02S                                                                                            | 1.700.000   | USD    | 1.771.617                    | 1,62             |
| VERIZON COMMUNICATION 4.329 18-28 21/09S                                                                                        | 800.000     | USD    | 783.392                      | 0,72             |
| VOLKSWAGEN GROU 1.2500 20-25 24/11S                                                                                             | 582.000     | USD    | 488.428                      | 0,45             |
| <b>Japón</b>                                                                                                                    |             |        | <b>11.622.177</b>            | <b>10,60</b>     |
| JAPAN (10 YEAR 0.1000 20-30 20/06S                                                                                              | 20.000.000  | JPY    | 153.133                      | 0,14             |
| JAPAN (20 YEAR 0.4000 20-40 20/06S                                                                                              | 4.000.000   | JPY    | 30.299                       | 0,03             |
| JAPAN (30 YEAR ISS 1.60 15-45 20/06S                                                                                            | 35.000.000  | JPY    | 328.906                      | 0,30             |
| JAPAN 0.10 19-24 20/09S                                                                                                         | 353.100.000 | JPY    | 2.702.566                    | 2,46             |
| JAPAN 0.30 16-46 20/06S                                                                                                         | 76.400.000  | JPY    | 544.403                      | 0,50             |
| JAPAN 0.70 18-48 20/06S                                                                                                         | 103.400.000 | JPY    | 801.579                      | 0,73             |
| JAPAN -156- 0.40 16-36 20/03S                                                                                                   | 165.000.000 | JPY    | 1.281.271                    | 1,17             |
| JAPAN 157 0.20 16-36 20/06S                                                                                                     | 130.000.000 | JPY    | 979.550                      | 0,89             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds International

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                              | Cantidad    | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|-------------------------------------------|-------------|--------|------------------------------|------------------|
| JAPAN 20 YEAR ISSUE 0.4 19-39 20/03S      | 115.350.000 | JPY    | 881.103                      | 0,80             |
| JAPAN 30 YEAR ISSUE 0.5 19-49 20/03S      | 61.000.000  | JPY    | 447.118                      | 0,41             |
| JAPAN 344 0.10 16-26 20/09S               | 190.000.000 | JPY    | 1.458.088                    | 1,33             |
| JAPAN 69 2.10 04-24 20/03S                | 250.000.000 | JPY    | 2.014.161                    | 1,84             |
| <b>Francia</b>                            |             |        | <b>8.505.200</b>             | <b>7,76</b>      |
| BNP PAR 4.40 18-28 14/08S                 | 700.000     | USD    | 681.781                      | 0,62             |
| BNP PARIBAS FL.R 19-27 23/01A             | 1.000.000   | EUR    | 1.079.760                    | 0,98             |
| BPCE SA 3.25 18-28 11/01S                 | 500.000     | USD    | 459.090                      | 0,42             |
| CAISSE D'AMORT 1.0000 20-30 21/10S        | 1.000.000   | USD    | 799.890                      | 0,73             |
| CAPGEMINI SE 1.125 20-30 23/06A           | 500.000     | EUR    | 527.828                      | 0,48             |
| CARREFOUR BANQUE 0.107 21-25 14/06A       | 200.000     | EUR    | 200.428                      | 0,18             |
| CROWN EURO HOLDINGS 0.75 19-23 15/02S     | 600.000     | EUR    | 602.319                      | 0,55             |
| ELIS SA 1.0 19-25 03/04A                  | 600.000     | EUR    | 598.161                      | 0,55             |
| FRANCE 0.00 20-26 25/02A                  | 250.000     | EUR    | 255.150                      | 0,23             |
| FRANCE 0.00 20-30 25/11U                  | 240.000     | EUR    | 239.362                      | 0,22             |
| FRANCE 1.75 17-39 25/06A                  | 420.000     | EUR    | 509.991                      | 0,47             |
| FRANCE OAT 1.5 18-50 25/05A               | 690.000     | EUR    | 802.070                      | 0,73             |
| ICADE SANTE SAS 1.375 20-30 17/09A        | 300.000     | EUR    | 315.398                      | 0,29             |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.0 20-27 09/04A    | 400.000     | EUR    | 423.096                      | 0,39             |
| SOCIETE GENERALE SA 4.75 18-28 14/09S     | 500.000     | USD    | 491.772                      | 0,45             |
| SPIE SA 2.625 19-26 18/06A                | 500.000     | EUR    | 519.104                      | 0,47             |
| <b>Países Bajos</b>                       |             |        | <b>5.825.060</b>             | <b>5,31</b>      |
| ASML HOLDING NV 0.6250 20-29 07/05A       | 436.000     | EUR    | 449.959                      | 0,41             |
| BMW FINANCE NV 0.0000 21-26 11/01A        | 581.000     | EUR    | 581.915                      | 0,53             |
| EDP FINANCE 0.3750 19-26 16/09A           | 900.000     | EUR    | 910.062                      | 0,83             |
| EDP FINANCE 3.625 17-24 15/07S            | 400.000     | USD    | 362.531                      | 0,33             |
| ING GROEP NV 4.55 18-28 02/10S            | 500.000     | USD    | 495.554                      | 0,45             |
| NETHERLANDS 0.00 21-31 15/07A             | 300.000     | EUR    | 302.898                      | 0,28             |
| NETHERLANDS 0.25 19-29 14/02A             | 200.000     | EUR    | 208.300                      | 0,19             |
| NN BANK NV NETH 1.0000 18-28 25/09A       | 900.000     | EUR    | 968.544                      | 0,88             |
| RABOBANK FL.R 19-XX 29/06S                | 600.000     | EUR    | 622.074                      | 0,57             |
| REPSOL INTL FINANCE 2.5000 21-XX XX/XXA   | 300.000     | EUR    | 302.248                      | 0,27             |
| SIEMENS FINANCIER 3.25 15-25 27/05S       | 500.000     | USD    | 457.697                      | 0,42             |
| VW INTL FINANCE 1.625 15-30 16/01A        | 150.000     | EUR    | 163.278                      | 0,15             |
| <b>Italia</b>                             |             |        | <b>5.469.981</b>             | <b>4,99</b>      |
| ACEA SPA 0.2500 21-30 28/07A              | 200.000     | EUR    | 195.146                      | 0,18             |
| ASSICURAZIONI GENERALI 2.429 20-31 14/07A | 278.000     | EUR    | 299.988                      | 0,27             |
| AUTOSTRAD PER L'ITAL 2.65 20-28 08/03A    | 300.000     | EUR    | 313.076                      | 0,28             |
| ENI 0.375 21-28 14/06A                    | 405.000     | EUR    | 406.312                      | 0,37             |
| INTESA SANPAOLO 1.0000 19-24 04/07A       | 900.000     | EUR    | 927.050                      | 0,85             |
| ITALY 1.65 15-32 01/03S                   | 180.000     | EUR    | 194.386                      | 0,18             |
| ITALY 1.65 20-30 01/12S                   | 300.000     | EUR    | 324.871                      | 0,30             |
| ITALY 1.80 20-41 01/03S                   | 600.000     | EUR    | 627.267                      | 0,57             |
| ITALY BUONI POLIENNALI 0.95 20-30 01/08S  | 1.000.000   | EUR    | 1.022.210                    | 0,93             |
| TRAMMISSIONE ELETTRI 0.375 21-29 23/06A   | 561.000     | EUR    | 561.098                      | 0,51             |
| UNICREDIT 2.569 20-26 22/09S              | 700.000     | USD    | 598.577                      | 0,55             |
| <b>Reino Unido</b>                        |             |        | <b>5.460.529</b>             | <b>4,98</b>      |
| BP CAPITAL MARKETS 3.25 20-XX 22/06A      | 300.000     | EUR    | 321.092                      | 0,29             |
| BRITISH TELECOM 1.75 16-26 10/03A         | 200.000     | EUR    | 214.265                      | 0,20             |
| HSBC HOLDINGS PLC 4.00 21-99 31/12S       | 422.000     | USD    | 362.908                      | 0,33             |
| SANTANDER UK 4.00 14-24 13/03S            | 465.000     | USD    | 427.287                      | 0,39             |
| UK TREASURY GILT 1.75 16-37 07/09S        | 620.000     | GBP    | 790.302                      | 0,72             |
| UNITED KINGDOM 1.50 16-26 22/07S          | 899.000     | GBP    | 1.107.834                    | 1,01             |
| UNITED KINGDOM 1.50 16-47 22/07S          | 380.000     | GBP    | 468.861                      | 0,43             |
| UNITED KINGDOM 3.25 12-44 22/01S          | 400.000     | GBP    | 652.765                      | 0,60             |
| UNITED KINGDOM 4.50 07-42 07/12S          | 441.700     | GBP    | 836.444                      | 0,76             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds International

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                            | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|-----------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| UNITED KINGDOM 4.75 07-30 07/12S        | 175.000   | GBP    | 278.771                      | 0,25             |
| <b>España</b>                           |           |        | <b>3.596.663</b>             | <b>3,28</b>      |
| ADIF ALTA VELOC 0.5500 20-30 30/04A     | 600.000   | EUR    | 606.861                      | 0,55             |
| BANCO BILBAO VIZCAYA 0.75 20-25 04/06A  | 300.000   | EUR    | 309.203                      | 0,28             |
| BANCO SANTANDER SA 1.125 20-27 23/06A   | 500.000   | EUR    | 521.638                      | 0,48             |
| CAIXABANK SA 0.50 21-29 09/02A          | 300.000   | EUR    | 295.788                      | 0,27             |
| GRIFOLS SA 2.25 19-27 15/11S            | 600.000   | EUR    | 611.805                      | 0,56             |
| SANTANDER CONS FIN 0.50 19-26 14/11A    | 500.000   | EUR    | 507.755                      | 0,46             |
| SPAIN 1.25 20-30 31/10A                 | 225.000   | EUR    | 243.756                      | 0,22             |
| SPAIN 1.30 16-26 31/10A                 | 304.000   | EUR    | 328.367                      | 0,30             |
| SPAIN 1.85 19-35 05/03A                 | 150.000   | EUR    | 171.490                      | 0,16             |
| <b>Bélgica</b>                          |           |        | <b>2.858.651</b>             | <b>2,61</b>      |
| BELGIUM 0.00 20-27 22/10U               | 400.000   | EUR    | 408.270                      | 0,37             |
| BELGIUM 1.7 19-50 05/02A                | 150.000   | EUR    | 181.364                      | 0,17             |
| BELGIUM 1.90 15-38 22/06A               | 473.600   | EUR    | 582.495                      | 0,53             |
| COMMUNAUTE EUROPEENNE 0,3 20-50 04/11A  | 175.000   | EUR    | 159.393                      | 0,15             |
| EUROPEAN UNION 0.00 21-31 04/07A        | 280.000   | EUR    | 279.565                      | 0,25             |
| EUROPEAN UNION 0.1000 20-40 04/10A      | 200.000   | EUR    | 185.464                      | 0,17             |
| EUROPEAN UNION 2.875 12-28 04/04A       | 460.000   | EUR    | 557.368                      | 0,51             |
| UCB SA 1.0000 21-28 30/03A              | 500.000   | EUR    | 504.732                      | 0,46             |
| <b>Alemania</b>                         |           |        | <b>2.539.707</b>             | <b>2,32</b>      |
| ADIDAS AG 0.00 20-28 05/10U             | 400.000   | EUR    | 397.396                      | 0,36             |
| ALLEMAGNE 0.5 18-28 15/02A              | 300.000   | EUR    | 319.860                      | 0,29             |
| DEUTSCHE BOERSE AG 0.0 21-26 22/02A     | 400.000   | EUR    | 401.944                      | 0,37             |
| GERMANY 0.50 14-30 15/04A               | 600.000   | EUR    | 779.519                      | 0,71             |
| VOLKSWAGEN LEASING 0.25 21-26 12/01A    | 439.000   | EUR    | 440.642                      | 0,40             |
| VONOVIA SE 0.3750 21-27 16/06A          | 200.000   | EUR    | 200.346                      | 0,19             |
| <b>Australia</b>                        |           |        | <b>1.886.328</b>             | <b>1,72</b>      |
| AUSTRALIA 1.00 20-30 21/12S             | 110.000   | AUD    | 66.865                       | 0,06             |
| AUSTRALIA 2.75 16-27 21/11S             | 200.000   | AUD    | 140.159                      | 0,13             |
| AUSTRALIA 2.75 18-41 10/07S             | 120.000   | AUD    | 83.601                       | 0,08             |
| AUSTRALIA 3.25 15-39 21/06S             | 500.000   | AUD    | 374.505                      | 0,34             |
| MACQUARIE GROUP LTD 0.95 21-31 21/05A   | 1.000.000 | EUR    | 997.515                      | 0,91             |
| NSW TREASURY 3.00 16-30 20/02S          | 317.600   | AUD    | 223.683                      | 0,20             |
| <b>Canadá</b>                           |           |        | <b>1.694.937</b>             | <b>1,55</b>      |
| CANADA 1.50 15-26 01/06S                | 200.000   | CAD    | 139.570                      | 0,13             |
| ONTARIO 2.3 19-24 08/09S                | 480.000   | CAD    | 341.383                      | 0,31             |
| ONTARIO 2.8 16-48 02/06S                | 413.000   | CAD    | 291.751                      | 0,27             |
| QUEBEC 5.0000 09-41 01/12S              | 720.000   | CAD    | 690.381                      | 0,63             |
| QUEBEC 5.00 06-38 01/12S                | 248.000   | CAD    | 231.852                      | 0,21             |
| <b>Bahamas</b>                          |           |        | <b>1.293.527</b>             | <b>1,18</b>      |
| BAHAMAS REGS 6.00 17-28 21/11S          | 880.000   | USD    | 758.278                      | 0,69             |
| COMMONWEALTH OF BAHAM 6.95 09-29 20/11S | 600.000   | USD    | 535.249                      | 0,49             |
| <b>Rumanía</b>                          |           |        | <b>973.151</b>               | <b>0,89</b>      |
| ROMANIA 2.00 20-32 28/01A               | 380.000   | EUR    | 385.132                      | 0,35             |
| ROMANIA 2.124 19-31 16/07A              | 280.000   | EUR    | 289.660                      | 0,27             |
| ROMANIAN GOVT INTL BD 2.0 21-33 14/04A  | 300.000   | EUR    | 298.359                      | 0,27             |
| <b>México</b>                           |           |        | <b>860.706</b>               | <b>0,79</b>      |
| MEXICO 1.35 20-27 18/09A                | 140.000   | EUR    | 145.342                      | 0,13             |
| MEXICO 1.45 21-33 25/10S                | 250.000   | EUR    | 239.295                      | 0,22             |
| MEXICO 4.125 16-26 21/01S               | 500.000   | USD    | 476.069                      | 0,44             |
| <b>Luxemburgo</b>                       |           |        | <b>731.279</b>               | <b>0,67</b>      |
| NESTLE FINANCE 0.00001 20-25 3/12A      | 242.000   | EUR    | 243.469                      | 0,22             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds International

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                            | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|-----------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| PROLOGIS INTL FUND II 0.75 21-33 23/03A | 497.000   | EUR    | 487.810                      | 0,45             |
| <b>Austria</b>                          |           |        | <b>467.604</b>               | <b>0,43</b>      |
| AUSTRIA 1.50 16-47 20/02A               | 186.000   | EUR    | 228.320                      | 0,21             |
| AUSTRIA 2.40 13-34 23/05A               | 186.000   | EUR    | 239.284                      | 0,22             |
| <b>Portugal</b>                         |           |        | <b>445.775</b>               | <b>0,41</b>      |
| ENERGIAS DE PORTUGAL 1.70 20-80 20/07A  | 100.000   | EUR    | 100.700                      | 0,09             |
| PORTUGAL 0.475 20-30 18/10A             | 110.000   | EUR    | 112.183                      | 0,10             |
| PORTUGAL 2.875 16-26 21/07A             | 0         | EUR    | 0                            | 0,00             |
| PORTUGAL 4.125 17-27 14/04A             | 185.858   | EUR    | 232.892                      | 0,22             |
| <b>Emiratos Arabes Unidos</b>           |           |        | <b>424.533</b>               | <b>0,39</b>      |
| EMIRATES TELECO 0.3750 21-28 17/05A     | 150.000   | EUR    | 151.036                      | 0,14             |
| EMIRATES TELECOM CORP 3.50 14-24 18/06S | 300.000   | USD    | 273.497                      | 0,25             |
| <b>Nueva Zelanda</b>                    |           |        | <b>385.758</b>               | <b>0,35</b>      |
| NEW ZEALAND 2.75 16-25 15/04S           | 620.000   | NZD    | 385.758                      | 0,35             |
| <b>Dinamarca</b>                        |           |        | <b>350.520</b>               | <b>0,32</b>      |
| DENMARK 0.5 19-29 15/11A                | 2.480.000 | DKK    | 350.520                      | 0,32             |
| <b>Serbia</b>                           |           |        | <b>334.233</b>               | <b>0,30</b>      |
| SERBIA 3.1250 20-27 15/05A              | 300.000   | EUR    | 334.233                      | 0,30             |
| <b>Eslovenia</b>                        |           |        | <b>308.815</b>               | <b>0,28</b>      |
| SLOVENIA 0.1250 21-31 01/07A            | 309.000   | EUR    | 308.815                      | 0,28             |
| <b>Suiza</b>                            |           |        | <b>251.053</b>               | <b>0,23</b>      |
| SWISS 2.50 06-36 08/03A                 | 200.000   | CHF    | 251.053                      | 0,23             |
| <b>Irlanda</b>                          |           |        | <b>224.999</b>               | <b>0,20</b>      |
| IRELAND 1.35 18-31 18/03A               | 200.000   | EUR    | 224.999                      | 0,20             |
| <b>Estonia</b>                          |           |        | <b>185.467</b>               | <b>0,17</b>      |
| ESTONIA 0.125 20-30 10/06A              | 185.000   | EUR    | 185.467                      | 0,17             |
| <b>Obligaciones convertibles</b>        |           |        | <b>2.880.774</b>             | <b>2,63</b>      |
| <b>Francia</b>                          |           |        | <b>2.147.838</b>             | <b>1,96</b>      |
| EDENRED SA CV 0.00 19-24 06/09U         | 14.400    | EUR    | 905.731                      | 0,83             |
| VEOLIA ENV CV 0.00 19-25 01/01U         | 19.400    | EUR    | 625.640                      | 0,57             |
| WORLDLINE SA DIRTY CV 0.00 19-26 30/07U | 5.400     | EUR    | 616.467                      | 0,56             |
| <b>Alemania</b>                         |           |        | <b>732.936</b>               | <b>0,67</b>      |
| DEUTSCHE POST AG CV 0.05 17-25 30/06A   | 600.000   | EUR    | 732.936                      | 0,67             |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>    |           |        | <b>9.837.135</b>             | <b>8,98</b>      |
| <b>Francia</b>                          |           |        | <b>3.152.320</b>             | <b>2,88</b>      |
| AXA SA FL.R 21-41 07/10A                | 571.000   | EUR    | 571.191                      | 0,52             |
| CREDIT AGRICOLE SA FL.R 20-30 05/06A    | 700.000   | EUR    | 727.779                      | 0,66             |
| CREDIT MUTUEL ARKEA FL.R 20-29 11/06A   | 500.000   | EUR    | 521.745                      | 0,48             |
| ORANGE SA FL.R 20-49 31/12A             | 500.000   | EUR    | 511.660                      | 0,47             |
| SOCIETE GENERALE FL.R 20-28 22/09A      | 100.000   | EUR    | 101.657                      | 0,09             |
| TOTAL SE FL.R 19-XX 04/04A              | 700.000   | EUR    | 718.288                      | 0,66             |
| <b>Alemania</b>                         |           |        | <b>1.962.781</b>             | <b>1,79</b>      |
| ALLIANZ SE FL.R 20-XX XX/XXA            | 600.000   | USD    | 524.060                      | 0,48             |
| GERMANY 0.10 15-26 15/04A               | 700.000   | EUR    | 822.203                      | 0,75             |
| MERCK KGAA FL.R 19-79 25/06A            | 400.000   | EUR    | 413.242                      | 0,38             |
| MUNICH RE FLR 20-41 26/05A              | 200.000   | EUR    | 203.276                      | 0,18             |
| <b>Bélgica</b>                          |           |        | <b>1.519.828</b>             | <b>1,39</b>      |
| BELFIUS BANK SA FL.R 18-XX XX/XXS       | 600.000   | EUR    | 594.762                      | 0,54             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds International

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                           | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| KBC GROUPE SA FL.R 20-26 10/09A                        | 500.000   | EUR    | 499.672                      | 0,46             |
| KBC GROUP NV FL.R 18-XX XX/XXS                         | 400.000   | EUR    | 425.394                      | 0,39             |
| <b>Países Bajos</b>                                    |           |        | <b>937.469</b>               | <b>0,86</b>      |
| IBERDROLA INTL BV FL.R 17-XX 22/02A                    | 500.000   | EUR    | 513.957                      | 0,47             |
| ING GROEP NV FL.R 20-26 01/07S                         | 500.000   | USD    | 423.512                      | 0,39             |
| <b>Suecia</b>                                          |           |        | <b>667.554</b>               | <b>0,61</b>      |
| SWEDBANK AB FL.R 21-27 20/05A                          | 667.000   | EUR    | 667.554                      | 0,61             |
| <b>Estados Unidos de América</b>                       |           |        | <b>585.077</b>               | <b>0,53</b>      |
| BANK OF AMERICA CORP FL.R 21-31 22/03A                 | 586.000   | EUR    | 585.077                      | 0,53             |
| <b>Italia</b>                                          |           |        | <b>392.502</b>               | <b>0,36</b>      |
| UNICREDIT SPA FL.R 19-25 25/06A                        | 381.000   | EUR    | 392.502                      | 0,36             |
| <b>Reino Unido</b>                                     |           |        | <b>311.041</b>               | <b>0,28</b>      |
| VODAFONE GROUP PLC FL.R 20-80 27/08A                   | 300.000   | EUR    | 311.041                      | 0,28             |
| <b>España</b>                                          |           |        | <b>308.563</b>               | <b>0,28</b>      |
| BANCO DE SABADE FL.R 20-27 11/03A                      | 300.000   | EUR    | 308.563                      | 0,28             |
| <b>Otros valores mobiliarios</b>                       |           |        | <b>271.366</b>               | <b>0,25</b>      |
| <b>Obligaciones</b>                                    |           |        | <b>271.366</b>               | <b>0,25</b>      |
| <b>España</b>                                          |           |        | <b>271.366</b>               | <b>0,25</b>      |
| BONOS Y OBLIG DEL 1.00 20-50 31/10A                    | 300.000   | EUR    | 271.366                      | 0,25             |
| <b>Organismos de Inversión Colectiva</b>               |           |        | <b>10.362.399</b>            | <b>9,45</b>      |
| <b>Acciones/Participaciones en fondos de inversión</b> |           |        | <b>10.362.399</b>            | <b>9,45</b>      |
| <b>Irlanda</b>                                         |           |        | <b>6.999.241</b>             | <b>6,38</b>      |
| ISHARES CHINA CNY BOND UCITS ETF USD                   | 1.500.000 | USD    | 6.999.241                    | 6,38             |
| <b>Luxemburgo</b>                                      |           |        | <b>3.363.158</b>             | <b>3,07</b>      |
| CANDRIAM BONDS EMGERGING DEBT LOCAL CUR Z EUR C        | 600       | EUR    | 1.008.774                    | 0,92             |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND GLOBAL R EUR C AH            | 10.125    | EUR    | 995.794                      | 0,91             |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND GLOBAL V GBP D AH            | 836       | GBP    | 958.588                      | 0,87             |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND GLOBAL V USD C AH            | 477       | USD    | 400.002                      | 0,37             |
| <b>Total de la cartera de valores</b>                  |           |        | <b>107.749.531</b>           | <b>98,32</b>     |
| Coste de adquisición                                   |           |        | 107.423.887                  |                  |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds International

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

### Distribución geográfica (en % activo neto)

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| Estados Unidos de América | 25,81        |
| Francia                   | 12,60        |
| Japón                     | 10,60        |
| Irlanda                   | 6,59         |
| Países Bajos              | 6,17         |
| Italia                    | 5,35         |
| Reino Unido               | 5,27         |
| Alemania                  | 4,78         |
| Bélgica                   | 3,99         |
| España                    | 3,81         |
| Luxemburgo                | 3,74         |
| Australia                 | 1,72         |
| Canadá                    | 1,55         |
| Bahamas                   | 1,18         |
| Rumanía                   | 0,89         |
| México                    | 0,78         |
| Suecia                    | 0,61         |
| Austria                   | 0,43         |
| Portugal                  | 0,41         |
| Emiratos Arabes Unidos    | 0,39         |
| Nueva Zelanda             | 0,35         |
| Dinamarca                 | 0,32         |
| Serbia                    | 0,30         |
| Eslovenia                 | 0,28         |
| Suiza                     | 0,23         |
| Estonia                   | 0,17         |
|                           | <b>98,32</b> |

### Distribución económica (en % activo neto)

|                                                                |              |
|----------------------------------------------------------------|--------------|
| Obligaciones del Estado, de las provincias y de los municipios | 36,48        |
| Bancos y otras entidades financieras                           | 12,68        |
| Fondos de inversión                                            | 9,46         |
| Holdings y entidades financieras                               | 9,03         |
| Telecomunicaciones                                             | 3,79         |
| Industrias agro-alimentarias                                   | 2,73         |
| Seguros                                                        | 2,45         |
| Farmacia y cosméticos                                          | 1,83         |
| Biotechnología                                                 | 1,77         |
| Transporte                                                     | 1,51         |
| Energía y servicio de aguas                                    | 1,35         |
| Servicios sociales y de sanidad pública                        | 1,31         |
| Bienes de consumo diversos                                     | 1,19         |
| Organizaciones supranacionales                                 | 1,18         |
| Artículos de oficina y ordenadores                             | 1,09         |
| Sociedades inmobiliarias                                       | 1,07         |
| Electrónica y semiconductores                                  | 1,06         |
| Petróleo                                                       | 1,03         |
| Varios                                                         | 0,93         |
| Construcción, material de construcción                         | 0,90         |
| Servicios varios                                               | 0,87         |
| Electrotecnia y electrónica                                    | 0,85         |
| Artes gráficas y editoriales                                   | 0,68         |
| Industria del embalaje                                         | 0,55         |
| Internet y servicios de Internet                               | 0,48         |
| Industria automovilística                                      | 0,45         |
| Comercio minorista y grandes almacenes                         | 0,44         |
| Restaurantes, hoteles                                          | 0,43         |
| Instituciones inclasificables / no clasificadas                | 0,37         |
| Textiles y vestido                                             | 0,36         |
|                                                                | <b>98,32</b> |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Total Return

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                                                                                                    | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Valores mobiliarios admitidos a cotización oficial en una<br/>bolsa de valores o negociados en otro mercado reglamentado</b> |           |        | <b>749.459.046</b>           | <b>76,85</b>     |
| <b>Obligaciones</b>                                                                                                             |           |        | <b>550.755.123</b>           | <b>56,47</b>     |
| <b>Estados Unidos de América</b>                                                                                                |           |        | <b>217.583.256</b>           | <b>22,31</b>     |
| ABBVIE INC 0.75 19-27 18/11A                                                                                                    | 1.986.000 | EUR    | 2.043.088                    | 0,21             |
| ALLIED UNI HLD LLC 3.625 21-28 01/06S                                                                                           | 2.575.000 | EUR    | 2.559.254                    | 0,26             |
| ANTERO RESOURCE 7.6250 21-29 01/02S                                                                                             | 3.500.000 | USD    | 3.279.830                    | 0,34             |
| ARAMARK SERVICES INC 6.375 20-25 01/05S                                                                                         | 2.000.000 | USD    | 1.793.996                    | 0,18             |
| AT&T INC 1.30 15-23 05/09A                                                                                                      | 300.000   | EUR    | 308.567                      | 0,03             |
| AT&T INC 2.35 18-29 05/09A                                                                                                      | 6.000.000 | EUR    | 6.802.500                    | 0,70             |
| AVANTOR FUNDING INC 2.62520-25 01/11S                                                                                           | 200.000   | EUR    | 205.026                      | 0,02             |
| AXALTA COAT/DUTCH HLD 4.75 20-27 15/06S                                                                                         | 1.500.000 | USD    | 1.328.953                    | 0,14             |
| BALL 4.00 13-23 15/11S                                                                                                          | 2.000.000 | USD    | 1.796.416                    | 0,18             |
| BOSTON SCIENTIF 0.6250 19-27 01/12A                                                                                             | 3.000.000 | EUR    | 3.046.785                    | 0,31             |
| BUILDERS FIRSTS 5.0000 20-30 01/03S                                                                                             | 1.456.000 | USD    | 1.292.659                    | 0,13             |
| BUILDERS FIRSTS 6.7500 19-27 01/06S                                                                                             | 980.000   | USD    | 887.553                      | 0,09             |
| BUONI POLIENNAL 1.5000 21-45 30/04S                                                                                             | 3.464.000 | EUR    | 3.369.779                    | 0,35             |
| CATALENT PHARMA 5.0000 19-27 15/07S                                                                                             | 2.320.000 | USD    | 2.047.240                    | 0,21             |
| CCO HOLDINGS LLC 4.25 20-31 01/02S                                                                                              | 2.000.000 | USD    | 1.720.212                    | 0,18             |
| CFX ESCROW CORP 6.375 19-26 15/02S                                                                                              | 1.854.000 | USD    | 1.654.045                    | 0,17             |
| CHARLES RIVER L 3.7500 21-29 15/03S                                                                                             | 1.091.000 | USD    | 933.932                      | 0,10             |
| CHENIERE ENERGY 4.6250 20-28 15/10S                                                                                             | 2.347.000 | USD    | 2.090.411                    | 0,21             |
| CHENIERE ENERGY PART 4.50 20-29 01/10S                                                                                          | 2.000.000 | USD    | 1.815.077                    | 0,19             |
| CHENIERE ENERGY PART 5.625 19-26 01/10S                                                                                         | 2.000.000 | USD    | 1.753.942                    | 0,18             |
| CITIGROUP INC 1.25 19-29 10/04A                                                                                                 | 2.000.000 | EUR    | 2.109.770                    | 0,22             |
| CITIGROUP INC 1.75 15-25 28/01A                                                                                                 | 2.800.000 | EUR    | 2.975.126                    | 0,30             |
| CLEARWAY ENERGY 4.7500 19-28 15/03S                                                                                             | 2.307.000 | USD    | 2.043.034                    | 0,21             |
| COGENT COMM GROUP INC 3.5 21-26 01/05S                                                                                          | 1.796.000 | USD    | 1.550.430                    | 0,16             |
| CSC HOLDINGS LLC 4.5 21-31 15/11S                                                                                               | 4.401.000 | USD    | 3.738.531                    | 0,38             |
| DAVITA INC 4.6250 20-30 01/06S                                                                                                  | 1.169.000 | USD    | 1.013.064                    | 0,10             |
| DIGITAL EURO FINCO 2.5 19-26 16/01A                                                                                             | 1.595.000 | EUR    | 1.753.679                    | 0,18             |
| EQM MIDSTREAM 4.75 21-31 15/01S                                                                                                 | 1.905.000 | USD    | 1.657.281                    | 0,17             |
| EQT CORP 3.1250 21-26 15/05S                                                                                                    | 1.577.000 | USD    | 1.361.181                    | 0,14             |
| FORD MOTOR CREDIT 4.375 13-23 06/08S                                                                                            | 1.292.000 | USD    | 1.151.840                    | 0,12             |
| FORD MOTOR CREDIT CO 2.33 19-25 25/11A                                                                                          | 2.000.000 | EUR    | 2.071.142                    | 0,21             |
| FORD MOTOR CREDIT CO 3.087 20-23 09/01S                                                                                         | 2.000.000 | USD    | 1.722.321                    | 0,18             |
| GENERAL ELECTRIC CO 0.875 17-25 17/05A                                                                                          | 2.000.000 | EUR    | 2.056.020                    | 0,21             |
| GOLDMAN SACHS GROUP 1.25 16-25 01/05A                                                                                           | 3.067.000 | EUR    | 3.172.075                    | 0,33             |
| GOLDMAN SACHS GROUP 1.375 17-24 15/05A                                                                                          | 400.000   | EUR    | 410.630                      | 0,04             |
| GOODYEAR T & RUBBER 5.25 21-31 30/04S                                                                                           | 1.509.000 | USD    | 1.329.712                    | 0,14             |
| GOODYEAR T & RUBBER 5.625 21-33 30/04S                                                                                          | 2.000.000 | USD    | 1.781.027                    | 0,18             |
| HILTON GRAND VACATION 4.875 21-31 01/07S                                                                                        | 1.090.000 | USD    | 918.825                      | 0,09             |
| IQVIA INC 1.7500 21-26 15/03S                                                                                                   | 100.000   | EUR    | 101.140                      | 0,01             |
| L BRANDS 6.875 16-35 01/11S                                                                                                     | 2.500.000 | USD    | 2.674.656                    | 0,27             |
| LEVEL 3 FINANCI 3.6250 20-29 15/01S                                                                                             | 3.000.000 | USD    | 2.444.776                    | 0,25             |
| LEVEL 3 FINANCING 5.375 16-25 01/05S                                                                                            | 1.500.000 | USD    | 1.293.322                    | 0,13             |
| LEVEL 3 FINANCING INC 3.75 21-29 15/07S                                                                                         | 1.000.000 | USD    | 821.106                      | 0,08             |
| LEVEL 3 FINANCING INC 4.25 20-28 01/07S                                                                                         | 896.000   | USD    | 767.701                      | 0,08             |
| LITHIA MOTORS 3.875 21-29 01/06S                                                                                                | 1.296.000 | USD    | 1.134.150                    | 0,12             |
| MACYS INC. 8.375 20-25 15/06S                                                                                                   | 1.000.000 | USD    | 930.690                      | 0,10             |
| MATTEL INC 3.75 21-29 01/04S                                                                                                    | 2.874.000 | USD    | 2.523.844                    | 0,26             |
| MORGAN STANLEY 1.75 15-25 30/01A                                                                                                | 3.300.000 | EUR    | 3.510.441                    | 0,36             |
| NCR CORP 5.1250 21-29 15/04S                                                                                                    | 3.105.000 | USD    | 2.703.358                    | 0,28             |
| NETFLIX INC 3.0000 20-25 15/06S                                                                                                 | 200.000   | EUR    | 218.067                      | 0,02             |
| NETFLIX INC 3.8750 19-29 15/11S                                                                                                 | 2.000.000 | EUR    | 2.412.500                    | 0,25             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Total Return

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| NEXSTAR BROADCA 4.7500 20-28 01/11S         | 1.750.000  | USD    | 1.518.098                    | 0,16             |
| NIELSEN FINANCE LLC 4.5 21-29 15/07S        | 4.609.000  | USD    | 3.905.932                    | 0,40             |
| NIELSEN FINANCE LLC 4.75 21-31 15/07S       | 2.011.000  | USD    | 1.702.118                    | 0,17             |
| NOVELIS 144A 5.875 16-26 30/09S             | 1.500.000  | USD    | 1.317.360                    | 0,14             |
| OCCIDENTAL PETROL 6.20 19-40 15/03S         | 1.000.000  | USD    | 955.274                      | 0,10             |
| OCCIDENTAL PETROLEUM 7.5 19-31 01/05S       | 1.000.000  | USD    | 1.063.572                    | 0,11             |
| POST HOLDINGS 144A 5.75 17-27 01/03S        | 3.000.000  | USD    | 2.649.886                    | 0,27             |
| POST HOLDINGS INC 4.625 20-30 15/04S        | 2.000.000  | USD    | 1.713.888                    | 0,18             |
| PRIME SECURITY SERVICE 3.375 20-27 31/08S   | 4.000.000  | USD    | 3.275.993                    | 0,34             |
| PTC INC 3.625 20-25 15/02S                  | 1.000.000  | USD    | 871.288                      | 0,09             |
| QUINTILES IMS REGS 2.875 17-25 15/09S       | 2.050.000  | EUR    | 2.079.366                    | 0,21             |
| SBA COMMUNICATIONS 3.875 20-27 15/02S       | 3.207.000  | USD    | 2.783.713                    | 0,29             |
| SIRIUS SATELLITE 4.00 21-28 15/07S          | 2.500.000  | USD    | 2.177.292                    | 0,22             |
| SIRIUS XM HOLDINGS 4.625 19-24 15/07S       | 2.000.000  | USD    | 1.734.876                    | 0,18             |
| SIRIUS XM RADIO INC 3.875 17-22 01/08S      | 2.000.000  | USD    | 1.691.627                    | 0,17             |
| SPRINT CORP 7.25 14-21 15/09S               | 3.000.000  | USD    | 2.561.358                    | 0,26             |
| SPRINT CORP 7.875 14-23 15/09S              | 4.000.000  | USD    | 3.836.162                    | 0,39             |
| STANDARD INDUST 2.2500 19-26 21/11A         | 1.880.000  | EUR    | 1.874.885                    | 0,19             |
| SYNEOS HEALTH INC 3.625 20-29 15/01S        | 1.500.000  | USD    | 1.253.795                    | 0,13             |
| TARGA RESOURCES PARTN 5.00 18-28 15/01S     | 2.000.000  | USD    | 1.781.348                    | 0,18             |
| TEGNA INC 5.00 20-29 15/09S                 | 2.500.000  | USD    | 2.211.801                    | 0,23             |
| UNITED STATES 0.5 21-26 28/02S              | 26.000.000 | USD    | 21.586.849                   | 2,21             |
| UNITED STATES TREASUR 0.125 21-23 31/03S    | 50.000.000 | USD    | 42.099.487                   | 4,32             |
| US TREASURY N/B 2.250 21-41 15/05S          | 11.500.000 | USD    | 10.060.167                   | 1,03             |
| VERIZON COMMUNICATION 1.625 14-24 01/03A    | 400.000    | EUR    | 418.586                      | 0,04             |
| WELLS FARGO 1.00 16-27 02/02A               | 2.500.000  | EUR    | 2.583.312                    | 0,26             |
| WMG ACQ. 3.625 18-26 09/10S                 | 955.000    | EUR    | 979.995                      | 0,10             |
| YUM! BRANDS INC 4.7500 19-30 15/01S         | 1.446.000  | USD    | 1.321.647                    | 0,14             |
| YUM! BRANDS INC 7.7500 20-25 01/04S         | 536.000    | USD    | 492.877                      | 0,05             |
| <b>Francia</b>                              |            |        | <b>50.472.573</b>            | <b>5,18</b>      |
| ALTICE FRANCE SA 7.375 16-26 01/05S         | 2.717.000  | USD    | 2.385.434                    | 0,25             |
| BFCM 0.125 19-24 05/02Y                     | 400.000    | EUR    | 403.500                      | 0,04             |
| BFCM 1.875 19-29 18/06A                     | 1.500.000  | EUR    | 1.616.175                    | 0,17             |
| BNP PARIBAS 1.625 19-31 02/07A              | 2.000.000  | EUR    | 2.090.890                    | 0,22             |
| BNP PARIBAS 2.875 16-26 01/10A              | 1.500.000  | EUR    | 1.682.550                    | 0,17             |
| BNP PARIBAS SA 1.50 17-25 17/11A            | 3.900.000  | EUR    | 4.131.933                    | 0,42             |
| BPCE 0.625 19-24 26/09A                     | 400.000    | EUR    | 407.968                      | 0,04             |
| BPCE SA 1.625 18-28 31/01A                  | 3.000.000  | EUR    | 3.227.070                    | 0,33             |
| CAPGEMINI SE 0.6250 20-25 23/06A            | 400.000    | EUR    | 410.134                      | 0,04             |
| CARREFOUR BANQUE 0.107 21-25 14/06A         | 700.000    | EUR    | 701.498                      | 0,07             |
| CREDIT AGRICOLE ASSURANCE 2.00 20-30 17/07A | 3.000.000  | EUR    | 3.148.245                    | 0,32             |
| CROWN EURO HOLDINGS 3.375 15-25 15/05S      | 2.000.000  | EUR    | 2.148.436                    | 0,22             |
| DASSAULT SYSTEM 0.00 19-24 16/09A           | 400.000    | EUR    | 402.428                      | 0,04             |
| ELIS SA 1.625 19-28 03/04A                  | 3.000.000  | EUR    | 2.979.180                    | 0,31             |
| ELIS SA 1.75 19-24 11/04A                   | 200.000    | EUR    | 204.990                      | 0,02             |
| FRANCE 0.50 21-44 25/06A                    | 8.059.000  | EUR    | 7.701.583                    | 0,79             |
| GROUPAMA SA SUB 6.00 17-27 23/01A           | 3.000.000  | EUR    | 3.779.475                    | 0,39             |
| ICADE SA 1.75 16-26 10/06A                  | 2.700.000  | EUR    | 2.916.689                    | 0,30             |
| ICADE SANTE SAS 1.375 20-30 17/09A          | 500.000    | EUR    | 525.662                      | 0,05             |
| LA BANQUE POSTALE 0.75 21-31 23/06A         | 2.700.000  | EUR    | 2.689.605                    | 0,28             |
| LA BANQUE POSTALE 1.375 19-29 24/04A        | 2.000.000  | EUR    | 2.135.410                    | 0,22             |
| SOCIETE GENERALE 1.25 19-24 15/02A          | 2.000.000  | EUR    | 2.069.140                    | 0,21             |
| SOCIETE GENERALE 4.00 13-23 07/06A          | 400.000    | EUR    | 430.520                      | 0,04             |
| SPIE SA 2.625 19-26 18/06A                  | 2.200.000  | EUR    | 2.284.058                    | 0,24             |
| <b>Alemania</b>                             |            |        | <b>36.314.299</b>            | <b>3,72</b>      |
| DAIMLER AG 0.75 20-30 10/09A                | 2.010.000  | EUR    | 2.071.416                    | 0,21             |
| GERMANY 0.50 14-30 15/04A                   | 21.000.000 | EUR    | 27.283.168                   | 2,80             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Total Return

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                              | Cantidad    | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|-------------------------------------------|-------------|--------|------------------------------|------------------|
| SCHAEFFLER AG 3.375 20-28 12/10A          | 1.500.000   | EUR    | 1.656.984                    | 0,17             |
| VOLKSWAGEN BANK 1.2500 18-24 10/06A       | 400.000     | EUR    | 414.954                      | 0,04             |
| VOLKSWAGEN LEASING 0.00 21-24 19/07A      | 2.146.000   | EUR    | 2.144.777                    | 0,22             |
| ZF EUROPE FINANCE 3.75 20-28 21/09A       | 2.500.000   | EUR    | 2.743.000                    | 0,28             |
| <b>Países Bajos</b>                       |             |        | <b>35.663.361</b>            | <b>3,66</b>      |
| ABN AMRO BANK 1.25 20-25 28/05A           | 2.000.000   | EUR    | 2.090.490                    | 0,21             |
| AXALTA COATING 3.75 16-25 15/01S          | 1.150.000   | EUR    | 1.171.735                    | 0,12             |
| COOPERATIEVE RA 0.6250 21-33 25/02A       | 2.000.000   | EUR    | 1.995.540                    | 0,21             |
| DEUT TELEKOM INT FIN 0.875 17-24 30/01A   | 100.000     | EUR    | 102.799                      | 0,01             |
| EDP FINANCE BV 1.625 18-26 26/01A         | 300.000     | EUR    | 321.116                      | 0,03             |
| ENEL FIN INTL 0.00 19-24 17/06A           | 454.000     | EUR    | 457.049                      | 0,05             |
| ENERGIZER GAMMA 4.6250 18-26 15/07S       | 2.700.000   | EUR    | 2.767.235                    | 0,28             |
| HEINEKEN NV 2.25 20-30 30/03A             | 1.500.000   | EUR    | 1.738.200                    | 0,18             |
| ING GROUP NV 1.125 18-25 14/02A           | 2.300.000   | EUR    | 2.393.587                    | 0,25             |
| OI EUROPEAN GROUP 3.125 16-24 15/11S      | 2.000.000   | EUR    | 2.072.528                    | 0,21             |
| REPSOL INTL FIN 0.125 20-24 05/10A        | 400.000     | EUR    | 402.716                      | 0,04             |
| REPSOL INTL FINANCE 2.5000 21-XX XX/XXA   | 2.500.000   | EUR    | 2.518.737                    | 0,26             |
| UPC BROADBAND FINCO B 4.875 21-31 15/07S  | 2.442.000   | USD    | 2.066.506                    | 0,21             |
| VOLKSWAGEN INTL 0.8750 20-28 22/09A       | 6.000.000   | EUR    | 6.214.530                    | 0,64             |
| VONOVIA FINANCE 0.5000 19-29 14/09A       | 3.500.000   | EUR    | 3.491.110                    | 0,36             |
| VONOVIA FINANCE BV 0.125 19-23 06/04A     | 300.000     | EUR    | 301.564                      | 0,03             |
| WINTERSHALL DEA FINA 3.5 21-99 31/12A     | 1.000.000   | EUR    | 986.500                      | 0,10             |
| ZIGGO BV 4.8750 19-30 15/01S              | 2.000.000   | USD    | 1.730.871                    | 0,18             |
| ZIGGO SEC FIN 144A 5.50 16-27 15/01S      | 3.235.000   | USD    | 2.840.548                    | 0,29             |
| <b>Italia</b>                             |             |        | <b>30.684.561</b>            | <b>3,15</b>      |
| ASSICURAZ GENERALI 2.124 19-30 01/10A     | 2.544.000   | EUR    | 2.699.655                    | 0,28             |
| ASSICURAZIONI GENERALI 2.429 20-31 14/07A | 1.370.000   | EUR    | 1.478.360                    | 0,15             |
| BUONI POLIENNAL 0.5000 20-26 01/02S       | 900.000     | EUR    | 918.342                      | 0,09             |
| ENI 0.375 21-28 14/06A                    | 812.000     | EUR    | 814.631                      | 0,08             |
| INTESA SANPAOLO 0.75 19-24 04/12A         | 4.048.000   | EUR    | 4.152.864                    | 0,43             |
| INTESA SANPAOLO 1.0000 19-24 04/07A       | 396.000     | EUR    | 407.902                      | 0,04             |
| INTESA SANPAOLO SPA 1.75 18-28 20/03A     | 3.000.000   | EUR    | 3.207.510                    | 0,33             |
| ITALY 1.35 19-30 01/04S                   | 11.000.000  | EUR    | 11.654.885                   | 1,20             |
| NEXI SPA 2.1250 21-29 30/04S              | 1.011.000   | EUR    | 1.002.581                    | 0,10             |
| TELECOM ITALIA 2.50 17-23 19/07A          | 1.000.000   | EUR    | 1.043.167                    | 0,11             |
| TELECOM ITALIA EMTN 3.75 15-23 16/01A     | 1.000.000   | EUR    | 1.048.241                    | 0,11             |
| TRASMISSIONE ELETTRI 0.375 21-29 23/06A   | 1.682.000   | EUR    | 1.682.294                    | 0,17             |
| UNICREDIT SPA 1.00 18-23 18/01A           | 350.000     | EUR    | 356.027                      | 0,04             |
| UNICREDIT SPA REGS 6.95 12-22 31/10A      | 200.000     | EUR    | 218.102                      | 0,02             |
| <b>Noruega</b>                            |             |        | <b>27.141.817</b>            | <b>2,78</b>      |
| NORWAY 1.375 20-30 19/08A                 | 85.000.000  | NOK    | 8.366.897                    | 0,86             |
| NORWAY 1.75 19-29 06/03A                  | 185.000.000 | NOK    | 18.774.920                   | 1,92             |
| <b>España</b>                             |             |        | <b>23.448.688</b>            | <b>2,40</b>      |
| BANCO BILBAO VIZCAYA 1.00 19-26 21/06A    | 3.000.000   | EUR    | 3.123.405                    | 0,32             |
| BANCO BILBAO VIZCAYA 1.125 19-24 28/02A   | 400.000     | EUR    | 412.892                      | 0,04             |
| BANCO DE SABADELL SA 1.75 19-24 10/05A    | 3.400.000   | EUR    | 3.529.877                    | 0,36             |
| BANCO SANTANDER 1.125 18-25 17/01A        | 1.800.000   | EUR    | 1.862.820                    | 0,19             |
| BANCO SANTANDER SA 1.125 20-27 23/06A     | 2.800.000   | EUR    | 2.921.170                    | 0,30             |
| BANKIA SA 1.0000 19-24 25/06A             | 300.000     | EUR    | 308.074                      | 0,03             |
| CAIXABANK SA 0.7500 21-28 26/05A          | 2.000.000   | EUR    | 2.013.260                    | 0,21             |
| CAIXABANK SA 1.3750 19-26 19/06A          | 1.500.000   | EUR    | 1.568.085                    | 0,16             |
| CELLNEX FINANCE 0.00 21-33 15/02A         | 1.900.000   | EUR    | 1.884.479                    | 0,19             |
| CELLNEX FINANCE 1.25 21-29 15/01A         | 1.900.000   | EUR    | 1.862.042                    | 0,19             |
| GRIFOLS SA 1.625 19-25 15/02S             | 1.400.000   | EUR    | 1.414.350                    | 0,15             |
| IBERDROLA FINANZAS 1.00 16-24 07/03A      | 400.000     | EUR    | 412.534                      | 0,04             |
| TELEFONICA EMISIONES 1.447 18-27 22/01A   | 2.000.000   | EUR    | 2.135.700                    | 0,22             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Total Return

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Portugal</b>                          |            |        | <b>21.082.364</b>            | <b>2,16</b>      |
| PORTUGAL 0.475 20-30 18/10A              | 20.000.000 | EUR    | 20.396.900                   | 2,09             |
| PORTUGAL 2.875 15-25 15/10A              | 600.000    | EUR    | 685.464                      | 0,07             |
| <b>Bélgica</b>                           |            |        | <b>19.914.837</b>            | <b>2,04</b>      |
| BELFIUS BANK SA 0.3750 20-25 02/09A      | 400.000    | EUR    | 403.442                      | 0,04             |
| BELFIUS BANQUE SA/NV 3.125 16-26 11/05A  | 4.000.000  | EUR    | 4.521.600                    | 0,46             |
| EUROPEAN UNION 0.00 21-31 04/07A         | 10.500.000 | EUR    | 10.483.673                   | 1,08             |
| KBC GROUP NV 0.6250 19-25 10/04A         | 4.000.000  | EUR    | 4.092.620                    | 0,42             |
| KBC GROUP NV 1.125 19-24 25/01A          | 400.000    | EUR    | 413.502                      | 0,04             |
| <b>Reino Unido</b>                       |            |        | <b>19.427.043</b>            | <b>1,99</b>      |
| BARCLAYS BANK PLC 6.625 11-22 30/03A     | 300.000    | EUR    | 315.138                      | 0,03             |
| BARCLAYS PLC 1.375 18-26 24/01A          | 2.000.000  | EUR    | 2.083.780                    | 0,21             |
| BP CAPITAL MARKETS 3.625 20-XX 22/06A    | 2.500.000  | EUR    | 2.724.825                    | 0,28             |
| CREDIT AGRICOLE LDN 0.50 19-24 24/06A    | 300.000    | EUR    | 304.899                      | 0,03             |
| JAGUAR LAND ROVER 5.875 20-28 15/01S     | 1.000.000  | USD    | 890.138                      | 0,09             |
| VIRGIN MEDIA SE 4.5000 20-30 15/08S      | 1.000.000  | USD    | 850.620                      | 0,09             |
| VMED O2 UK FINA 4.7500 21-31 15/07S      | 2.165.000  | USD    | 1.855.631                    | 0,19             |
| VMED O2 UK FINANCING 4.25 20-31 31/01S   | 4.831.000  | USD    | 4.007.257                    | 0,41             |
| VODAFONE GROUP 1.60 16-31 29/07A         | 3.000.000  | EUR    | 3.265.380                    | 0,34             |
| VODAFONE GROUP 3.1 18-79 03/01A          | 3.000.000  | EUR    | 3.129.375                    | 0,32             |
| <b>Luxemburgo</b>                        |            |        | <b>13.408.764</b>            | <b>1,37</b>      |
| ALTICE FINANCING 144A 7.50 16-26 15/05S  | 2.519.000  | USD    | 2.214.507                    | 0,23             |
| BECTON DICKINSON 1.2080 19-26 04/06A     | 2.494.000  | EUR    | 2.612.041                    | 0,27             |
| DH EUROPE FIN 0.45 19-28 18/03A          | 2.760.000  | EUR    | 2.784.426                    | 0,28             |
| MEDTRONIC GLOBAL HOLD 0.00 20-25 15/10U  | 454.000    | EUR    | 455.223                      | 0,04             |
| PROLOGIS INTL FUND II 0.75 21-33 23/03A  | 998.000    | EUR    | 979.547                      | 0,10             |
| TARGA RESOURCES 5.3750 16-27 01/02S      | 2.000.000  | USD    | 1.761.228                    | 0,18             |
| TELENET INT FIN REGS 3.50 17-28 01/03S   | 2.500.000  | EUR    | 2.601.792                    | 0,27             |
| <b>Suiza</b>                             |            |        | <b>7.111.559</b>             | <b>0,73</b>      |
| CREDIT SUISSE 0.625 21-33 18/01A         | 3.300.000  | EUR    | 3.107.759                    | 0,32             |
| UBS GROUP FUNDING 1.50 16-24 30/11A      | 3.856.000  | EUR    | 4.003.800                    | 0,41             |
| <b>Canadá</b>                            |            |        | <b>6.789.826</b>             | <b>0,70</b>      |
| 1011778 BC UNLIMITED 3.875 19-28 15/01S  | 2.572.000  | USD    | 2.198.638                    | 0,23             |
| BAUSCH HEALTH 144A 6.125 15-25 15/04S    | 1.000.000  | USD    | 865.376                      | 0,09             |
| BAUSCH HEALTH COMPANIE 5.25 20-31 15/02S | 2.678.000  | USD    | 2.114.353                    | 0,22             |
| BAUSCH HEALTH COS INC                    | 1.864.000  | USD    | 1.611.459                    | 0,16             |
| <b>Irlanda</b>                           |            |        | <b>5.531.999</b>             | <b>0,57</b>      |
| ARDAGH PACKAGING FIN 5.25 20-25 30/04S   | 3.500.000  | USD    | 3.106.291                    | 0,32             |
| EIRCOM FINA 3.5000 19-26 15/05U          | 2.000.000  | EUR    | 2.051.426                    | 0,21             |
| FRESENIUS FINANCE IRL 0.0 21-25 01/10A   | 375.000    | EUR    | 374.282                      | 0,04             |
| <b>Japón</b>                             |            |        | <b>3.867.850</b>             | <b>0,40</b>      |
| TAKEDA PHARMACEUTICAL 2.25 18-26 21/11A  | 3.500.000  | EUR    | 3.867.850                    | 0,40             |
| <b>Dinamarca</b>                         |            |        | <b>3.101.370</b>             | <b>0,32</b>      |
| CARLSBERG BREWERIES 0.875 19-29 01/07A   | 3.000.000  | EUR    | 3.101.370                    | 0,32             |
| <b>Suecia</b>                            |            |        | <b>3.072.516</b>             | <b>0,31</b>      |
| VERISURE HOLDING AB 3.875 20-26 15/07S   | 3.000.000  | EUR    | 3.072.516                    | 0,31             |
| <b>Australia</b>                         |            |        | <b>2.992.545</b>             | <b>0,31</b>      |
| MACQUARIE GROUP LTD 0.95 21-31 21/05A    | 3.000.000  | EUR    | 2.992.545                    | 0,31             |
| <b>México</b>                            |            |        | <b>2.279.605</b>             | <b>0,23</b>      |
| ALFA SAB 6.875 14-44 25/03S              | 300.000    | USD    | 335.087                      | 0,03             |
| MEXICO 1.35 20-27 18/09A                 | 480.000    | EUR    | 498.317                      | 0,05             |
| MEXICO 1.375 16-25 15/01A                | 300.000    | EUR    | 313.433                      | 0,03             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Total Return

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                          | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|---------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| MEXICO 1.45 21-33 25/10S              | 485.000   | EUR    | 464.232                      | 0,05             |
| MEXICO 4.15 17-27 28/03S              | 700.000   | USD    | 668.536                      | 0,07             |
| <b>Indonesia</b>                      |           |        | <b>1.747.500</b>             | <b>0,18</b>      |
| INDONESIA 2.85 20-30 14/02S           | 1.000.000 | USD    | 876.086                      | 0,09             |
| INDONESIA 3.375 15-25 30/07S          | 300.000   | EUR    | 336.054                      | 0,03             |
| INDONESIA REGS 3.75 16-28 14/06A      | 450.000   | EUR    | 535.360                      | 0,06             |
| <b>Colombia</b>                       |           |        | <b>1.599.328</b>             | <b>0,16</b>      |
| COLOMBIA 3.875 16-26 22/03A           | 1.000.000 | EUR    | 1.119.090                    | 0,11             |
| COLOMBIA 4.125 20-51 15/05S           | 600.000   | USD    | 480.238                      | 0,05             |
| <b>Rumanía</b>                        |           |        | <b>1.320.950</b>             | <b>0,14</b>      |
| ROMANIA 1.3750 20-29 02/12A           | 400.000   | EUR    | 399.730                      | 0,04             |
| ROMANIA 2.75 15-25 29/10A             | 300.000   | EUR    | 332.610                      | 0,04             |
| ROMANIA 3.875 15-35 29/10A            | 500.000   | EUR    | 588.610                      | 0,06             |
| <b>República Dominicana</b>           |           |        | <b>1.212.017</b>             | <b>0,12</b>      |
| DOMINICAN REPUBLIC 4.875 20-32 23/09S | 1.000.000 | USD    | 874.260                      | 0,09             |
| DOMINICAN REPUBLIC 5.875 20-60 30/01S | 400.000   | USD    | 337.757                      | 0,03             |
| <b>Serbia</b>                         |           |        | <b>931.580</b>               | <b>0,10</b>      |
| SERBIA 2.125 20-30 01/12S             | 700.000   | USD    | 560.581                      | 0,06             |
| SERBIA 3.1250 20-27 15/05A            | 333.000   | EUR    | 370.999                      | 0,04             |
| <b>Brasil</b>                         |           |        | <b>841.167</b>               | <b>0,09</b>      |
| BRAZIL 4.75 19-50 14/01S              | 1.025.000 | USD    | 841.167                      | 0,09             |
| <b>Marruecos</b>                      |           |        | <b>835.061</b>               | <b>0,09</b>      |
| MOROCCO 1.50 19-31 27/11A             | 200.000   | EUR    | 188.245                      | 0,02             |
| MOROCCO 3.0000 20-32 15/12S           | 600.000   | USD    | 489.815                      | 0,05             |
| MOROCCO 4.0 20-50 15/12S              | 200.000   | USD    | 157.001                      | 0,02             |
| <b>Filipinas</b>                      |           |        | <b>805.895</b>               | <b>0,08</b>      |
| PHILIPPINES 0.2500 21-25 28/04A       | 300.000   | EUR    | 301.518                      | 0,03             |
| PHILIPPINES 1.20 21-33 28/04A         | 300.000   | EUR    | 300.427                      | 0,03             |
| PHILIPPINES 1.6480 20-31 10/06S       | 250.000   | USD    | 203.950                      | 0,02             |
| <b>India</b>                          |           |        | <b>791.611</b>               | <b>0,08</b>      |
| BHARTI AIRTEL REGS 4.375 15-25 10/06S | 300.000   | USD    | 276.327                      | 0,03             |
| EXP IMP BANK INDI 3.25 20-30 15/01S   | 600.000   | USD    | 515.284                      | 0,05             |
| <b>Paraguay</b>                       |           |        | <b>735.336</b>               | <b>0,08</b>      |
| PARAGUAY 6.10 14-44 11/08S            | 700.000   | USD    | 735.336                      | 0,08             |
| <b>Costa Rica</b>                     |           |        | <b>695.414</b>               | <b>0,07</b>      |
| COSTA RICA REGS 4.375 13-25 30/04S    | 800.000   | USD    | 695.414                      | 0,07             |
| <b>Ghana</b>                          |           |        | <b>694.535</b>               | <b>0,07</b>      |
| GHANA REGS 8.125 14-26 18/01S         | 450.000   | USD    | 409.460                      | 0,04             |
| REPUBLIC OF GHA 8.6270 18-49 16/06S   | 350.000   | USD    | 285.075                      | 0,03             |
| <b>Perú</b>                           |           |        | <b>688.645</b>               | <b>0,07</b>      |
| PERU 2.7830 20-31 23/01S              | 800.000   | USD    | 688.645                      | 0,07             |
| <b>Sudáfrica</b>                      |           |        | <b>626.961</b>               | <b>0,06</b>      |
| SOUTH AFRICA 5.75 19-49 30/09S        | 725.000   | USD    | 626.961                      | 0,06             |
| <b>Chile</b>                          |           |        | <b>579.505</b>               | <b>0,06</b>      |
| CHILE 1.25 21-51 22/01A               | 300.000   | EUR    | 268.945                      | 0,03             |
| CHILE 3.5 21-53 15/05A                | 350.000   | USD    | 310.560                      | 0,03             |
| <b>Ucrania</b>                        |           |        | <b>574.462</b>               | <b>0,06</b>      |
| UKRAINE 7.253 20-33 15/03S            | 350.000   | USD    | 307.964                      | 0,03             |
| UKRAINE 7.375 17-32 25/09S            | 300.000   | USD    | 266.498                      | 0,03             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Total Return

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                            | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|-----------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| <b>Kenia</b>                            |           |        | <b>570.688</b>               | <b>0,06</b>      |
| KENYA 8.0 19-32 22/05S                  | 600.000   | USD    | 570.688                      | 0,06             |
| <b>Turquía</b>                          |           |        | <b>505.369</b>               | <b>0,05</b>      |
| TURKCELL ILETISIM 5.75 15-25 15/10S     | 300.000   | USD    | 272.144                      | 0,03             |
| TURK TELEKOM 6.875 19-25 28/02S         | 250.000   | USD    | 233.225                      | 0,02             |
| <b>Panamá</b>                           |           |        | <b>479.802</b>               | <b>0,05</b>      |
| PANAMA 4.5000 18-50 16/04S              | 500.000   | USD    | 479.802                      | 0,05             |
| <b>Costa de Marfil</b>                  |           |        | <b>433.850</b>               | <b>0,04</b>      |
| COTE D IVOIRE 6.625 18-48 22/03A        | 200.000   | EUR    | 210.737                      | 0,02             |
| IVORY COAST 6.125 17-33 15/06S          | 250.000   | USD    | 223.113                      | 0,02             |
| <b>Guatemala</b>                        |           |        | <b>426.718</b>               | <b>0,04</b>      |
| GUATEMALA 4.875 13-28 13/02S            | 450.000   | USD    | 426.718                      | 0,04             |
| <b>Bermuda</b>                          |           |        | <b>422.259</b>               | <b>0,04</b>      |
| BERMUDA 2.3750 20-30 20/08S             | 500.000   | USD    | 422.259                      | 0,04             |
| <b>Hungría</b>                          |           |        | <b>416.007</b>               | <b>0,04</b>      |
| HUNGARY 7.625 11-41 29/03S              | 300.000   | USD    | 416.007                      | 0,04             |
| <b>Uruguay</b>                          |           |        | <b>415.852</b>               | <b>0,04</b>      |
| URUGUAY 5.10 14-50 18/06S               | 375.000   | USD    | 415.852                      | 0,04             |
| <b>Jordania</b>                         |           |        | <b>409.330</b>               | <b>0,04</b>      |
| JORDANIE 5.75 16-27 31/01S              | 450.000   | USD    | 409.330                      | 0,04             |
| <b>El Salvador</b>                      |           |        | <b>402.620</b>               | <b>0,04</b>      |
| EL SALVADOR REG-S 8.25 02-32 10/04S     | 500.000   | USD    | 402.620                      | 0,04             |
| <b>Islas Caimán</b>                     |           |        | <b>368.986</b>               | <b>0,04</b>      |
| TENCENT HOLDING 3.5750 19-26 11/04S     | 400.000   | USD    | 368.986                      | 0,04             |
| <b>Jamaica</b>                          |           |        | <b>354.409</b>               | <b>0,04</b>      |
| JAMAICA 7.875 15-45 28/07S              | 300.000   | USD    | 354.409                      | 0,04             |
| <b>Senegal</b>                          |           |        | <b>341.805</b>               | <b>0,04</b>      |
| SENEGAL 6.75 18-48 13/03S               | 400.000   | USD    | 341.805                      | 0,04             |
| <b>Croacia</b>                          |           |        | <b>248.773</b>               | <b>0,03</b>      |
| CROATIA 1.125 21-33 04/03A              | 250.000   | EUR    | 248.773                      | 0,03             |
| <b>Finlandia</b>                        |           |        | <b>212.875</b>               | <b>0,02</b>      |
| NOKIA OYJ 2.3750 20-25 15/05A           | 200.000   | EUR    | 212.875                      | 0,02             |
| <b>Honduras</b>                         |           |        | <b>176.980</b>               | <b>0,02</b>      |
| HONDURAS 5.625 20-30 24/06S             | 200.000   | USD    | 176.980                      | 0,02             |
| <b>Obligaciones convertibles</b>        |           |        | <b>27.636.689</b>            | <b>2,84</b>      |
| <b>Francia</b>                          |           |        | <b>12.307.642</b>            | <b>1,26</b>      |
| ACCOR SA-DY 0.70 20-27 07/12S           | 50.000    | EUR    | 2.610.916                    | 0,27             |
| MICHELIN CV 0.00 17-22 10/01U           | 3.000.000 | USD    | 2.718.442                    | 0,28             |
| SELENA CV 0.00 20-25 25/06U             | 1.500.000 | EUR    | 1.846.162                    | 0,19             |
| UBISOFT ENTERTAIN CV 0.0 19-24 24/09U   | 25.000    | EUR    | 2.848.912                    | 0,29             |
| WORLDLINE SA DIRTY CV 0.00 19-26 30/07U | 20.000    | EUR    | 2.283.210                    | 0,23             |
| <b>Países Bajos</b>                     |           |        | <b>6.235.386</b>             | <b>0,64</b>      |
| BRENNTAG FINANCE CV 1.875 15-22 02/12S  | 1.750.000 | USD    | 1.746.289                    | 0,18             |
| QIAGEN NV CV 0.00 20-27 17/12U          | 3.000.000 | USD    | 2.454.035                    | 0,25             |
| STMICROELECTRON CV 0.0000 20-25 04/08A  | 2.000.000 | USD    | 2.035.062                    | 0,21             |
| <b>Alemania</b>                         |           |        | <b>4.762.470</b>             | <b>0,49</b>      |
| DELIVERY HERO AG CV 0.875 20-25 15/07S  | 2.000.000 | EUR    | 2.112.170                    | 0,22             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Total Return

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad   | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|------------|--------|------------------------------|------------------|
| ZALANDO SE CV 0.05 20-25 06/08A          | 2.000.000  | EUR    | 2.650.300                    | 0,27             |
| <b>Estados Unidos de América</b>         |            |        | <b>2.416.194</b>             | <b>0,25</b>      |
| JPMORGAN CHASE BANK CV 0.00 21-24 18/02U | 2.200.000  | EUR    | 2.416.194                    | 0,25             |
| <b>España</b>                            |            |        | <b>1.914.997</b>             | <b>0,20</b>      |
| CELLNEX TELECOM CV 0.50 19-28 05/07A     | 1.400.000  | EUR    | 1.914.997                    | 0,20             |
| <b>Obligaciones de tasa variable</b>     |            |        | <b>171.067.234</b>           | <b>17,54</b>     |
| <b>Francia</b>                           |            |        | <b>40.665.449</b>            | <b>4,17</b>      |
| ARKEMA SA FL.R 20-99 31/12A              | 4.000.000  | EUR    | 4.043.040                    | 0,41             |
| AXA SA FL.R 21-41 07/10A                 | 2.714.000  | EUR    | 2.714.909                    | 0,28             |
| BNP PARIBAS CARDIF FL.R 4.032 14-XX 25   | 1.700.000  | EUR    | 1.925.106                    | 0,20             |
| CNP ASSURANCES FL.R 18-XX 27/06S         | 1.200.000  | EUR    | 1.381.884                    | 0,14             |
| CREDIT AGRICOLE SA FL.R 20-30 05/06A     | 1.400.000  | EUR    | 1.455.559                    | 0,15             |
| CREDIT LOGEMENT FL.R 17-29 28/11A        | 2.400.000  | EUR    | 2.474.724                    | 0,25             |
| CREDIT MUTUEL ARKEA FL.R 17-29 25/10A    | 1.800.000  | EUR    | 1.880.838                    | 0,19             |
| CREDIT MUTUEL ARKEA FL.R 20-29 11/06A    | 1.000.000  | EUR    | 1.043.490                    | 0,11             |
| ELECTRICITE DE FL.R 20-XX XX/XXA         | 1.600.000  | EUR    | 1.652.374                    | 0,17             |
| FRANCE 0.1 20-26 01/03A                  | 1.000.000  | EUR    | 1.087.955                    | 0,11             |
| LA MONDIALE REGS SUB FL.R 14-XX 17/12A   | 2.400.000  | EUR    | 2.797.212                    | 0,29             |
| ORANGE SA FL.R 20-49 31/12A              | 5.000.000  | EUR    | 5.116.600                    | 0,52             |
| SOCIETE GENERALE FL.R 18-28 23/02A       | 3.000.000  | EUR    | 3.048.795                    | 0,31             |
| SOCIETE GENERALE FL.R 20-28 22/09A       | 400.000    | EUR    | 406.626                      | 0,04             |
| SUEZ FL.R 19-XX XX/XXA                   | 3.000.000  | EUR    | 3.020.925                    | 0,31             |
| TOTAL SE FL.R 19-XX 04/04A               | 3.973.000  | EUR    | 4.076.795                    | 0,42             |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT FL.R 20-49 21/12A   | 1.000.000  | EUR    | 1.027.300                    | 0,11             |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT FL.R 20-XX XX/XXA   | 1.500.000  | EUR    | 1.511.317                    | 0,16             |
| <b>Estados Unidos de América</b>         |            |        | <b>35.809.172</b>            | <b>3,67</b>      |
| BANK OF AMERICA CORP FL.R 21-31 22/03A   | 2.345.000  | EUR    | 2.341.307                    | 0,24             |
| BANK OF AMERICA FL.R 17-27 04/05A        | 5.000.000  | EUR    | 5.384.050                    | 0,55             |
| US TREASURY INDEX 0.125 20-30 15/07S     | 29.000.000 | USD    | 28.083.815                   | 2,88             |
| <b>Alemania</b>                          |            |        | <b>30.762.710</b>            | <b>3,15</b>      |
| ALLIANZ SE FL.R 20-XX XX/XXA             | 600.000    | USD    | 524.060                      | 0,05             |
| GERMANY 0.10 15-26 15/04A                | 20.500.000 | EUR    | 24.078.790                   | 2,47             |
| MERCK KGAA FL.R 20-80 09/09A             | 4.000.000  | EUR    | 4.127.100                    | 0,42             |
| MUNICH RE FL.R 20-41 26/05A              | 2.000.000  | EUR    | 2.032.760                    | 0,21             |
| <b>Países Bajos</b>                      |            |        | <b>14.400.653</b>            | <b>1,48</b>      |
| IBERDROLA INTL BV FL.R 17-XX 22/02A      | 2.000.000  | EUR    | 2.055.830                    | 0,21             |
| IBERDROLA INTL BV FL.R 20-99 31/12A      | 2.000.000  | EUR    | 2.065.440                    | 0,21             |
| NN GROUP NV FL.R 14-XX 15/07A            | 2.800.000  | EUR    | 3.208.352                    | 0,33             |
| REPSOL INTL FINANCE FL.R 20-XX 11/12A    | 1.000.000  | EUR    | 1.102.537                    | 0,11             |
| TELEFONICA EUROPE BV FL.R 13-XX XX/XXA   | 2.000.000  | EUR    | 2.155.798                    | 0,22             |
| TELEFONICA EUROPE BV FL.R 18-XX 22/09A   | 1.000.000  | EUR    | 1.035.379                    | 0,11             |
| TELEFONICA EUROPE BV FL.R 19-XX 24/09A   | 2.700.000  | EUR    | 2.777.317                    | 0,29             |
| <b>Canadá</b>                            |            |        | <b>13.055.842</b>            | <b>1,34</b>      |
| CANADA 4.00 99-31 01/12S                 | 8.500.000  | CAD    | 13.055.842                   | 1,34             |
| <b>Italia</b>                            |            |        | <b>9.984.126</b>             | <b>1,02</b>      |
| ENEL SPA EMTN 2.25 20-XX XX/XXA          | 4.000.000  | EUR    | 4.194.140                    | 0,43             |
| ENI SPA FL.R 20-49 31/12A                | 2.500.000  | EUR    | 2.661.288                    | 0,27             |
| UNICREDIT SPA FL.R 19-25 25/06A          | 1.022.000  | EUR    | 1.052.854                    | 0,11             |
| UNICREDIT SPA FL.R 19-29 23/09A          | 992.000    | EUR    | 1.000.534                    | 0,10             |
| UNICREDIT SPA FL.R 20-32 15/01A          | 1.050.000  | EUR    | 1.075.310                    | 0,11             |
| <b>Dinamarca</b>                         |            |        | <b>6.433.619</b>             | <b>0,66</b>      |
| NYKREDIT REALKREDIT FL.R 15-27 17/11A    | 2.500.000  | EUR    | 2.592.413                    | 0,27             |

# Candriam Bonds

## Candriam Bonds Total Return

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                                           | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|--------------------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| ORSTED FL.R 19-XX 09/12A                               | 3.737.000 | EUR    | 3.841.206                    | 0,39             |
| <b>Austria</b>                                         |           |        | <b>4.230.680</b>             | <b>0,43</b>      |
| OMV AG FL.R 18-XX 19/06A                               | 4.000.000 | EUR    | 4.230.680                    | 0,43             |
| <b>España</b>                                          |           |        | <b>3.095.955</b>             | <b>0,32</b>      |
| BANCO BILBAO VIZCAYA FL.R 20-30 16/01A                 | 1.000.000 | EUR    | 1.006.415                    | 0,10             |
| CAIXABANK SA FL.R 17-28 14/07A                         | 2.000.000 | EUR    | 2.089.540                    | 0,22             |
| <b>Reino Unido</b>                                     |           |        | <b>2.634.045</b>             | <b>0,27</b>      |
| AVIVA PLC FL.R 14-44 03/07A                            | 2.000.000 | EUR    | 2.210.340                    | 0,23             |
| VODAFONE GROUP FL.R 21-81 04/06S                       | 500.000   | USD    | 423.705                      | 0,04             |
| <b>Suiza</b>                                           |           |        | <b>2.392.390</b>             | <b>0,25</b>      |
| CREDIT SUISSE GROUP FL.R 20-28 14/01A                  | 2.390.000 | EUR    | 2.392.390                    | 0,25             |
| <b>Australia</b>                                       |           |        | <b>2.093.880</b>             | <b>0,21</b>      |
| COMMONW BK AUSTRALIA FL.R 17-29 03/10A                 | 2.000.000 | EUR    | 2.093.880                    | 0,21             |
| <b>Portugal</b>                                        |           |        | <b>2.010.976</b>             | <b>0,21</b>      |
| ENERGIAS DE POR FL.R 21-81 02/08A                      | 2.000.000 | EUR    | 2.010.976                    | 0,21             |
| <b>Suecia</b>                                          |           |        | <b>2.001.660</b>             | <b>0,20</b>      |
| SWEDBANK AB FL.R 21-27 20/05A                          | 2.000.000 | EUR    | 2.001.660                    | 0,20             |
| <b>Bélgica</b>                                         |           |        | <b>1.040.895</b>             | <b>0,11</b>      |
| KBC GROUP NV FL.R 17-29 18/09A                         | 1.000.000 | EUR    | 1.040.895                    | 0,11             |
| <b>Namibia</b>                                         |           |        | <b>455.182</b>               | <b>0,05</b>      |
| NAMIBIA (REP OF) REGS FL.R 15-25 29/10S                | 500.000   | USD    | 455.182                      | 0,05             |
| <b>Otros valores mobiliarios</b>                       |           |        | <b>12.780.107</b>            | <b>1,31</b>      |
| <b>Obligaciones</b>                                    |           |        | <b>10.766.737</b>            | <b>1,10</b>      |
| <b>Estados Unidos de América</b>                       |           |        | <b>6.766.567</b>             | <b>0,69</b>      |
| CSC HOLDINGS LLC 7.5 18-28 01/04S                      | 1.500.000 | USD    | 1.391.936                    | 0,14             |
| LUMEN TECH 5.375 21-29 15/06S                          | 1.714.000 | USD    | 1.470.609                    | 0,15             |
| SUMMER BC BIDCO B LLC 5.5 21-26 31/10S                 | 2.400.000 | USD    | 2.066.785                    | 0,21             |
| VALEANT PHAR. 8.5 18-27 01/06S                         | 2.000.000 | USD    | 1.837.237                    | 0,19             |
| <b>Francia</b>                                         |           |        | <b>2.143.976</b>             | <b>0,22</b>      |
| ALTICE FRANCE SA 5.125 21-29 15/07S                    | 2.527.000 | USD    | 2.143.976                    | 0,22             |
| <b>Reino Unido</b>                                     |           |        | <b>1.856.194</b>             | <b>0,19</b>      |
| JAGUAR LAND ROVER 7.75 20-25 15/10S                    | 2.000.000 | USD    | 1.856.194                    | 0,19             |
| <b>Obligaciones convertibles</b>                       |           |        | <b>2.013.370</b>             | <b>0,21</b>      |
| <b>Bélgica</b>                                         |           |        | <b>2.013.370</b>             | <b>0,21</b>      |
| SAGERPARCV 0.0 21-26 01/04U                            | 2.000.000 | EUR    | 2.013.370                    | 0,21             |
| <b>Organismos de Inversión Colectiva</b>               |           |        | <b>95.418.769</b>            | <b>9,78</b>      |
| <b>Acciones/Participaciones en fondos de inversión</b> |           |        | <b>95.418.769</b>            | <b>9,78</b>      |
| <b>Luxemburgo</b>                                      |           |        | <b>70.625.218</b>            | <b>7,24</b>      |
| CANDRIAM BONDS EMERGING MARKETS CORPORATE I EUR C H    | 1.600     | EUR    | 2.478.176                    | 0,25             |
| CANDRIAM BONDS EMERGING MARKET TOTAL RETURN Z USD C    | 3.650     | USD    | 5.013.602                    | 0,51             |
| CANDRIAM MONEY MARKET EURO AAA Z EUR C                 | 1         | EUR    | 598                          | 0,00             |
| G FUND EUROPEAN CONVERTIBLE BONDS I EUR CAP            | 7.000     | EUR    | 12.012.140                   | 1,23             |
| JPMF GLB CONV EURO JPM I ACC                           | 985.000   | EUR    | 19.512.850                   | 2,00             |
| SCHRODER INT SEL GLB CONV BD -C EUR HDG-               | 115.500   | EUR    | 21.889.052                   | 2,25             |

## Candriam Bonds

### Candriam Bonds Total Return

Cartera de valores al 30 de junio de 2021

| Denominación                             | Cantidad  | Divisa | Valor de mercado<br>(en EUR) | % activo<br>neto |
|------------------------------------------|-----------|--------|------------------------------|------------------|
| UBAM - GLOBAL CONVERTIBLE BOND I CAP EUR | 60.000    | EUR    | 9.718.800                    | 1,00             |
| <b>Irlanda</b>                           |           |        | <b>24.793.551</b>            | <b>2,54</b>      |
| GAVEKAL CH FIX INCOME-RMBCNH             | 1.765.000 | CNH    | 24.793.551                   | 2,54             |
| <b>Total de la cartera de valores</b>    |           |        | <b>857.657.922</b>           | <b>87,94</b>     |
| Coste de adquisición                     |           |        | 835.065.040                  |                  |

## Candriam Bonds

---

### Candriam Bonds Total Return

Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

**Distribución geográfica (en % activo neto)**

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| Estados Unidos de América | 26,92        |
| Francia                   | 10,83        |
| Luxemburgo                | 8,62         |
| Alemania                  | 7,37         |
| Países Bajos              | 5,77         |
| Italia                    | 4,17         |
| Irlanda                   | 3,11         |
| España                    | 2,92         |
| Noruega                   | 2,78         |
| Reino Unido               | 2,45         |
| Portugal                  | 2,37         |
| Bélgica                   | 2,36         |
| Canadá                    | 2,03         |
| Dinamarca                 | 0,98         |
| Suiza                     | 0,97         |
| Suecia                    | 0,52         |
| Australia                 | 0,52         |
| Austria                   | 0,43         |
| Japón                     | 0,40         |
| México                    | 0,23         |
| Indonesia                 | 0,18         |
| Colombia                  | 0,16         |
| Rumanía                   | 0,14         |
| República Dominicana      | 0,12         |
| Serbia                    | 0,10         |
| Marruecos                 | 0,09         |
| Brasil                    | 0,09         |
| India                     | 0,08         |
| Filipinas                 | 0,08         |
| Paraguay                  | 0,08         |
| Ghana                     | 0,07         |
| Perú                      | 0,07         |
| Costa Rica                | 0,07         |
| Ucrania                   | 0,06         |
| Sudáfrica                 | 0,06         |
| Chile                     | 0,06         |
| Kenia                     | 0,06         |
| Panamá                    | 0,05         |
| Turquía                   | 0,05         |
| Namibia                   | 0,05         |
| Guatemala                 | 0,04         |
| Hungría                   | 0,04         |
| Jamaica                   | 0,04         |
| Jordania                  | 0,04         |
| Senegal                   | 0,04         |
| El Salvador               | 0,04         |
| Uruguay                   | 0,04         |
| Costa de Marfil           | 0,04         |
| Islas Caimán              | 0,04         |
| Bermuda                   | 0,04         |
| Croacia                   | 0,03         |
| Honduras                  | 0,02         |
| Finlandia                 | 0,02         |
|                           | <b>87,94</b> |

## Candriam Bonds

---

### Candriam Bonds Total Return

#### Distribución geográfica y económica de la cartera de valores al 30 de junio de 2021

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

|                                                                |              |
|----------------------------------------------------------------|--------------|
| Obligaciones del Estado, de las provincias y de los municipios | 26,46        |
| Bancos y otras entidades financieras                           | 11,93        |
| Holdings y entidades financieras                               | 10,96        |
| Fondos de inversión                                            | 9,78         |
| Telecomunicaciones                                             | 6,10         |
| Seguros                                                        | 2,66         |
| Energía y servicio de aguas                                    | 2,33         |
| Farmacia y cosméticos                                          | 2,26         |
| Petróleo                                                       | 2,14         |
| Servicios varios                                               | 1,14         |
| Organizaciones supranacionales                                 | 1,08         |
| Sociedades inmobiliarias                                       | 1,03         |
| Artículos de oficina y ordenadores                             | 0,85         |
| Industria automovilística                                      | 0,78         |
| Internet y servicios de Internet                               | 0,73         |
| Industria del embalaje                                         | 0,72         |
| Electrotecnia y electrónica                                    | 0,63         |
| Caucho y neumáticos                                            | 0,60         |
| Química                                                        | 0,53         |
| Tabaco y alcohol                                               | 0,50         |
| Biotechnología                                                 | 0,49         |
| Servicios sociales y de sanidad pública                        | 0,47         |
| Construcción, material de construcción                         | 0,46         |
| Textiles y vestido                                             | 0,46         |
| Industrias agro-alimentarias                                   | 0,45         |
| Restaurantes, hoteles                                          | 0,45         |
| Comercio minorista y grandes almacenes                         | 0,37         |
| Bienes de consumo diversos                                     | 0,36         |
| Instituciones inclasificables / no clasificadas                | 0,26         |
| Artes gráficas y editoriales                                   | 0,23         |
| Electrónica y semiconductores                                  | 0,21         |
| Transporte                                                     | 0,21         |
| Construcción de máquinas y aparatos                            | 0,17         |
| Minas                                                          | 0,14         |
|                                                                | <b>87,94</b> |

# Candriam Bonds

## Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

### Opciones

Al 30 de junio de 2021, los siguientes contratos de opciones estaban pendientes:

#### Candriam Bonds Credit Opportunities

| Cantidad                               | Denominación                           | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor<br>absoluto) | Valor de<br>mercado<br>(en EUR) | No realizado<br>(en EUR) |
|----------------------------------------|----------------------------------------|--------|--------------------------------------------------|---------------------------------|--------------------------|
| <b>Opciones emitidas</b>               |                                        |        |                                                  |                                 |                          |
| <b>Opciones sobre tasas de interés</b> |                                        |        |                                                  |                                 |                          |
| 100.000.000                            | IXOVER355M OTC SEP 2.250 15.09.21 CALL | EUR    | 27.515.385                                       | (329.683)                       | (59.683)                 |
| 100.000.000                            | IXOVER355M OTC SEP 4.000 15.09.21 CALL | EUR    | 8.798.523                                        | (145.423)                       | 349.577                  |
| 100.000.000                            | IXOVER355M OTC SEP 2.370 15.09.21 CALL | EUR    | 40.086.910                                       | (593.580)                       | (173.580)                |
| 200.000.000                            | IXOVER355M OTC JUL 3.500 21.07.21 PUT  | EUR    | 2.675.106                                        | (18.520)                        | 716.580                  |
| <b>Opciones sobre futuros</b>          |                                        |        |                                                  |                                 |                          |
| 136                                    | IEURO BUND AUG 172.50 23.07.21 CALL    | EUR    | 12.441.729                                       | (23.120)                        | (23.120)                 |
| 1.330                                  | IEURO BUND SEP 173.00 27.08.21 CALL    | EUR    | 101.929.657                                      | (236.600)                       | (236.600)                |
|                                        |                                        |        |                                                  | <b>(1.346.926)</b>              | <b>573.174</b>           |

#### Candriam Bonds Euro

| Cantidad                      | Denominación                           | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor<br>absoluto) | Valor de<br>mercado<br>(en EUR) | No realizado<br>(en EUR) |
|-------------------------------|----------------------------------------|--------|--------------------------------------------------|---------------------------------|--------------------------|
| <b>Opciones compradas</b>     |                                        |        |                                                  |                                 |                          |
| <b>Opciones sobre futuros</b> |                                        |        |                                                  |                                 |                          |
| 787                           | USD 10Y TREASU SEP 131.50 27.08.21 PUT | USD    | -                                                | 331.816                         | (63.732)                 |
| <b>Opciones emitidas</b>      |                                        |        |                                                  |                                 |                          |
| <b>Opciones sobre futuros</b> |                                        |        |                                                  |                                 |                          |
| 787                           | USD 10Y TREASU SEP 130.50 27.08.21 PUT | USD    | 16.882.773                                       | (165.908)                       | 67.365                   |
|                               |                                        |        |                                                  | <b>165.908</b>                  | <b>3.633</b>             |

#### Candriam Bonds Euro Corporate

| Cantidad                               | Denominación                          | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor<br>absoluto) | Valor de<br>mercado<br>(en EUR) | No realizado<br>(en EUR) |
|----------------------------------------|---------------------------------------|--------|--------------------------------------------------|---------------------------------|--------------------------|
| <b>Opciones compradas</b>              |                                       |        |                                                  |                                 |                          |
| <b>Opciones sobre tasas de interés</b> |                                       |        |                                                  |                                 |                          |
| 18.000.000                             | IEURO355M OTC SEP 0.550 15.09.21 PUT  | EUR    | -                                                | 16.345                          | (35.855)                 |
| <b>Opciones emitidas</b>               |                                       |        |                                                  |                                 |                          |
| <b>Opciones sobre tasas de interés</b> |                                       |        |                                                  |                                 |                          |
| 18.000.000                             | IEURO355M OTC SEP 0.700 15.09.21 CALL | EUR    | 2.585.693                                        | (8.311)                         | 19.589                   |
|                                        |                                       |        |                                                  | <b>8.034</b>                    | <b>(16.266)</b>          |

#### Candriam Bonds Euro Diversified

| Cantidad                      | Denominación                           | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor<br>absoluto) | Valor de<br>mercado<br>(en EUR) | No realizado<br>(en EUR) |
|-------------------------------|----------------------------------------|--------|--------------------------------------------------|---------------------------------|--------------------------|
| <b>Opciones compradas</b>     |                                        |        |                                                  |                                 |                          |
| <b>Opciones sobre futuros</b> |                                        |        |                                                  |                                 |                          |
| 905                           | USD 10Y TREASU SEP 131.50 27.08.21 PUT | USD    | -                                                | 381.567                         | (73.288)                 |
| <b>Opciones emitidas</b>      |                                        |        |                                                  |                                 |                          |
| <b>Opciones sobre futuros</b> |                                        |        |                                                  |                                 |                          |
| 905                           | USD 10Y TREASU SEP 130.50 27.08.21 PUT | USD    | 19.414.116                                       | (190.784)                       | 77.466                   |
|                               |                                        |        |                                                  | <b>190.783</b>                  | <b>4.178</b>             |

## Candriam Bonds

### Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

#### Opciones

##### Candriam Bonds Euro Government

| Cantidad                  | Denominación                           | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor<br>absoluto) | Valor de<br>mercado<br>(en EUR) | No realizado<br>(en EUR) |
|---------------------------|----------------------------------------|--------|--------------------------------------------------|---------------------------------|--------------------------|
| <b>Opciones compradas</b> |                                        |        |                                                  |                                 |                          |
|                           | <b>Opciones sobre futuros</b>          |        |                                                  |                                 |                          |
| 1.200                     | USD 10Y TREASU SEP 131.50 27.08.21 PUT | USD    | -                                                | 505.945                         | (97.178)                 |
| <b>Opciones emitidas</b>  |                                        |        |                                                  |                                 |                          |
|                           | <b>Opciones sobre futuros</b>          |        |                                                  |                                 |                          |
| 1.200                     | USD 10Y TREASU SEP 130.50 27.08.21 PUT | USD    | 25.742.474                                       | (252.973)                       | 102.718                  |
|                           |                                        |        |                                                  | <b>252.972</b>                  | <b>5.540</b>             |

##### Candriam Bonds Euro Long Term

| Cantidad                  | Denominación                           | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor<br>absoluto) | Valor de<br>mercado<br>(en EUR) | No realizado<br>(en EUR) |
|---------------------------|----------------------------------------|--------|--------------------------------------------------|---------------------------------|--------------------------|
| <b>Opciones compradas</b> |                                        |        |                                                  |                                 |                          |
|                           | <b>Opciones sobre futuros</b>          |        |                                                  |                                 |                          |
| 150                       | USD 10Y TREASU SEP 131.50 27.08.21 PUT | USD    | -                                                | 63.243                          | (12.147)                 |
| <b>Opciones emitidas</b>  |                                        |        |                                                  |                                 |                          |
|                           | <b>Opciones sobre futuros</b>          |        |                                                  |                                 |                          |
| 150                       | USD 10Y TREASU SEP 130.50 27.08.21 PUT | USD    | 3.217.809                                        | (31.621)                        | 12.839                   |
|                           |                                        |        |                                                  | <b>31.622</b>                   | <b>692</b>               |

##### Candriam Bonds International

| Cantidad                  | Denominación                           | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor<br>absoluto) | Valor de<br>mercado<br>(en EUR) | No realizado<br>(en EUR) |
|---------------------------|----------------------------------------|--------|--------------------------------------------------|---------------------------------|--------------------------|
| <b>Opciones compradas</b> |                                        |        |                                                  |                                 |                          |
|                           | <b>Opciones sobre futuros</b>          |        |                                                  |                                 |                          |
| 160                       | USD 10Y TREASU SEP 131.50 27.08.21 PUT | USD    | -                                                | 67.459                          | (12.957)                 |
| <b>Opciones emitidas</b>  |                                        |        |                                                  |                                 |                          |
|                           | <b>Opciones sobre futuros</b>          |        |                                                  |                                 |                          |
| 160                       | USD 10Y TREASU SEP 130.50 27.08.21 PUT | USD    | 3.432.330                                        | (33.729)                        | 13.696                   |
|                           |                                        |        |                                                  | <b>33.730</b>                   | <b>739</b>               |

Todos los contratos de opciones y swaptions se celebraron con la contraparte J.P. Morgan AG. Consulte la Nota 11 sobre el Efectivo en intermediarios relacionado con opciones cotizadas y la Nota 12 Garantías recibidas/emitidas en relación con opciones y swaptions extrabursátiles. No se divulga el compromiso de las opciones compradas.

# Candriam Bonds

## Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

### Contratos de cambio a plazo

Al 30 de junio de 2021, los siguientes contratos de cambio a plazo estaban pendientes:

#### Candriam Bonds Capital Securities

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte               |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|---------------------------|
| EUR             | 9.040.309         | USD            | 11.000.000       | 15/07/2021           | (232.869)             | Barclays Bank Ireland Plc |
| EUR             | 418.376           | USD            | 500.000          | 15/07/2021           | (3.130)               | J.P. Morgan AG            |
| EUR             | 2.676.399         | GBP            | 2.300.000        | 15/07/2021           | (2.225)               | J.P. Morgan AG            |
| USD             | 11.861            | EUR            | 10.000           | 15/07/2021           | (1)                   | J.P. Morgan AG            |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>(238.225)</b>      |                           |

#### Candriam Bonds Convertible Defensive

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte      |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|------------------|
| EUR             | 111.269.040       | USD            | 135.000.000      | 16/08/2021           | (2.466.734)           | J.P. Morgan AG   |
| EUR             | 10.628.312        | HKD            | 100.000.000      | 16/08/2021           | (221.346)             | J.P. Morgan AG   |
| EUR             | 2.755.032         | CHF            | 3.000.000        | 16/08/2021           | 17.564                | Société Générale |
| EUR             | 6.388.686         | JPY            | 850.000.000      | 16/08/2021           | (65.706)              | UBS Europe SE    |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>(2.736.222)</b>    |                  |

#### Candriam Bonds Credit Alpha

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte                      |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------------|
| EUR             | 9.068             | JPY            | 1.200.000        | 29/07/2021           | (46)                  | Nomura Financial Products Europe |
| EUR             | 8.365.394         | USD            | 10.000.000       | 29/07/2021           | (62.341)              | Nomura Financial Products Europe |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>(62.387)</b>       |                                  |

#### Candriam Bonds Credit Opportunities

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte              |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|
| CHF             | 3.046.330         | EUR            | 2.799.624        | 15/07/2021           | (20.430)              | CACEIS Bank, Lux. Branch |
| EUR             | 3.547             | USD            | 4.325            | 15/07/2021           | (99)                  | CACEIS Bank, Lux. Branch |
| EUR             | 86.020            | CHF            | 93.718           | 15/07/2021           | 520                   | CACEIS Bank, Lux. Branch |
| USD             | 13.774.062        | EUR            | 11.375.079       | 15/07/2021           | 236.599               | CACEIS Bank, Lux. Branch |
| EUR             | 179.872.817       | USD            | 215.000.000      | 29/07/2021           | (1.323.476)           | UBS Europe SE            |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>(1.106.886)</b>    |                          |

#### Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en USD) | Contraparte                      |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------------|
| EUR             | 4.966.826         | USD            | 6.017.839        | 15/07/2021           | (126.067)             | CACEIS Bank, Lux. Branch         |
| USD             | 150.737           | EUR            | 126.923          | 15/07/2021           | 178                   | CACEIS Bank, Lux. Branch         |
| CNH             | 64.165.300        | USD            | 10.000.000       | 22/07/2021           | (83.007)              | CACEIS Bank, Lux. Branch         |
| MXN             | 399.033.839       | USD            | 19.900.000       | 21/07/2021           | 95.215                | J.P. Morgan AG                   |
| RUB             | 679.213.318       | USD            | 9.400.000        | 21/07/2021           | (125.969)             | J.P. Morgan AG                   |
| USD             | 9.100.000         | TRY            | 79.708.019       | 26/07/2021           | 39.266                | J.P. Morgan AG                   |
| HUF             | 2.661.409.080     | USD            | 9.000.000        | 21/07/2021           | (10.157)              | Nomura Financial Products Europe |
| TRY             | 20.090.303        | USD            | 2.500.000        | 28/07/2021           | (218.470)             | Nomura Financial Products Europe |
| RON             | 19.113.608        | USD            | 4.700.000        | 21/07/2021           | (99.650)              | UBS Europe SE                    |
| USD             | 3.000.000         | MXN            | 59.703.447       | 21/07/2021           | 8.341                 | UBS Europe SE                    |
| USD             | 17.862.360        | EUR            | 15.000.000       | 21/07/2021           | 66.785                | UBS Europe SE                    |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>(453.535)</b>      |                                  |

# Candriam Bonds

## Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

### Contratos de cambio a plazo

#### Candriam Bonds Emerging Markets

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en USD) | Contraparte              |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|
| CHF             | 4.285.934         | USD            | 4.697.580        | 15/07/2021           | (59.326)              | CACEIS Bank, Lux. Branch |
| EUR             | 254.920.515       | USD            | 308.923.856      | 15/07/2021           | (6.530.768)           | CACEIS Bank, Lux. Branch |
| GBP             | 7.554.687         | USD            | 10.672.011       | 15/07/2021           | (235.211)             | CACEIS Bank, Lux. Branch |
| USD             | 4.624.165         | GBP            | 3.274.164        | 15/07/2021           | 100.904               | CACEIS Bank, Lux. Branch |
| USD             | 33.652            | CHF            | 30.128           | 15/07/2021           | 1.047                 | CACEIS Bank, Lux. Branch |
| USD             | 62.156.392        | EUR            | 51.065.667       | 15/07/2021           | 1.580.591             | CACEIS Bank, Lux. Branch |
| USD             | 29.456.878        | ZAR            | 420.000.000      | 21/07/2021           | 111.970               | J.P. Morgan AG           |
| USD             | 24.323.086        | EUR            | 20.000.000       | 21/07/2021           | 595.452               | J.P. Morgan AG           |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>(4.435.341)</b>    |                          |

#### Candriam Bonds Emerging Markets Corporate

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en USD) | Contraparte              |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|
| EUR             | 10.925.009        | USD            | 13.239.319       | 15/07/2021           | (279.801)             | CACEIS Bank, Lux. Branch |
| USD             | 745.798           | EUR            | 628.793          | 15/07/2021           | (91)                  | CACEIS Bank, Lux. Branch |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>(279.892)</b>      |                          |

#### Candriam Bonds Emerging Markets Total Return

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en USD) | Contraparte              |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|
| USD             | 3.580.814         | EUR            | 3.000.000        | 21/07/2021           | 21.695                | BNP Paribas Paris        |
| USD             | 706.249           | ZAR            | 10.000.000       | 21/07/2021           | 7.573                 | BNP Paribas Paris        |
| ZAR             | 26.000.000        | USD            | 1.853.590        | 21/07/2021           | (36.981)              | BNP Paribas Paris        |
| EUR             | 2.225.988         | USD            | 2.697.532        | 15/07/2021           | (57.010)              | CACEIS Bank, Lux. Branch |
| MXN             | 30.000.000        | USD            | 1.502.618        | 21/07/2021           | 655                   | J.P. Morgan AG           |
| USD             | 1.600.000         | PLN            | 6.130.508        | 21/07/2021           | (10.483)              | J.P. Morgan AG           |
| USD             | 1.824.231         | EUR            | 1.500.000        | 21/07/2021           | 44.659                | J.P. Morgan AG           |
| USD             | 701.354           | ZAR            | 10.000.000       | 21/07/2021           | 2.666                 | J.P. Morgan AG           |
| USD             | 731.359           | MXN            | 15.000.000       | 21/07/2021           | (20.323)              | J.P. Morgan AG           |
| TRY             | 7.660.466         | USD            | 900.000          | 26/07/2021           | (29.128)              | J.P. Morgan AG           |
| USD             | 900.000           | TRY            | 7.979.160        | 26/07/2021           | (7.161)               | J.P. Morgan AG           |
| USD             | 1.443.243         | MXN            | 30.000.000       | 21/07/2021           | (60.165)              | Société Générale         |
| USD             | 1.664.768         | EUR            | 1.400.000        | 21/07/2021           | 3.849                 | Société Générale         |
| USD             | 2.300.000         | TRY            | 19.834.499       | 26/07/2021           | 45.779                | Société Générale         |
| CZK             | 79.000.000        | USD            | 3.785.423        | 21/07/2021           | (112.792)             | UBS Europe SE            |
| EUR             | 500.000           | USD            | 612.152          | 21/07/2021           | (18.967)              | UBS Europe SE            |
| HUF             | 600.000.000       | USD            | 2.109.117        | 21/07/2021           | (82.407)              | UBS Europe SE            |
| USD             | 1.106.901         | RON            | 4.500.000        | 21/07/2021           | 23.834                | UBS Europe SE            |
| USD             | 1.115.012         | ZAR            | 16.000.000       | 21/07/2021           | (2.906)               | UBS Europe SE            |
| USD             | 213.574           | CZK            | 4.500.000        | 16/08/2021           | 4.411                 | UBS Europe SE            |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>(283.202)</b>      |                          |

#### Candriam Bonds Euro

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte      |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|------------------|
| NOK             | 55.000.000        | EUR            | 5.402.396        | 21/07/2021           | (14.418)              | Société Générale |
| EUR             | 5.346.419         | NOK            | 55.000.000       | 21/07/2021           | (41.571)              | UBS Europe SE    |
| EUR             | 7.004.024         | USD            | 8.500.000        | 21/07/2021           | (160.752)             | UBS Europe SE    |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>(216.741)</b>      |                  |

#### Candriam Bonds Euro Corporate

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte               |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|---------------------------|
| EUR             | 36.986.729        | USD            | 45.000.000       | 15/07/2021           | (948.999)             | Barclays Bank Ireland Plc |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>(948.999)</b>      |                           |

# Candriam Bonds

## Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

### Contratos de cambio a plazo

#### Candriam Bonds Euro Diversified

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte      |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|------------------|
| NOK             | 64.124.951        | EUR            | 6.300.000        | 21/07/2021           | (18.111)              | Société Générale |
| EUR             | 6.300.000         | NOK            | 64.803.860       | 21/07/2021           | (48.411)              | UBS Europe SE    |
| EUR             | 10.716.020        | USD            | 13.000.000       | 21/07/2021           | (241.872)             | UBS Europe SE    |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>(308.394)</b>      |                  |

#### Candriam Bonds Euro Government

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte    |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|----------------|
| EUR             | 824.009           | USD            | 1.000.000        | 21/07/2021           | (18.906)              | J.P. Morgan AG |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>(18.906)</b>       |                |

#### Candriam Bonds Euro High Yield

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte               |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|---------------------------|
| EUR             | 167.779.548       | USD            | 199.999.999      | 30/07/2021           | (771.469)             | Barclays Bank Ireland Plc |
| CHF             | 10.173.818        | EUR            | 9.349.738        | 15/07/2021           | (68.074)              | CACEIS Bank, Lux. Branch  |
| EUR             | 2.069.025         | USD            | 2.475.762        | 15/07/2021           | (18.073)              | CACEIS Bank, Lux. Branch  |
| EUR             | 19.702            | CHF            | 21.535           | 15/07/2021           | 55                    | CACEIS Bank, Lux. Branch  |
| GBP             | 1.120.626         | EUR            | 1.306.325        | 15/07/2021           | (1.223)               | CACEIS Bank, Lux. Branch  |
| USD             | 77.551.128        | EUR            | 64.002.435       | 15/07/2021           | 1.373.974             | CACEIS Bank, Lux. Branch  |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>515.190</b>        |                           |

#### Candriam Bonds Euro Long Term

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte      |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|------------------|
| NOK             | 10.000.000        | EUR            | 982.233          | 21/07/2021           | (2.600)               | Société Générale |
| EUR             | 972.076           | NOK            | 10.000.000       | 21/07/2021           | (7.558)               | UBS Europe SE    |
| EUR             | 593.287           | USD            | 720.000          | 21/07/2021           | (13.612)              | UBS Europe SE    |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>(23.770)</b>       |                  |

#### Candriam Bonds Euro Short Term

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte    |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|----------------|
| USD             | 3.500.000         | EUR            | 2.933.641        | 14/07/2021           | 16.956                | J.P. Morgan AG |
| EUR             | 82.426.369        | USD            | 100.000.000      | 14/07/2021           | (1.876.864)           | UBS Europe SE  |
| USD             | 11.300.000        | EUR            | 9.504.391        | 14/07/2021           | 21.821                | UBS Europe SE  |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>(1.838.087)</b>    |                |

#### Candriam Bonds Floating Rate Notes

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte   |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|---------------|
| EUR             | 92.943.885        | USD            | 113.567.000      | 07/07/2021           | (2.810.437)           | UBS Europe SE |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>(2.810.437)</b>    |               |

#### Candriam Bonds Global Government

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte               |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|---------------------------|
| EUR             | 133.281           | GBP            | 114.500          | 06/07/2021           | (90)                  | Barclays Bank Ireland Plc |
| JPY             | 1.155.440         | EUR            | 8.659            | 06/07/2021           | 118                   | Barclays Bank Ireland Plc |
| GBP             | 500.000           | EUR            | 580.164          | 21/07/2021           | 2.085                 | Barclays Bank Ireland Plc |
| CAD             | 1.000             | EUR            | 679              | 06/07/2021           | 2                     | BNP Paribas Paris         |
| EUR             | 4.259             | SEK            | 43.000           | 06/07/2021           | 20                    | BNP Paribas Paris         |
| EUR             | 781.579           | USD            | 948.000          | 06/07/2021           | (17.746)              | BNP Paribas Paris         |
| GBP             | 118.385           | EUR            | 137.594          | 06/07/2021           | 301                   | BNP Paribas Paris         |

## Candriam Bonds

### Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

#### Contratos de cambio a plazo

##### Candriam Bonds Global Government

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte                      |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------------|
| JPY             | 44.302.125        | EUR            | 336.800          | 06/07/2021           | (235)                 | BNP Paribas Paris                |
| USD             | 12.500            | EUR            | 10.463           | 06/07/2021           | 76                    | BNP Paribas Paris                |
| AUD             | 52.275            | EUR            | 32.995           | 06/07/2021           | 96                    | J.P. Morgan AG                   |
| CAD             | 75.486            | EUR            | 51.177           | 06/07/2021           | 222                   | J.P. Morgan AG                   |
| EUR             | 14.835            | CAD            | 21.896           | 04/08/2021           | (65)                  | J.P. Morgan AG                   |
| NOK             | 26.500.000        | EUR            | 2.624.563        | 18/08/2021           | (29.635)              | J.P. Morgan AG                   |
| AUD             | 1.335             | EUR            | 849              | 06/07/2021           | (4)                   | Nomura Financial Products Europe |
| EUR             | 1.817             | SEK            | 18.398           | 06/07/2021           | 3                     | Société Générale                 |
| EUR             | 330.261           | JPY            | 44.050.000       | 06/07/2021           | (4.388)               | Société Générale                 |
| EUR             | 33.103            | AUD            | 52.000           | 06/07/2021           | 186                   | Société Générale                 |
| EUR             | 36.691            | CAD            | 54.000           | 06/07/2021           | (78)                  | Société Générale                 |
| SEK             | 17.868            | EUR            | 1.765            | 06/07/2021           | (3)                   | Société Générale                 |
| EUR             | 1.764             | SEK            | 17.868           | 04/08/2021           | 3                     | Société Générale                 |
| EUR             | 380.128           | JPY            | 50.000.000       | 02/07/2021           | 255                   | UBS Europe SE                    |
| AUD             | 21.375            | EUR            | 13.499           | 06/07/2021           | 32                    | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 146.240           | JPY            | 19.572.733       | 06/07/2021           | (2.454)               | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 14.567            | AUD            | 22.983           | 06/07/2021           | 19                    | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 15.247            | CAD            | 22.486           | 06/07/2021           | (64)                  | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 58.374            | GBP            | 50.301           | 06/07/2021           | (216)                 | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 333.755           | USD            | 407.619          | 06/07/2021           | (9.937)               | UBS Europe SE                    |
| JPY             | 18.165.168        | EUR            | 138.193          | 06/07/2021           | (192)                 | UBS Europe SE                    |
| SEK             | 43.530            | EUR            | 4.289            | 06/07/2021           | 2                     | UBS Europe SE                    |
| USD             | 1.343.120         | EUR            | 1.128.092        | 06/07/2021           | 4.385                 | UBS Europe SE                    |
| JPY             | 40.000.000        | EUR            | 299.446          | 21/07/2021           | 4.379                 | UBS Europe SE                    |
| USD             | 5.500.000         | EUR            | 4.533.697        | 21/07/2021           | 102.294               | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 324.348           | USD            | 385.875          | 04/08/2021           | (817)                 | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 13.493            | AUD            | 21.375           | 04/08/2021           | (32)                  | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 138.147           | JPY            | 18.165.168       | 04/08/2021           | 193                   | UBS Europe SE                    |
| MXN             | 31.430.000        | USD            | 1.565.687        | 18/08/2021           | 3.285                 | UBS Europe SE                    |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>52.000</b>         |                                  |

##### Candriam Bonds Global High Yield

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte               |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|---------------------------|
| EUR             | 1.749.222         | GBP            | 1.500.000        | 30/07/2021           | 2.753                 | Barclays Bank Ireland Plc |
| EUR             | 209.721.982       | USD            | 249.999.999      | 30/07/2021           | (966.790)             | Barclays Bank Ireland Plc |
| EUR             | 9.230             | GBP            | 7.929            | 15/07/2021           | (4)                   | CACEIS Bank, Lux. Branch  |
| GBP             | 276.464           | EUR            | 322.264          | 15/07/2021           | (289)                 | CACEIS Bank, Lux. Branch  |
| USD             | 1.827             | EUR            | 1.508            | 15/07/2021           | 32                    | CACEIS Bank, Lux. Branch  |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>(964.298)</b>      |                           |

##### Candriam Bonds Global Inflation Short Duration

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte               |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|---------------------------|
| EUR             | 1.011.854         | NZD            | 1.700.000        | 13/07/2021           | 10.415                | Barclays Bank Ireland Plc |
| EUR             | 142.870.647       | USD            | 175.000.000      | 13/07/2021           | (4.663.270)           | Barclays Bank Ireland Plc |
| EUR             | 840.267           | DKK            | 6.250.000        | 13/07/2021           | (188)                 | Barclays Bank Ireland Plc |
| EUR             | 1.694.587         | CAD            | 2.500.000        | 13/07/2021           | (7.426)               | Barclays Bank Ireland Plc |
| EUR             | 1.394.652         | GBP            | 1.200.000        | 13/07/2021           | (2.941)               | Barclays Bank Ireland Plc |
| NOK             | 24.550.000        | EUR            | 2.407.011        | 13/07/2021           | (1.720)               | Barclays Bank Ireland Plc |
| EUR             | 2.920.869         | GBP            | 2.500.000        | 21/07/2021           | 9.630                 | Barclays Bank Ireland Plc |
| EUR             | 573.206           | SEK            | 5.800.000        | 21/07/2021           | 1.448                 | Barclays Bank Ireland Plc |
| NZD             | 4.200.000         | AUD            | 3.951.476        | 21/07/2021           | (27.035)              | Barclays Bank Ireland Plc |
| CAD             | 400.000           | USD            | 332.607          | 13/07/2021           | (8.083)               | BNP Paribas Paris         |
| EUR             | 2.617.309         | MXN            | 64.000.000       | 13/07/2021           | (89.038)              | BNP Paribas Paris         |
| MXN             | 64.000.000        | EUR            | 2.707.745        | 13/07/2021           | (1.535)               | BNP Paribas Paris         |
| USD             | 9.100.000         | EUR            | 7.492.202        | 13/07/2021           | 179.505               | BNP Paribas Paris         |

## Candriam Bonds

### Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

#### Contratos de cambio a plazo

##### Candriam Bonds Global Inflation Short Duration

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte                      |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------------|
| EUR             | 198.479           | NOK            | 2.000.000        | 21/07/2021           | 2.553                 | BNP Paribas Paris                |
| MXN             | 13.000.000        | USD            | 655.972          | 21/07/2021           | (3.840)               | BNP Paribas Paris                |
| EUR             | 2.683.051         | MXN            | 64.000.000       | 15/09/2021           | 1.610                 | BNP Paribas Paris                |
| CAD             | 2.200.000         | EUR            | 1.489.867        | 13/07/2021           | 7.903                 | J.P. Morgan AG                   |
| DKK             | 6.250.000         | EUR            | 840.469          | 13/07/2021           | (14)                  | J.P. Morgan AG                   |
| EUR             | 67.889            | CAD            | 100.000          | 13/07/2021           | (191)                 | J.P. Morgan AG                   |
| GBP             | 18.360.000        | EUR            | 21.366.482       | 13/07/2021           | 16.668                | J.P. Morgan AG                   |
| JPY             | 1.270.000.000     | EUR            | 9.667.013        | 13/07/2021           | (19.645)              | J.P. Morgan AG                   |
| USD             | 182.532.607       | EUR            | 153.519.353      | 13/07/2021           | 363.806               | J.P. Morgan AG                   |
| AUD             | 3.911.905         | NZD            | 4.200.000        | 21/07/2021           | 1.985                 | J.P. Morgan AG                   |
| MXN             | 51.000.000        | USD            | 2.564.531        | 21/07/2021           | (7.562)               | J.P. Morgan AG                   |
| NOK             | 24.550.000        | AUD            | 3.786.036        | 21/07/2021           | 8.965                 | J.P. Morgan AG                   |
| EUR             | 9.434.957         | JPY            | 1.240.000.000    | 15/09/2021           | 22.490                | J.P. Morgan AG                   |
| EUR             | 840.415           | DKK            | 6.250.000        | 15/09/2021           | 13                    | J.P. Morgan AG                   |
| EUR             | 21.341.727        | GBP            | 18.360.000       | 15/09/2021           | (16.640)              | J.P. Morgan AG                   |
| EUR             | 153.323.976       | USD            | 182.532.607      | 15/09/2021           | (361.712)             | J.P. Morgan AG                   |
| EUR             | 1.487.927         | CAD            | 2.200.000        | 15/09/2021           | (7.904)               | J.P. Morgan AG                   |
| EUR             | 8.205.816         | JPY            | 1.100.000.000    | 13/07/2021           | (150.193)             | Nomura Financial Products Europe |
| NZD             | 1.700.000         | EUR            | 997.744          | 13/07/2021           | 3.698                 | Nomura Financial Products Europe |
| EUR             | 996.264           | NZD            | 1.700.000        | 15/09/2021           | (3.688)               | Nomura Financial Products Europe |
| EUR             | 1.058.856         | SEK            | 10.730.000       | 13/07/2021           | 1.009                 | Société Générale                 |
| EUR             | 2.405.786         | NOK            | 24.550.000       | 13/07/2021           | 495                   | Société Générale                 |
| EUR             | 1.901.410         | AUD            | 3.000.000        | 13/07/2021           | 2.598                 | Société Générale                 |
| EUR             | 20.330.327        | GBP            | 17.500.000       | 13/07/2021           | (51.225)              | Société Générale                 |
| GBP             | 500.000           | EUR            | 581.777          | 13/07/2021           | 553                   | Société Générale                 |
| USD             | 150.047           | MXN            | 3.000.000        | 21/07/2021           | (237)                 | Société Générale                 |
| USD             | 450.000           | EUR            | 370.891          | 21/07/2021           | 8.417                 | Société Générale                 |
| NOK             | 24.550.000        | EUR            | 2.403.419        | 15/09/2021           | (626)                 | Société Générale                 |
| AUD             | 3.315.000         | EUR            | 2.091.154        | 13/07/2021           | 7.034                 | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 1.273.484         | JPY            | 170.000.000      | 13/07/2021           | (17.899)              | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 13.947.406        | USD            | 17.000.000       | 13/07/2021           | (384.444)             | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 200.284           | AUD            | 315.000          | 13/07/2021           | 909                   | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 186.000           | GBP            | 160.000          | 13/07/2021           | (345)                 | UBS Europe SE                    |
| SEK             | 10.730.000        | EUR            | 1.059.297        | 13/07/2021           | (1.451)               | UBS Europe SE                    |
| AUD             | 3.909.468         | NZD            | 4.200.000        | 21/07/2021           | 442                   | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 299.380           | JPY            | 40.000.000       | 21/07/2021           | (4.447)               | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 8.032.666         | USD            | 9.638.907        | 21/07/2021           | (92.076)              | UBS Europe SE                    |
| GBP             | 750.000           | EUR            | 876.265          | 21/07/2021           | (2.893)               | UBS Europe SE                    |
| JPY             | 30.000.000        | EUR            | 226.681          | 21/07/2021           | 1.188                 | UBS Europe SE                    |
| NOK             | 5.450.000         | EUR            | 540.264          | 21/07/2021           | (6.364)               | UBS Europe SE                    |
| NZD             | 4.200.000         | USD            | 3.060.301        | 21/07/2021           | (105.882)             | UBS Europe SE                    |
| USD             | 7.000.000         | EUR            | 5.864.762        | 21/07/2021           | 35.590                | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 2.089.013         | AUD            | 3.315.000        | 15/09/2021           | (7.028)               | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 1.058.544         | SEK            | 10.730.000       | 15/09/2021           | 1.451                 | UBS Europe SE                    |
|                 |                   |                |                  |                      | (5.357.167)           |                                  |

##### Candriam Bonds International

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte                      |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------------|
| JPY             | 45.000.000        | EUR            | 341.532          | 09/07/2021           | 320                   | Barclays Bank Ireland Plc        |
| SEK             | 12.100.000        | EUR            | 1.201.234        | 09/07/2021           | (8.269)               | Barclays Bank Ireland Plc        |
| USD             | 300.000           | EUR            | 245.002          | 09/07/2021           | 7.932                 | Barclays Bank Ireland Plc        |
| NZD             | 1.900.000         | AUD            | 1.789.502        | 09/07/2021           | (13.354)              | BNP Paribas Paris                |
| EUR             | 13.440.755        | JPY            | 1.800.000.000    | 09/07/2021           | (233.339)             | J.P. Morgan AG                   |
| AUD             | 300.000           | EUR            | 189.525          | 09/07/2021           | 367                   | Nomura Financial Products Europe |
| AUD             | 1.769.272         | NZD            | 1.900.000        | 09/07/2021           | 547                   | Nomura Financial Products Europe |
| EUR             | 5.411.025         | GBP            | 4.700.000        | 09/07/2021           | (63.266)              | Société Générale                 |

# Candriam Bonds

## Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

### Contratos de cambio a plazo

#### Candriam Bonds International

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte      |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|------------------|
| EUR             | 1.187.992         | SEK            | 12.100.000       | 09/07/2021           | (4.973)               | Société Générale |
| EUR             | 356.305           | DKK            | 2.650.000        | 09/07/2021           | (50)                  | Société Générale |
| EUR             | 309.969           | CHF            | 340.000          | 09/07/2021           | (205)                 | Société Générale |
| EUR             | 7.377.367         | CNH            | 57.880.000       | 09/07/2021           | (171.753)             | Société Générale |
| GBP             | 210.000           | EUR            | 244.216          | 09/07/2021           | 379                   | Société Générale |
| JPY             | 212.500.000       | EUR            | 1.594.018        | 09/07/2021           | 20.282                | Société Générale |
| JPY             | 10.000.000        | GBP            | 64.345           | 09/07/2021           | 1.022                 | Société Générale |
| EUR             | 1.821.211         | CAD            | 2.700.000        | 09/07/2021           | (17.115)              | UBS Europe SE    |
| EUR             | 59.012            | MXN            | 1.430.000        | 09/07/2021           | (1.490)               | UBS Europe SE    |
| EUR             | 386.152           | NZD            | 650.000          | 09/07/2021           | 3.214                 | UBS Europe SE    |
| EUR             | 1.185.805         | AUD            | 1.850.000        | 09/07/2021           | 14.802                | UBS Europe SE    |
| EUR             | 33.025.350        | USD            | 39.766.000       | 09/07/2021           | (501.975)             | UBS Europe SE    |
| GBP             | 120.000           | EUR            | 139.929          | 09/07/2021           | (161)                 | UBS Europe SE    |
| MXN             | 1.000.000         | EUR            | 40.725           | 09/07/2021           | 1.584                 | UBS Europe SE    |
| NOK             | 11.400.000        | EUR            | 1.137.384        | 09/07/2021           | (20.398)              | UBS Europe SE    |
| USD             | 1.750.000         | EUR            | 1.437.450        | 09/07/2021           | 37.999                | UBS Europe SE    |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>(947.900)</b>      |                  |

#### Candriam Bonds Total Return

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte                      |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|----------------------------------|
| EUR             | 981.173           | CHF            | 1.075.000        | 29/09/2021           | (5)                   | Barclays Bank Ireland Plc        |
| EUR             | 163.588.442       | USD            | 198.800.000      | 29/09/2021           | (3.750.682)           | Barclays Bank Ireland Plc        |
| MXN             | 117.750.000       | EUR            | 4.807.878        | 29/09/2021           | 115.151               | Barclays Bank Ireland Plc        |
| EUR             | 16.803.422        | USD            | 20.500.000       | 29/09/2021           | (452.492)             | BNP Paribas Paris                |
| EUR             | 7.302.278         | CNH            | 57.600.000       | 29/09/2021           | (156.350)             | BNP Paribas Paris                |
| EUR             | 21.115            | JPY            | 2.800.000        | 29/09/2021           | (136)                 | BNP Paribas Paris                |
| EUR             | 14.447.875        | CAD            | 21.300.000       | 29/09/2021           | (30.120)              | BNP Paribas Paris                |
| NOK             | 6.500.000         | EUR            | 637.417          | 29/09/2021           | (1.424)               | BNP Paribas Paris                |
| SEK             | 98.626.127        | NOK            | 99.000.000       | 29/09/2021           | 28.228                | BNP Paribas Paris                |
| USD             | 3.500.000         | EUR            | 2.875.593        | 29/09/2021           | 70.398                | BNP Paribas Paris                |
| USD             | 18.072.250        | CNH            | 116.000.000      | 29/09/2021           | 194.865               | BNP Paribas Paris                |
| EUR             | 279.374           | USD            | 340.650          | 15/07/2021           | (7.799)               | CACEIS Bank, Lux. Branch         |
| EUR             | 641.385           | GBP            | 552.201          | 15/07/2021           | (1.719)               | CACEIS Bank, Lux. Branch         |
| GBP             | 127.396.274       | EUR            | 148.505.826      | 15/07/2021           | (137.716)             | CACEIS Bank, Lux. Branch         |
| USD             | 13.931.243        | EUR            | 11.497.258       | 15/07/2021           | 246.925               | CACEIS Bank, Lux. Branch         |
| NZD             | 28.500.000        | AUD            | 26.799.164       | 29/09/2021           | (183.078)             | J.P. Morgan AG                   |
| RUB             | 414.000.000       | USD            | 5.650.047        | 29/09/2021           | (43.321)              | J.P. Morgan AG                   |
| USD             | 8.432.689         | MXN            | 175.000.000      | 29/09/2021           | (221.527)             | J.P. Morgan AG                   |
| KRW             | 13.300.000.000    | USD            | 11.719.223       | 29/09/2021           | 39.962                | Nomura Financial Products Europe |
| USD             | 543.038           | NZD            | 750.000          | 29/09/2021           | 16.117                | Nomura Financial Products Europe |
| USD             | 7.900.000         | EUR            | 6.595.810        | 29/09/2021           | 53.714                | Nomura Financial Products Europe |
| EUR             | 1.418.992         | GBP            | 1.225.000        | 29/09/2021           | (5.701)               | Société Générale                 |
| MXN             | 175.000.000       | USD            | 8.738.549        | 29/09/2021           | (38.810)              | Société Générale                 |
| NOK             | 236.075.579       | USD            | 28.328.704       | 29/09/2021           | (747.137)             | Société Générale                 |
| NOK             | 98.250.000        | EUR            | 9.619.494        | 29/09/2021           | (6.218)               | Société Générale                 |
| SEK             | 100.800.000       | EUR            | 9.925.417        | 29/09/2021           | 3.558                 | Société Générale                 |
| SEK             | 4.966.713         | NOK            | 5.000.000        | 29/09/2021           | 5                     | Société Générale                 |
| USD             | 17.325.000        | EUR            | 14.475.826       | 29/09/2021           | 106.833               | Société Générale                 |
| USD             | 597.787           | SEK            | 4.970.950        | 29/09/2021           | 13.530                | Société Générale                 |
| AUD             | 26.000.000        | NZD            | 28.108.600       | 29/09/2021           | (92.418)              | UBS Europe SE                    |
| CNH             | 114.500.000       | USD            | 17.759.923       | 29/09/2021           | (124.832)             | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 17.144.394        | AUD            | 26.900.000       | 29/09/2021           | 140.112               | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 31.441.088        | NOK            | 316.775.000      | 29/09/2021           | 446.897               | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 20.388.770        | SEK            | 207.000.000      | 29/09/2021           | (1.090)               | UBS Europe SE                    |
| EUR             | 140.234.461       | USD            | 170.000.000      | 29/09/2021           | (2.861.749)           | UBS Europe SE                    |
| NZD             | 375.000           | EUR            | 222.331          | 29/09/2021           | (1.832)               | UBS Europe SE                    |

## Candriam Bonds

---

### Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

#### Contratos de cambio a plazo

##### Candriam Bonds Total Return

| Moneda<br>comprada | Cantidad<br>comprada | Moneda<br>vendida | Cantidad<br>vendida | Fecha de<br>vencimiento | No realizado<br>(en EUR) | Contraparte   |
|--------------------|----------------------|-------------------|---------------------|-------------------------|--------------------------|---------------|
| NZD                | 250.000              | USD               | 179.502             | 29/09/2021              | (4.097)                  | UBS Europe SE |
| USD                | 37.329.509           | CHF               | 34.050.000          | 29/09/2021              | 342.255                  | UBS Europe SE |
| USD                | 20.500.000           | EUR               | 16.891.669          | 29/09/2021              | 363.425                  | UBS Europe SE |
|                    |                      |                   |                     |                         | <b>(6.688.278)</b>       |               |

Consulte la Nota 12 para las Garantías recibidas/emitidas en relación con los contratos a plazo sobre divisas. Estas operaciones sobre contratos a plazo sobre divisas se asignan principalmente a las clases de acciones cubiertas contra el riesgo cambiario.

## Candriam Bonds

### Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

#### Non-Deliverable Forwards ("NDF")

A 30 de junio de 2021, estaban pendientes los siguientes contratos a plazo no entregables:

##### Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en USD) | Contraparte       |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| IDR             | 80.000.000.000    | USD            | 5.179.277        | 01/07/2021           | 337.963               | BNP Paribas Paris |
| USD             | 5.610.551         | IDR            | 80.000.000.000   | 01/07/2021           | 93.307                | BNP Paribas Paris |
| BRL             | 26.000.000        | USD            | 5.190.476        | 21/07/2021           | (18.988)              | BNP Paribas Paris |
| USD             | 2.671.109         | COP            | 10.000.000.000   | 21/07/2021           | (4.519)               | BNP Paribas Paris |
| CLP             | 3.000.000.000     | USD            | 4.109.364        | 21/07/2021           | 8.738                 | J.P. Morgan AG    |
| USD             | 7.625.245         | PEN            | 30.000.000       | 21/07/2021           | (215.151)             | J.P. Morgan AG    |
| USD             | 2.675.034         | COP            | 10.000.000.000   | 21/07/2021           | (589)                 | UBS Europe SE     |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>200.761</b>        |                   |

##### Candriam Bonds Emerging Markets

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en USD) | Contraparte   |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|---------------|
| USD             | 32.902.920        | COP            | 123.000.000.000  | 21/07/2021           | (7.250)               | UBS Europe SE |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>(7.250)</b>        |               |

##### Candriam Bonds Emerging Markets Total Return

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en USD) | Contraparte       |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| BRL             | 7.000.000         | USD            | 1.323.133        | 21/07/2021           | 69.190                | BNP Paribas Paris |
| USD             | 1.380.637         | BRL            | 7.000.000        | 21/07/2021           | (11.707)              | BNP Paribas Paris |
| USD             | 1.343.905         | INR            | 100.000.000      | 22/07/2021           | 1.793                 | Société Générale  |
| USD             | 1.337.517         | COP            | 5.000.000.000    | 21/07/2021           | (295)                 | UBS Europe SE     |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>58.981</b>         |                   |

##### Candriam Bonds Total Return

| Moneda comprada | Cantidad comprada | Moneda vendida | Cantidad vendida | Fecha de vencimiento | No realizado (en EUR) | Contraparte       |
|-----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| KRW             | 10.000.000.000    | USD            | 8.905.891        | 29/09/2021           | (49.594)              | BNP Paribas Paris |
| BRL             | 59.500.000        | USD            | 11.479.302       | 29/09/2021           | 214.605               | UBS Europe SE     |
| USD             | 6.058.100         | BRL            | 31.000.000       | 29/09/2021           | (47.121)              | UBS Europe SE     |
|                 |                   |                |                  |                      | <b>117.890</b>        |                   |

Consulte la Nota 12 para las Garantías recibidas/emitidas en relación con los contratos a NDF.

# Candriam Bonds

## Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

### Futuros

Al 30 de junio de 2021, los siguientes contratos futuros estaban pendientes:

#### Candriam Bonds Capital Securities

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación              | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en EUR) | Contraparte    |
|-----------------------------------|---------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                           |        |                                               |                          |                |
| (11)                              | EURO BUND FUTURE 09/21    | EUR    | 1.130.432                                     | (11.330)                 | J.P. Morgan AG |
| (16)                              | US 10 YEARS NOTE 09/21    | USD    | 1.497.808                                     | (7.927)                  | J.P. Morgan AG |
| (5)                               | US 5 YEARS NOTE-CBT 09/21 | USD    | 413.946                                       | (1.416)                  | J.P. Morgan AG |
|                                   |                           |        |                                               | <b>(20.673)</b>          |                |

#### Candriam Bonds Convertible Defensive

| Cantidad<br>(comprada/(vendida)) | Denominación           | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en EUR) | Contraparte    |
|----------------------------------|------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre indice</b>      |                        |        |                                               |                          |                |
| (150)                            | DJ EURO STOXX 50 09/21 | EUR    | 6.096.450                                     | 114.375                  | J.P. Morgan AG |
|                                  |                        |        |                                               | <b>114.375</b>           |                |

#### Candriam Bonds Credit Alpha

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación               | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en EUR) | Contraparte    |
|-----------------------------------|----------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                            |        |                                               |                          |                |
| 140                               | EURO BUND FUTURE 09/21     | EUR    | 14.387.310                                    | 248.581                  | J.P. Morgan AG |
| (152)                             | EURO-OAT-FUTURES-EUX 09/21 | EUR    | 18.659.292                                    | (215.430)                | J.P. Morgan AG |
|                                   |                            |        |                                               | <b>33.151</b>            |                |

#### Candriam Bonds Credit Opportunities

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación               | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en EUR) | Contraparte    |
|-----------------------------------|----------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                            |        |                                               |                          |                |
| 849                               | EURO BUND FUTURE 09/21     | EUR    | 87.248.786                                    | 1.254.396                | J.P. Morgan AG |
| (1.005)                           | EURO-OAT-FUTURES-EUX 09/21 | EUR    | 123.372.293                                   | (1.386.671)              | J.P. Morgan AG |
|                                   |                            |        |                                               | <b>(132.275)</b>         |                |

#### Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación               | Moneda | Compromiso<br>(en USD)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en USD) | Contraparte    |
|-----------------------------------|----------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                            |        |                                               |                          |                |
| (37)                              | EURO BUND FUTURE 09/21     | EUR    | 4.509.219                                     | (37.735)                 | J.P. Morgan AG |
| (97)                              | US 10 YEARS NOTE 09/21     | USD    | 10.768.516                                    | (39.406)                 | J.P. Morgan AG |
| (65)                              | US 10YR ULTRA (CBOT) 09/21 | USD    | 6.305.000                                     | (119.438)                | J.P. Morgan AG |
| (204)                             | US 5 YEARS NOTE-CBT 09/21  | USD    | 20.028.656                                    | 37.656                   | J.P. Morgan AG |
| (35)                              | US ULTRA BD CBT 30YR 09/21 | USD    | 4.143.672                                     | (215.469)                | J.P. Morgan AG |
|                                   |                            |        |                                               | <b>(374.392)</b>         |                |

#### Candriam Bonds Emerging Markets

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación               | Moneda | Compromiso<br>(en USD)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en USD) | Contraparte    |
|-----------------------------------|----------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                            |        |                                               |                          |                |
| (100)                             | EURO BUND FUTURE 09/21     | EUR    | 12.187.079                                    | (104.359)                | J.P. Morgan AG |
| (1.650)                           | US 10YR ULTRA (CBOT) 09/21 | USD    | 160.050.000                                   | (4.201.467)              | J.P. Morgan AG |
|                                   |                            |        |                                               | <b>(4.305.826)</b>       |                |

# Candriam Bonds

## Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

### Futuros

#### Candriam Bonds Emerging Markets Corporate

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación               | Moneda | Compromiso<br>(en USD)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en USD) | Contraparte    |
|-----------------------------------|----------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                            |        |                                               |                          |                |
| (80)                              | US 10YR ULTRA (CBOT) 09/21 | USD    | 7.760.000                                     | (201.250)                | J.P. Morgan AG |
| 120                               | US 2 YEARS NOTE- CBT 09/21 | USD    | 25.738.187                                    | (46.312)                 | J.P. Morgan AG |
| 15                                | US ULTRA BD CBT 30YR 09/21 | USD    | 1.775.859                                     | 122.812                  | J.P. Morgan AG |
|                                   |                            |        |                                               | <b>(124.750)</b>         |                |

#### Candriam Bonds Emerging Markets Total Return

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación               | Moneda | Compromiso<br>(en USD)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en USD) | Contraparte    |
|-----------------------------------|----------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                            |        |                                               |                          |                |
| (19)                              | EURO BUND FUTURE 09/21     | EUR    | 2.315.454                                     | (27.039)                 | J.P. Morgan AG |
| (100)                             | US 10YR ULTRA (CBOT) 09/21 | USD    | 9.700.000                                     | (250.856)                | J.P. Morgan AG |
|                                   |                            |        |                                               | <b>(277.895)</b>         |                |

#### Candriam Bonds Euro

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación               | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en EUR) | Contraparte    |
|-----------------------------------|----------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                            |        |                                               |                          |                |
| 2                                 | EURO BOBL FUTURE 09/21     | EUR    | 205.722                                       | 140                      | J.P. Morgan AG |
| 17                                | EURO BTP FUTURE -EUX 09/21 | EUR    | 1.801.210                                     | 18.020                   | J.P. Morgan AG |
| (12)                              | EURO BUND FUTURE 09/21     | EUR    | 1.233.198                                     | (1.441)                  | J.P. Morgan AG |
| (7)                               | EURO BUXL FUTURE 09/21     | EUR    | 1.095.472                                     | (24.500)                 | J.P. Morgan AG |
| (179)                             | EURO-OAT-FUTURES-EUX 09/21 | EUR    | 21.973.772                                    | (127.247)                | J.P. Morgan AG |
| 148                               | EURO SCHATZ FUTURE 09/21   | EUR    | 14.994.916                                    | (2.960)                  | J.P. Morgan AG |
| 94                                | US 10 YEARS NOTE 09/21     | USD    | 8.799.619                                     | (9.908)                  | J.P. Morgan AG |
| (124)                             | US 10YR ULTRA (CBOT) 09/21 | USD    | 10.142.508                                    | (210.104)                | J.P. Morgan AG |
| (350)                             | US 5 YEARS NOTE-CBT 09/21  | USD    | 28.976.213                                    | 127.000                  | J.P. Morgan AG |
|                                   |                            |        |                                               | <b>(231.000)</b>         |                |

#### Candriam Bonds Euro Corporate

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación               | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en EUR) | Contraparte    |
|-----------------------------------|----------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                            |        |                                               |                          |                |
| (28)                              | EURO BOBL FUTURE 09/21     | EUR    | 2.880.108                                     | (3.080)                  | J.P. Morgan AG |
| 531                               | EURO BUND FUTURE 09/21     | EUR    | 54.569.012                                    | 350.160                  | J.P. Morgan AG |
| (243)                             | EURO-OAT-FUTURES-EUX 09/21 | EUR    | 29.830.316                                    | (167.862)                | J.P. Morgan AG |
| (154)                             | US 10 YEARS NOTE 09/21     | USD    | 14.416.398                                    | (55.628)                 | J.P. Morgan AG |
| (100)                             | US 5 YEARS NOTE-CBT 09/21  | USD    | 8.278.918                                     | (38.868)                 | J.P. Morgan AG |
|                                   |                            |        |                                               | <b>84.722</b>            |                |

#### Candriam Bonds Euro Diversified

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación               | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en EUR) | Contraparte    |
|-----------------------------------|----------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                            |        |                                               |                          |                |
| 19                                | EURO BOBL FUTURE 09/21     | EUR    | 1.954.359                                     | 1.330                    | J.P. Morgan AG |
| 93                                | EURO BTP FUTURE -EUX 09/21 | EUR    | 9.853.676                                     | 77.780                   | J.P. Morgan AG |
| (200)                             | EURO BUND FUTURE 09/21     | EUR    | 20.553.300                                    | (69.135)                 | J.P. Morgan AG |
| (38)                              | EURO BUXL FUTURE 09/21     | EUR    | 5.946.848                                     | (133.000)                | J.P. Morgan AG |
| (110)                             | EURO-OAT-FUTURES-EUX 09/21 | EUR    | 13.503.435                                    | (78.196)                 | J.P. Morgan AG |
| 61                                | EURO SCHATZ FUTURE 09/21   | EUR    | 6.180.337                                     | (1.220)                  | J.P. Morgan AG |
| (110)                             | US 10YR ULTRA (CBOT) 09/21 | USD    | 8.997.386                                     | (186.383)                | J.P. Morgan AG |
| (310)                             | US 5 YEARS NOTE-CBT 09/21  | USD    | 25.664.646                                    | 112.404                  | J.P. Morgan AG |
|                                   |                            |        |                                               | <b>(276.420)</b>         |                |

# Candriam Bonds

## Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

### Futuros

#### Candriam Bonds Euro Government

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación               | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en EUR) | Contraparte    |
|-----------------------------------|----------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                            |        |                                               |                          |                |
| 83                                | EURO BOBL FUTURE 09/21     | EUR    | 8.537.463                                     | 5.810                    | J.P. Morgan AG |
| 26                                | EURO BTP FUTURE -EUX 09/21 | EUR    | 2.754.791                                     | 27.560                   | J.P. Morgan AG |
| 9                                 | EURO BUND FUTURE 09/21     | EUR    | 924.899                                       | 9.540                    | J.P. Morgan AG |
| (62)                              | EURO BUXL FUTURE 09/21     | EUR    | 9.702.752                                     | (217.000)                | J.P. Morgan AG |
| (307)                             | EURO-OAT-FUTURES-EUX 09/21 | EUR    | 37.686.860                                    | (218.239)                | J.P. Morgan AG |
| 225                               | EURO SCHATZ FUTURE 09/21   | EUR    | 22.796.325                                    | (4.500)                  | J.P. Morgan AG |
| 150                               | US 10 YEARS NOTE 09/21     | USD    | 14.041.946                                    | (15.811)                 | J.P. Morgan AG |
| (179)                             | US 10YR ULTRA (CBOT) 09/21 | USD    | 14.641.201                                    | (303.295)                | J.P. Morgan AG |
| (473)                             | US 5 YEARS NOTE-CBT 09/21  | USD    | 39.159.282                                    | 171.582                  | J.P. Morgan AG |
|                                   |                            |        |                                               | <b>(544.353)</b>         |                |

#### Candriam Bonds Euro High Yield

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación               | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en EUR) | Contraparte    |
|-----------------------------------|----------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                            |        |                                               |                          |                |
| 1.910                             | EURO BUND FUTURE 09/21     | EUR    | 196.284.015                                   | 3.643.280                | J.P. Morgan AG |
| (2.577)                           | EURO-OAT-FUTURES-EUX 09/21 | EUR    | 316.348.654                                   | (5.282.850)              | J.P. Morgan AG |
|                                   |                            |        |                                               | <b>(1.639.570)</b>       |                |

#### Candriam Bonds Euro Long Term

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación               | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en EUR) | Contraparte    |
|-----------------------------------|----------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                            |        |                                               |                          |                |
| 33                                | EURO BTP FUTURE -EUX 09/21 | EUR    | 3.496.466                                     | 34.980                   | J.P. Morgan AG |
| 33                                | EURO BUND FUTURE 09/21     | EUR    | 3.391.295                                     | 34.980                   | J.P. Morgan AG |
| (5)                               | EURO BUXL FUTURE 09/21     | EUR    | 782.480                                       | (17.500)                 | J.P. Morgan AG |
| (37)                              | EURO-OAT-FUTURES-EUX 09/21 | EUR    | 4.542.065                                     | (26.302)                 | J.P. Morgan AG |
| 18                                | US 10 YEARS NOTE 09/21     | USD    | 1.685.034                                     | (1.897)                  | J.P. Morgan AG |
| (23)                              | US 10YR ULTRA (CBOT) 09/21 | USD    | 1.881.272                                     | (38.971)                 | J.P. Morgan AG |
| (58)                              | US 5 YEARS NOTE-CBT 09/21  | USD    | 4.801.772                                     | 21.039                   | J.P. Morgan AG |
|                                   |                            |        |                                               | <b>6.329</b>             |                |

#### Candriam Bonds Euro Short Term

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación              | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en EUR) | Contraparte    |
|-----------------------------------|---------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                           |        |                                               |                          |                |
| (149)                             | EURO BOBL FUTURE 09/21    | EUR    | 15.326.289                                    | (11.920)                 | J.P. Morgan AG |
| 508                               | EURO SCHATZ FUTURE 09/21  | EUR    | 51.469.036                                    | (7.960)                  | J.P. Morgan AG |
| (918)                             | US 5 YEARS NOTE-CBT 09/21 | USD    | 76.000.467                                    | 337.393                  | J.P. Morgan AG |
|                                   |                           |        |                                               | <b>317.513</b>           |                |

#### Candriam Bonds Floating Rate Notes

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación              | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en EUR) | Contraparte    |
|-----------------------------------|---------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                           |        |                                               |                          |                |
| (368)                             | EURO BOBL FUTURE 09/21    | EUR    | 37.852.848                                    | 14.170                   | J.P. Morgan AG |
| (55)                              | US 5 YEARS NOTE-CBT 09/21 | USD    | 4.553.405                                     | 31.102                   | J.P. Morgan AG |
|                                   |                           |        |                                               | <b>45.272</b>            |                |

# Candriam Bonds

## Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

### Futuros

#### Candriam Bonds Global Government

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación               | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en EUR) | Contraparte    |
|-----------------------------------|----------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                            |        |                                               |                          |                |
| 3                                 | CAN 10YR BOND (MSE) 09/21  | CAD    | 202.800                                       | 1.716                    | J.P. Morgan AG |
| (64)                              | EURO BOBL FUTURE 09/21     | EUR    | 6.583.104                                     | (5.120)                  | J.P. Morgan AG |
| 10                                | EURO BTP FUTURE -EUX 09/21 | EUR    | 1.059.535                                     | 10.600                   | J.P. Morgan AG |
| 19                                | EURO BUND FUTURE 09/21     | EUR    | 1.952.564                                     | 20.140                   | J.P. Morgan AG |
| 2                                 | EURO BUXL FUTURE 09/21     | EUR    | 312.992                                       | 4.380                    | J.P. Morgan AG |
| (57)                              | EURO-OAT-FUTURES-EUX 09/21 | EUR    | 6.997.235                                     | (40.520)                 | J.P. Morgan AG |
| (10)                              | EURO SCHATZ FUTURE 09/21   | EUR    | 1.013.170                                     | 200                      | J.P. Morgan AG |
| 1                                 | LONG GILT FUTURE-LIF 09/21 | GBP    | 159.298                                       | 536                      | J.P. Morgan AG |
| (41)                              | US 10YR ULTRA (CBOT) 09/21 | USD    | 3.353.571                                     | (69.828)                 | J.P. Morgan AG |
| 15                                | US 2 YEARS NOTE- CBT 09/21 | USD    | 2.649.590                                     | (5.082)                  | J.P. Morgan AG |
| (44)                              | US 5 YEARS NOTE-CBT 09/21  | USD    | 3.642.724                                     | (2.319)                  | J.P. Morgan AG |
|                                   |                            |        |                                               | <b>(85.297)</b>          |                |

#### Candriam Bonds Global High Yield

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación           | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en EUR) | Contraparte    |
|-----------------------------------|------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                        |        |                                               |                          |                |
| (10)                              | EURO BUND FUTURE 09/21 | EUR    | 1.027.665                                     | (4.400)                  | J.P. Morgan AG |
|                                   |                        |        |                                               | <b>(4.400)</b>           |                |

#### Candriam Bonds Global Inflation Short Duration

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación               | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en EUR) | Contraparte    |
|-----------------------------------|----------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                            |        |                                               |                          |                |
| (16)                              | CAN 10YR BOND (MSE) 09/21  | CAD    | 1.081.599                                     | (9.261)                  | J.P. Morgan AG |
| (29)                              | EURO BOBL FUTURE 09/21     | EUR    | 2.982.969                                     | 620                      | J.P. Morgan AG |
| 62                                | EURO BTP FUTURE -EUX 09/21 | EUR    | 6.569.117                                     | 59.370                   | J.P. Morgan AG |
| (82)                              | EURO BUND FUTURE 09/21     | EUR    | 8.426.853                                     | (71.120)                 | J.P. Morgan AG |
| (94)                              | US 10YR ULTRA (CBOT) 09/21 | USD    | 7.688.675                                     | (149.080)                | J.P. Morgan AG |
| (143)                             | US 5 YEARS NOTE-CBT 09/21  | USD    | 11.838.853                                    | (11.219)                 | J.P. Morgan AG |
|                                   |                            |        |                                               | <b>(180.690)</b>         |                |

#### Candriam Bonds International

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación               | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en EUR) | Contraparte    |
|-----------------------------------|----------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                            |        |                                               |                          |                |
| 6                                 | CAN 10YR BOND (MSE) 09/21  | CAD    | 405.600                                       | 3.432                    | J.P. Morgan AG |
| (78)                              | EURO BOBL FUTURE 09/21     | EUR    | 8.023.158                                     | (4.420)                  | J.P. Morgan AG |
| 23                                | EURO BTP FUTURE -EUX 09/21 | EUR    | 2.436.931                                     | 24.380                   | J.P. Morgan AG |
| (46)                              | EURO BUND FUTURE 09/21     | EUR    | 4.727.259                                     | (35.320)                 | J.P. Morgan AG |
| (3)                               | EURO BUXL FUTURE 09/21     | EUR    | 469.488                                       | (10.500)                 | J.P. Morgan AG |
| (39)                              | EURO-OAT-FUTURES-EUX 09/21 | EUR    | 4.787.582                                     | (27.182)                 | J.P. Morgan AG |
| 37                                | EURO SCHATZ FUTURE 09/21   | EUR    | 3.748.729                                     | (740)                    | J.P. Morgan AG |
| 2                                 | JPN 10 YEARS BOND 09/21    | JPY    | 1.537.451                                     | 0                        | J.P. Morgan AG |
| 7                                 | LONG GILT FUTURE-LIF 09/21 | GBP    | 1.115.083                                     | 3.751                    | J.P. Morgan AG |
| 43                                | US 10 YEARS NOTE 09/21     | USD    | 4.025.358                                     | 3.336                    | J.P. Morgan AG |
| (38)                              | US 10YR ULTRA (CBOT) 09/21 | USD    | 3.108.188                                     | (65.164)                 | J.P. Morgan AG |
| 69                                | US 2 YEARS NOTE- CBT 09/21 | USD    | 12.180.113                                    | (23.096)                 | J.P. Morgan AG |
| (61)                              | US 5 YEARS NOTE-CBT 09/21  | USD    | 5.050.140                                     | 21.331                   | J.P. Morgan AG |
| 1                                 | US TREASURY BOND 09/21     | USD    | 122.652                                       | 1.766                    | J.P. Morgan AG |
| 14                                | US ULTRA BD CBT 30YR 09/21 | USD    | 1.397.646                                     | 79.100                   | J.P. Morgan AG |
|                                   |                            |        |                                               | <b>(29.326)</b>          |                |

## Candriam Bonds

### Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

#### Futuros

##### Candriam Bonds Total Return

| Cantidad<br>(comprada/(vendida))  | Denominación               | Moneda | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No realizado<br>(en EUR) | Contraparte    |
|-----------------------------------|----------------------------|--------|-----------------------------------------------|--------------------------|----------------|
| <b>Futuros sobre obligaciones</b> |                            |        |                                               |                          |                |
| (147)                             | CAN 10YR BOND (MSE) 09/21  | CAD    | 9.937.190                                     | (85.087)                 | J.P. Morgan AG |
| (1.100)                           | EURO BOBL FUTURE 09/21     | EUR    | 113.147.100                                   | (96.100)                 | J.P. Morgan AG |
| (875)                             | EURO BUND FUTURE 09/21     | EUR    | 89.920.688                                    | (790.416)                | J.P. Morgan AG |
| (185)                             | EURO BUXL FUTURE 09/21     | EUR    | 28.951.760                                    | (647.500)                | J.P. Morgan AG |
| (750)                             | EURO-OAT-FUTURES-EUX 09/21 | EUR    | 92.068.875                                    | (533.156)                | J.P. Morgan AG |
| (475)                             | US 10 YEARS NOTE 09/21     | USD    | 44.466.162                                    | (119.108)                | J.P. Morgan AG |
| (700)                             | US 10YR ULTRA (CBOT) 09/21 | USD    | 57.256.092                                    | (749.547)                | J.P. Morgan AG |
| (575)                             | US 2 YEARS NOTE- CBT 09/21 | USD    | 101.567.605                                   | 189.910                  | J.P. Morgan AG |
| (1.325)                           | US 5 YEARS NOTE-CBT 09/21  | USD    | 109.695.663                                   | 269.495                  | J.P. Morgan AG |
| (100)                             | US TREASURY BOND 09/21     | USD    | 12.265.210                                    | (303.830)                | J.P. Morgan AG |
| 100                               | US ULTRA BD CBT 30YR 09/21 | USD    | 9.983.188                                     | 135.320                  | J.P. Morgan AG |
|                                   |                            |        |                                               | <b>(2.730.019)</b>       |                |

Consulte la Nota 11 sobre activos bancarios y de corretaje para futuros.

# Candriam Bonds

## Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

### Contracts for difference ("CFD")

Al 30 de junio de 2021, las posiciones abiertas en "CFD" son las siguientes:

#### Candriam Bonds Credit Alpha

| Cantidad     | Posición<br>larga /<br>corta | Moneda | Subyacente                              | Contraparte | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No<br>realizado<br>(en EUR) |
|--------------|------------------------------|--------|-----------------------------------------|-------------|-----------------------------------------------|-----------------------------|
| 29.000       | Corta                        | EUR    | ABERTIS INFRAESTRUCT 2.375 19-27 27/09A | BNP Paribas | 3.202.252                                     | (7.102)                     |
| 30.000       | Corta                        | EUR    | AMERICAN TOWER 0.8750 21-29 21/05A      | BNP Paribas | 3.027.450                                     | (10.250)                    |
| 30.000       | Corta                        | EUR    | ARKEMA S 0.75 19-29 03/12A              | BNP Paribas | 3.120.930                                     | 2.070                       |
| 58.000       | Corta                        | USD    | BERRY GLOBAL 1.57 15/01/2               | BNP Paribas | 4.898.626                                     | (4.485)                     |
| 30.000       | Corta                        | EUR    | NISSAN MOTOR CO 2.6520 20-26 17/03A     | BNP Paribas | 3.271.380                                     | 11.220                      |
| 20.000       | Corta                        | EUR    | REPSOL INTL FINANCE 2.6250 20-30 15/04A | BNP Paribas | 2.364.780                                     | (11.987)                    |
| 20.000       | Corta                        | EUR    | TELECOM ITALIA 1.6250 21-29 18/01A      | BNP Paribas | 1.970.584                                     | (12.864)                    |
| 30.000       | Corta                        | EUR    | TEVA PHARMA 3.25 18-22 14/03S           | BNP Paribas | 3.031.800                                     | 5.949                       |
| 25.000       | Corta                        | EUR    | WEPA HYGIEN 2.875 19-27 15/12S          | BNP Paribas | 2.474.080                                     | 8.208                       |
| <b>TOTAL</b> |                              |        |                                         |             | <b>27.361.882</b>                             | <b>(19.241)</b>             |

#### Candriam Bonds Credit Opportunities

| Cantidad     | Posición<br>larga /<br>corta | Moneda | Subyacente                         | Contraparte | Compromiso<br>(en EUR)<br>(en valor absoluto) | No<br>realizado<br>(en EUR) |
|--------------|------------------------------|--------|------------------------------------|-------------|-----------------------------------------------|-----------------------------|
| 150.000      | Corta                        | EUR    | AMERICAN TOWER 0.50 20-28 15/01A   | BNP Paribas | 14.880.825                                    | (66.030)                    |
| 100.000      | Corta                        | EUR    | VANTAGE TOWERS 0.7500 21-30 31/03A | BNP Paribas | 9.988.600                                     | (105.790)                   |
| <b>TOTAL</b> |                              |        |                                    |             | <b>24.869.425</b>                             | <b>(171.820)</b>            |

# Candriam Bonds

## Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

### Credit Default Swaps ("CDS")

Al 30 de junio de 2021, las posiciones abiertas en "credit default swaps" son las siguientes :

#### Candriam Bonds Credit Alpha

| Denominación                           | Contraparte                      | Nomínale  | Fecha de vencimiento | Moneda | Compra/Venta | Spread | No realizado (en EUR) |
|----------------------------------------|----------------------------------|-----------|----------------------|--------|--------------|--------|-----------------------|
| Cellnex Telecom 3,125% 27/07/22        | Barclays Bank Ireland Plc        | 1.500.000 | 20/12/2027           | EUR    | Vente        | 5%     | 55.601                |
| RENAULT 1% 28/11/25                    | Barclays Bank Ireland Plc        | 1.300.000 | 20/06/2028           | EUR    | Achat        | 1%     | 307.895               |
| Société Générale-Anleihe 2,5% 21/04/26 | Barclays Bank Ireland Plc        | 2.800.000 | 20/06/2028           | EUR    | Achat        | 1%     | (91.737)              |
| British Telecom, 5,75% 07/12/28        | Barclays Bank Ireland Plc        | 3.000.000 | 20/06/2028           | EUR    | Achat        | 1%     | (35.482)              |
| Cellnex Telecom 3,125% 27/07/22        | BNP Paribas Paris                | 800.000   | 20/12/2027           | EUR    | Vente        | 5%     | 164.211               |
| British Telecom, 5,75% 07/12/28        | Goldman Sachs Intl. Paris Branch | 2.000.000 | 20/06/2028           | EUR    | Achat        | 1%     | (23.655)              |
| RENAULT 1% 28/11/25                    | Société Générale                 | 1.700.000 | 20/06/2028           | EUR    | Achat        | 1%     | 72.709                |
|                                        |                                  |           |                      |        |              |        | <b>449.542</b>        |

#### Candriam Bonds Credit Opportunities

| Denominación                    | Contraparte                      | Nomínale    | Fecha de vencimiento | Moneda | Compra/Venta | Spread | No realizado (en EUR) |
|---------------------------------|----------------------------------|-------------|----------------------|--------|--------------|--------|-----------------------|
| Cellnex Telecom 3,125% 27/07/22 | Barclays Bank Ireland Plc        | 10.000.000  | 20/12/2027           | EUR    | Vente        | 5%     | 2.052.633             |
| Cellnex Telecom 3,125% 27/07/22 | Barclays Bank Ireland Plc        | 5.000.000   | 20/06/2028           | EUR    | Vente        | 5%     | 1.063.913             |
| ELIS 1,75% 11/04/24             | Barclays Bank Ireland Plc        | 3.000.000   | 20/06/2028           | EUR    | Vente        | 5%     | 561.565               |
| ELIS 1,75% 11/04/24             | BNP Paribas Paris                | 2.000.000   | 20/06/2026           | EUR    | Vente        | 5%     | 328.752               |
| ITRAXX XOVER S35 V1 MKT         | BOFA Securities Europe S.A.      | 100.000.000 | 20/06/2026           | EUR    | Achat        | 5%     | (12.393.025)          |
| ELIS 1,75% 11/04/24             | Credit Suisse Securities         | 3.000.000   | 20/06/2026           | EUR    | Vente        | 5%     | 493.128               |
| FAURECIA SA                     | Credit Suisse Securities         | 5.000.000   | 20/06/2026           | EUR    | Vente        | 5%     | 786.036               |
| Cellnex Telecom 3,125% 27/07/22 | Credit Suisse Securities         | 5.000.000   | 20/06/2028           | EUR    | Vente        | 5%     | 1.063.913             |
| ELIS 1,75% 11/04/24             | Credit Suisse Securities         | 2.000.000   | 20/06/2028           | EUR    | Vente        | 1%     | 374.377               |
| ITRAXX XOVER S35 V1 MKT         | Goldman Sachs Intl. Paris Branch | 100.000.000 | 20/06/2026           | EUR    | Achat        | 5%     | (12.393.025)          |
| FAURECIA SA                     | Morgan Stanley Bank AG           | 5.000.000   | 20/06/2026           | EUR    | Vente        | 5%     | 786.036               |
|                                 |                                  |             |                      |        |              |        | <b>(17.275.697)</b>   |

#### Candriam Bonds Emerging Markets Total Return

| Denominación          | Contraparte                      | Nomínale  | Fecha de vencimiento | Moneda | Compra/Venta | Spread | No realizado (en EUR) |
|-----------------------|----------------------------------|-----------|----------------------|--------|--------------|--------|-----------------------|
| Brazil 4,25% 07/01/25 | BNP Paribas Paris                | 4.000.000 | 20/06/2026           | USD    | Achat        | 1%     | 123.138               |
| Mexico 4,15% 28/03/27 | BNP Paribas Paris                | 5.000.000 | 20/06/2026           | USD    | Achat        | 1%     | (14.920)              |
| China 7,5% 28/10/27   | Goldman Sachs Intl. Paris Branch | 5.000.000 | 20/06/2026           | USD    | Achat        | 1%     | (155.813)             |
|                       |                                  |           |                      |        |              |        | <b>(47.595)</b>       |

#### Candriam Bonds Euro

| Denominación            | Contraparte    | Nomínale     | Fecha de vencimiento | Moneda | Compra/Venta | Spread | No realizado (en EUR) |
|-------------------------|----------------|--------------|----------------------|--------|--------------|--------|-----------------------|
| ITRAXX EUR XOVER S35 V1 | J.P. Morgan AG | 3.700.000.00 | 20/06/2026           | EUR    | Achat        | 5%     | (458.542)             |
|                         |                |              |                      |        |              |        | <b>(458.542)</b>      |

#### Candriam Bonds Euro Corporate

| Denominación                        | Contraparte               | Nomínale   | Fecha de vencimiento | Moneda | Compra/Venta | Spread | No realizado (en EUR) |
|-------------------------------------|---------------------------|------------|----------------------|--------|--------------|--------|-----------------------|
| Cellnex Telecom 3,125% 27/07/22     | Barclays Bank Ireland Plc | 5.000.000  | 20/06/2026           | EUR    | Vente        | 5%     | 907.037               |
| Vodafone Group PLC 1,750% 25/08/23  | Barclays Bank Ireland Plc | 10.000.000 | 20/06/2026           | EUR    | Achat        | 1%     | (232.157)             |
| Carrefour 1,25% 03/06/25            | BNP Paribas Paris         | 7.500.000  | 20/06/2026           | EUR    | Achat        | 1%     | (195.917)             |
| Credit Agricole SA 2% 25/03/29      | BNP Paribas Paris         | 9.000.000  | 20/06/2026           | EUR    | Vente        | 1%     | 69.374                |
| Engie 1,5% 27/03/28                 | BNP Paribas Paris         | 10.000.000 | 20/06/2026           | EUR    | Vente        | 1%     | 346.185               |
| Banco Santander 5,78% 17/02/28      | BNP Paribas Paris         | 9.000.000  | 20/06/2026           | EUR    | Achat        | 1%     | (302.609)             |
| UBS (London Branch) 0,01% 31/03/26  | BNP Paribas Paris         | 10.000.000 | 20/06/2026           | EUR    | Vente        | 1%     | 341.785               |
| Unibail-Rodamco SE 1,375% 09/03/26  | BNP Paribas Paris         | 5.000.000  | 20/06/2026           | EUR    | Vente        | 1%     | 7.598                 |
| UniCredit 1% 18/01/23               | BNP Paribas Paris         | 7.500.000  | 20/06/2026           | EUR    | Achat        | 1%     | 503                   |
| International Paper Co, 3% 15/02/27 | BNP Paribas Paris         | 12.500.000 | 20/06/2026           | USD    | Achat        | 1%     | (306.461)             |
| Aktueller Pfizer Inc, 2,2% 15/12/21 | BNP Paribas Paris         | 16.000.000 | 20/06/2026           | USD    | Vente        | 1%     | 482.101               |

# Candriam Bonds

## Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

|                                    |                                  |           |            |     |       |    |                  |
|------------------------------------|----------------------------------|-----------|------------|-----|-------|----|------------------|
| Unibail-Rodamco SE 1,375% 09/03/26 | Citigroup Global Markets Europe  | 2.500.000 | 20/06/2028 | EUR | Venta | 1% | (70.543)         |
| RepsolIntlFin 2,25% 10/12/26       | Goldman Sachs Intl. Paris Branch | 3 000 000 | 20/12/2025 | EUR | Venta | 1% | 57.989           |
| ENEL 5,25% 20/05/24                | J.P. Morgan AG                   | 5.000.000 | 20/06/2023 | EUR | Venta | 1% | 80.427           |
| Anheuser-BuschInBev 4% 02/06/21    | J.P. Morgan AG                   | 5.000.000 | 20/12/2025 | EUR | Venta | 1% | 117.109          |
| ENI 2,625% 22/11/21                | J.P. Morgan AG                   | 4.000.000 | 20/06/2026 | EUR | Venta | 1% | 86.595           |
| UnibailRodamco 1,375% 09/03/26     | J.P. Morgan AG                   | 2.500.000 | 20/06/2028 | EUR | Venta | 1% | (70.543)         |
| ENEL 5,25% 20/05/24                | Morgan Stanley Bank AG           | 3.000.000 | 20/06/2026 | EUR | Venta | 1% | 68.200           |
| Stellantis 5,25% 15/04/23          | Morgan Stanley Bank AG           | 5.000.000 | 20/06/2026 | EUR | Venta | 5% | 978.415          |
| ORANGE 0,75% 11/09/23              | Société Générale                 | 5.000.000 | 20/06/2023 | EUR | Venta | 1% | 84.972           |
|                                    |                                  |           |            |     |       |    | <b>2.450.060</b> |

### Candriam Bonds Euro Diversified

| Denominación            | Contraparte    | Nomínale   | Fecha de vencimiento | Moneda | Compra/Venta | Spread | No realizado (en EUR) |
|-------------------------|----------------|------------|----------------------|--------|--------------|--------|-----------------------|
| ITRAXX XOVER S35 V1 MKT | J.P. Morgan AG | 12.000.000 | 20/06/2026           | EUR    | Compra       | 5%     | (1.487.163)           |
|                         |                |            |                      |        |              |        | <b>(1.487.163)</b>    |

### Candriam Bonds Euro High Yield

| Denominación                    | Contraparte                     | Nomínale   | Fecha de vencimiento | Moneda | Compra/Venta | Spread | No realizado (en EUR) |
|---------------------------------|---------------------------------|------------|----------------------|--------|--------------|--------|-----------------------|
| CMA CGM S,A, 7,5% 20/26         | Barclays Bank Ireland Plc       | 4.275.000  | 20/06/2026           | EUR    | Venta        | 5%     | 322.946               |
| Cellnex Telecom 3,125% 27/07/22 | Barclays Bank Ireland Plc       | 8.500.000  | 20/12/2027           | EUR    | Venta        | 5%     | 1.744.738             |
| Cellnex Telecom 3,125% 27/07/22 | Citigroup Global Markets Europe | 15.300.000 | 20/12/2027           | EUR    | Venta        | 5%     | 3.140.529             |
| CMA CGM S,A, 7,5% 20/26         | J.P. Morgan AG                  | 4.525.000  | 20/06/2026           | EUR    | Venta        | 5%     | 341.831               |
| CMA CGM S,A, 7,5% 20/26         | Morgan Stanley Bank AG          | 2.000.000  | 20/06/2026           | EUR    | Venta        | 5%     | 151.086               |
|                                 |                                 |            |                      |        |              |        | <b>5.701.130</b>      |

### Candriam Bonds Euro Long Term

| Denominación            | Contraparte    | Nomínale | Fecha de vencimiento | Moneda | Compra/Venta | Spread | No realizado (en EUR) |
|-------------------------|----------------|----------|----------------------|--------|--------------|--------|-----------------------|
| ITRAXX XOVER S35 V1 MKT | J.P. Morgan AG | 700.000  | 20/06/2026           | EUR    | Compra       | 5%     | (86.751)              |
|                         |                |          |                      |        |              |        | <b>(86.751)</b>       |

### Candriam Bonds International

| Denominación            | Contraparte    | Nomínale  | Fecha de vencimiento | Moneda | Compra/Venta | Spread | No realizado (en EUR) |
|-------------------------|----------------|-----------|----------------------|--------|--------------|--------|-----------------------|
| ITRAXX XOVER S35 V1 MKT | J.P. Morgan AG | 2.000.000 | 20/06/2026           | EUR    | Compra       | 5%     | (247.861)             |
|                         |                |           |                      |        |              |        | <b>(247.861)</b>      |

### Candriam Bonds Total Return

| Denominación            | Contraparte    | Nomínale    | Fecha de vencimiento | Moneda | Compra/Venta | Spread | No realizado (en EUR) |
|-------------------------|----------------|-------------|----------------------|--------|--------------|--------|-----------------------|
| ITRAXX XOVER S35 V1 MKT | J.P. Morgan AG | 21.000.000  | 20/06/2026           | EUR    | Compra       | 5%     | (2.602.535)           |
| CDX NA HY S36 V1 MKT    | J.P. Morgan AG | 8.000.000   | 20/06/2026           | USD    | Compra       | 5%     | (688.446)             |
| CDX NA HY S36 V1 MKT    | J.P. Morgan AG | 28.000.000  | 20/06/2026           | USD    | Compra       | 5%     | (2.409.561)           |
| CDX NA IG S36 V1        | J.P. Morgan AG | 210.000.000 | 20/06/2026           | USD    | Compra       | 1%     | (4.495.736)           |
| CDX XEM SERIE 35 V1 MKT | J.P. Morgan AG | 80.000.000  | 20/06/2026           | USD    | Compra       | 1%     | 1.762.796             |
|                         |                |             |                      |        |              |        | <b>(8.433.482)</b>    |

Véase la nota 12 para la garantía recibida/depositada en relación con los contratos CDS.

## Candriam Bonds

### Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

#### Total Return Swaps ("TRS")

Al 30 de junio de 2021, las posiciones abiertas en "Total Return Swaps" son las siguientes :

##### Candriam Bonds Credit Alpha

| Nomínale  | Moneda | Fecha de vencimiento | Contraparte                      | Compartimentos de pago        | Compartimentos de recibo | No realizado (en EUR) |
|-----------|--------|----------------------|----------------------------------|-------------------------------|--------------------------|-----------------------|
| 2.000.000 | EUR    | 20/12/2021           | Goldman Sachs Intl. Paris Branch | IBOXX EUR CORPORATES          | EUR EURIBOR 3 MONTHS     | 12.934.               |
| 3.500.000 | USD    | 20/09/2021           | BNP Paribas Paris                | IBOXX USD IG                  | USD LIBOR 3 MONTHS       | (143.461)             |
| 3.500.000 | USD    | 20/12/2021           | Goldman Sachs Intl. Paris Branch | IBOXX USD IG                  | USD LIBOR 3 MONTHS       | (87.026)              |
| 8.000.000 | USD    | 20/12/2021           | Barclays Bank Ireland Plc        | IBOXX LIQUID HIGH YIELD INDEX | USD LIBOR 3 MONTHS       | (43.276)              |
|           |        |                      |                                  |                               |                          | <b>(260.829)</b>      |

##### Candriam Bonds Credit Opportunities

| Nomínale   | Moneda | Fecha de vencimiento | Contraparte                      | Compartimentos de pago        | Compartimentos de recibo | No realizado (en EUR) |
|------------|--------|----------------------|----------------------------------|-------------------------------|--------------------------|-----------------------|
| 23.000.000 | EUR    | 20/09/2021           | Barclays Bank Ireland Plc        | IBX EUR LIQUID HIGH YIELD TRI | EUR EURIBOR 3 MONTHS     | (314.082)             |
| 70.000.000 | EUR    | 20/12/2021           | Barclays Bank Ireland Plc        | IBOXX EUR CORPORATES          | EUR EURIBOR 3 MONTHS     | 632.333               |
| 50.000.000 | EUR    | 20/12/2021           | Citigroup Global Markets Europe  | IBOXX EUR CORPORATES          | EUR EURIBOR 3 MONTHS     | (46.934)              |
| 23.000.000 | EUR    | 20/09/2021           | Goldman Sachs Intl. Paris Branch | IBX EUR LIQUID HIGH YIELD TRI | EUR EURIBOR 3 MONTHS     | (400.799)             |
| 96.000.000 | EUR    | 20/09/2021           | Goldman Sachs Intl. Paris Branch | IBX EUR LIQUID HIGH YIELD TRI | EUR EURIBOR 3 MONTHS     | (1.357.502)           |
| 30.000.000 | EUR    | 20/12/2021           | Goldman Sachs Intl. Paris Branch | IBOXX EUR CORPORATES          | EUR EURIBOR 3 MONTHS     | 200.137               |
| 30.000.000 | EUR    | 20/12/2021           | Goldman Sachs Intl. Paris Branch | IBOXX EUR CORPORATES          | EUR EURIBOR 3 MONTHS     | 194.013               |
| 53.000.000 | EUR    | 20/09/2021           | J.P. Morgan AG                   | IBX EUR LIQUID HIGH YIELD TRI | EUR EURIBOR 3 MONTHS     | (746.883)             |
| 23.000.000 | EUR    | 20/09/2021           | Société Générale                 | IBX EUR LIQUID HIGH YIELD TRI | EUR EURIBOR 3 MONTHS     | (302.939)             |
|            |        |                      |                                  |                               |                          | <b>(2.142.656)</b>    |

##### Candriam Bonds Euro High Yield

| Nomínale   | Moneda | Fecha de vencimiento | Contraparte                      | Compartimentos de pago | Compartimentos de recibo | No realizado (en EUR) |
|------------|--------|----------------------|----------------------------------|------------------------|--------------------------|-----------------------|
| 80.500.000 | USD    | 20/09/2021           | BNP Paribas Paris                | IBOXX USD IG           | USD LIBOR 3 MONTHS       | (3.299.600)           |
| 13.599.993 | EUR    | 20/12/2021           | BNP Paribas Paris                | IBOXX EUR CORPORATES   | EUR EURIBOR 3 MONTHS     | (52.339)              |
| 62.900.000 | EUR    | 20/12/2021           | Goldman Sachs Intl. Paris Branch | IBOXX EUR CORPORATES   | EUR EURIBOR 3 MONTHS     | 534.956               |
| 67.500.000 | EUR    | 29/12/2021           | Security Pacific National Bank   | IBOXX EUR CORPORATES   | EUR EURIBOR 3 MONTHS     | 306.716               |
| 62.900.000 | EUR    | 20/12/2021           | Société Générale                 | IBOXX EUR CORPORATES   | EUR EURIBOR 3 MONTHS     | 534.956               |
|            |        |                      |                                  |                        |                          | <b>(1.975.311)</b>    |

Véase la nota 12 para la garantía recibida/depositada en relación con los contratos TRS.

# Candriam Bonds

## Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados

### Interest Rate Swaps ("IRS")

Al 30 de junio de 2021, las posiciones abiertas en "IRS" son las siguientes :

#### Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies

| Nomínale    | Moneda | Fecha de vencimiento | Contraparte                      | Compartimentos de pago | Compartimentos de recibo       | No realizado (en USD) |
|-------------|--------|----------------------|----------------------------------|------------------------|--------------------------------|-----------------------|
| 150.000.000 | MXN    | 05/05/2027           | Goldman Sachs Intl. Paris Branch | MXN TIIE 28D           | 5,510%                         | (445.512)             |
| 170.000.000 | TRY    | 05/03/2023           | J.P. Morgan AG                   | 17,200%                | TRY OVERNIGHT TLREF COMPOUNDED | 253.169               |
| 151.500.000 | MXN    | 29/11/2023           | J.P. Morgan AG                   | MXN TIIE 28D           | 8,985%                         | 484.703               |
| 23.000.000  | BRL    | 02/01/2025           | J.P. Morgan AG                   | BRL MONEY MARKET CDI   | 6,270%                         | (262.668)             |
| 40.000.000  | BRL    | 02/01/2025           | J.P. Morgan AG                   | BRL MONEY MARKET CDI   | 5,185%                         | (728.951)             |
| 42.000.000  | BRL    | 02/01/2025           | J.P. Morgan AG                   | BRL MONEY MARKET CDI   | 7,110%                         | (243.270)             |
| 100.000.000 | CNY    | 02/03/2025           | J.P. Morgan AG                   | CNY SWAP HKSH 7D DEPO  | 2,383%                         | (158.601)             |
| 280.000.000 | ZAR    | 12/05/2025           | J.P. Morgan AG                   | ZAR JIBAR 3 MONTHS     | 5,425%                         | (83.737)              |
| 125.000.000 | CNY    | 24/12/2025           | J.P. Morgan AG                   | CNY SWAP HKSH 7D DEPO  | 2,665%                         | (50.973)              |
| 32.000.000  | BRL    | 04/01/2027           | J.P. Morgan AG                   | BRL MONEY MARKET CDI   | 6,500%                         | (603.463)             |
| 75.000.000  | MXN    | 08/12/2028           | J.P. Morgan AG                   | MXN TIIE 28D           | 8,785%                         | 430.159.              |
| 350.000.000 | RUB    | 13/05/2025           | Société Générale                 | RUB MOSPRIME 3 MONTHS  | 5,620%                         | (287.110)             |
| 175.000.000 | CZK    | 30/04/2026           | Société Générale                 | 1,680%                 | CZK PRIBOR 6 MONTHS            | 86.832                |
| 30.000.000  | PLN    | 30/04/2026           | Société Générale                 | 1,355%                 | PLN WIBOR 6 MONTHS             | 19.909                |
|             |        |                      |                                  |                        |                                | <b>(1.589.513)</b>    |

#### Candriam Bonds Emerging Markets Total Return

| Nomínale   | Moneda | Fecha de vencimiento | Contraparte      | Compartimentos de pago | Compartimentos de recibo       | No realizado (en USD) |
|------------|--------|----------------------|------------------|------------------------|--------------------------------|-----------------------|
| 56.000.000 | TRY    | 05/03/2023           | J.P. Morgan AG   | 17,200%                | TRY OVERNIGHT TLREF COMPOUNDED | 83.397                |
| 30.000.000 | CNY    | 02/03/2025           | J.P. Morgan AG   | CNY SWAP HKSH 7D DEPO  | 2,383%                         | (47.123)              |
| 45.000.000 | ZAR    | 12/05/2025           | J.P. Morgan AG   | ZAR JIBAR 3 MONTHS     | 5,425%                         | (13.458)              |
| 14.000.000 | PLN    | 19/05/2026           | J.P. Morgan AG   | 1,600%                 | PLN WIBOR 6 MONTHS             | (32.067)              |
| 61.000.000 | MXN    | 13/09/2029           | J.P. Morgan AG   | MXN TIIE 28D           | 6,790%                         | (23.966)              |
| 45.000.000 | CZK    | 30/04/2026           | Société Générale | 1,680%                 | CZK PRIBOR 6 MONTHS            | 22.328                |
| 8.000.000  | PLN    | 30/04/2026           | Société Générale | 1,355%                 | PLN WIBOR 6 MONTHS             | 5.309                 |
|            |        |                      |                  |                        |                                | <b>(5.580)</b>        |

#### Candriam Bonds Global Government

| Nomínale   | Moneda | Fecha de vencimiento | Contraparte    | Compartimentos de pago | Compartimentos de recibo | No realizado (en USD) |
|------------|--------|----------------------|----------------|------------------------|--------------------------|-----------------------|
| 13.000.000 | SEK    | 27/05/31             | J.P. Morgan AG | 0,826%                 | SEK STIBOR 3 MONTHS      | (9.323)               |
|            |        |                      |                |                        |                          | <b>(9.323)</b>        |

#### Candriam Bonds Global Inflation Short Duration

| Nomínale   | Moneda | Fecha de vencimiento | Contraparte    | Compartimentos de pago | Compartimentos de recibo | No realizado (en USD) |
|------------|--------|----------------------|----------------|------------------------|--------------------------|-----------------------|
| 12.500.000 | SEK    | 27/05/31             | J.P. Morgan AG | 0,826%                 | SEK STIBOR 3 MONTHS      | (8.964)               |
|            |        |                      |                |                        |                          | <b>(8.964)</b>        |

#### Candriam Bonds Total Return

| Nomínale    | Moneda | Fecha de vencimiento | Contraparte       | Compartimentos de pago | Compartimentos de recibo | No realizado (en USD) |
|-------------|--------|----------------------|-------------------|------------------------|--------------------------|-----------------------|
| 425.000.000 | CNY    | 21/10/2025           | BNP Paribas Paris | CNY SWAP HKSH 7D DEPO  | 2,710%                   | (19.384)              |
| 315.000.000 | CNY    | 17/09/2025           | J.P. Morgan AG    | CNY SWAP HKSH 7D DEPO  | 2,675%                   | (61.685)              |
| 260.000.000 | CNY    | 04/02/2026           | J.P. Morgan AG    | CNY SWAP HKSH 7D DEPO  | 2,825%                   | 133.655               |
| 127.000.000 | SEK    | 27/05/2031           | J.P. Morgan AG    | 0,826%                 | SEK STIBOR 3 MONTHS      | (91.076)              |
| 22.000.000  | NZD    | 09/06/2031           | J.P. Morgan AG    | 2,000%                 | NZD BBR 3 MONTHS         | (158.042)             |
|             |        |                      |                   |                        |                          | <b>(196.532)</b>      |

Véase la nota 12 para la garantía recibida/depositada en relación con los contratos IRS.

## Otras notas a los estados financieros

### Note 1 - Aspectos generales

Candriam Bonds (en lo sucesivo denominada “la SICAV” o el “Fondo”) es una Sociedad de Inversión de Capital Variable constituida conforme a lo dispuesto en la Parte I de la Ley del 17 de diciembre de 2010 relativa a los Organismos de Inversión Colectiva (“la Ley”), en su versión modificada.

Sus estatutos fueron presentados ante la “Registre de Commerce et des Sociétés” (Registro Mercantil) de y en Luxemburgo y fueron publicados en el *Mémorial*, “Recueil des Sociétés et Associations” el día 24 de agosto de 1989. Fueron modificados varias veces y concretamente, el 6 de julio de 2020 por última vez. Los cambios correspondientes se publicaron en el *Recueil Electronique des Sociétés et Association (RESA)*.

La SICAV está inscrita en el Registro Mercantil de Luxemburgo con el número B-30659.

El capital de la SICAV será en todo momento igual al valor del activo neto y estará representado por acciones emitidas sin designación de valor nominal y totalmente desembolsadas.

La SICAV se presenta como una OICVM con múltiples compartimentos, es decir que se compone de varios compartimentos siendo cada uno de ellos representativo de un conjunto de activos y pasivos específicos que corresponden a una política de Inversión distinta.

La estructura de múltiples compartimentos ofrece a los inversores la ventaja de poder elegir entre compartimentos diferentes. Pero también la posibilidad de pasar de un compartimento a otro. Dentro de cada compartimento, la SICAV podrá emitir acciones de clases diferentes, que se distinguirán principalmente por tener derechos y comisiones diferentes o por su política de distribución. Las acciones solo estarán disponibles de forma nominativa.

Los siguientes compartimentos están actualmente disponibles para los inversores:

| <u>Compartimentos</u>                                         | <u>Moneda de referencia</u> |
|---------------------------------------------------------------|-----------------------------|
| Candriam Bonds Capital Securities                             | EUR                         |
| Candriam Bonds Convertible Defensive                          | EUR                         |
| Candriam Bonds Credit Alpha (lanzado el 1 de febrero de 2021) | EUR                         |
| Candriam Bonds Credit Opportunities                           | EUR                         |
| Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies                 | USD                         |
| Candriam Bonds Emerging Markets                               | USD                         |
| Candriam Bonds Emerging Markets Corporate                     | USD                         |
| Candriam Bonds Emerging Markets Total Return                  | USD                         |
| Candriam Bonds Euro                                           | EUR                         |
| Candriam Bonds Euro Corporate                                 | EUR                         |
| Candriam Bonds Euro Diversified                               | EUR                         |
| Candriam Bonds Euro Government                                | EUR                         |
| Candriam Bonds Euro High Yield                                | EUR                         |
| Candriam Bonds Euro Long Term                                 | EUR                         |
| Candriam Bonds Euro Short Term                                | EUR                         |
| Candriam Bonds Floating Rate Notes                            | EUR                         |
| Candriam Bonds Global Government                              | EUR                         |
| Candriam Bonds Global High Yield                              | EUR                         |
| Candriam Bonds Global Inflation Short Duration                | EUR                         |
| Candriam Bonds International                                  | EUR                         |
| Candriam Bonds Total Return                                   | EUR                         |

Durante el periodo, el Consejo de Administración decidió fusionar por absorción los siguientes subfondos con fecha efectiva de 28 de junio de 2021:

- Candriam Bonds Euro Corporate ex-Financials absorbido por el subfondo Cleome Index Euro Corporate Bonds.
- Candriam Bonds Total Return Defensivo absorbido por el subfondo Candriam Bonds Total Return.

Las clases emitidas son las siguientes:

- La **clase BF** está reservada a los OIC subordinados de derecho belga aprobados por la Sociedad Gestora y gestionados por una entidad del grupo Candriam.
- La **clase Classique (clase C)** se ofrece a personas físicas y a personas jurídicas.
- La **clase I** está reservada exclusivamente a los inversores institucionales.
- La **clase I2** es una clase de acciones, sin comisiones de rentabilidad, reservada exclusivamente a inversores institucionales.
- La **clase LOCK** (a continuación denominada clase **L**) es una clase de acciones que tiene incorporado un mecanismo cuyo propósito es limitar el riesgo de capital incurrido. Este mecanismo sólo está ofrecido por Belfius Banque S.A., único distribuidor autorizado para comercializar estas acciones. Al invertir en esta clase, el inversor acepta que las acciones sean vendidas automáticamente en cuanto el valor de activo neto alcance un importe determinado (precio de activación). De esta manera, cuando constata que el valor de activo neto es igual o inferior al precio de activación, se genera automáticamente una orden de recompra que se ejecuta en el mejor plazo. La orden de venta se efectuará de manera globalizada en el primer “cut-off” (fecha de cierre para la recepción de órdenes) que siga al día de cálculo del valor de activo neto que haya provocado la activación automática de la orden de recompra.
- La **clase N** está reservada a entidades comercializadoras especialmente aprobadas por la Sociedad Gestora.

## Otras notas a los estados financieros

### Note 1 - Aspectos generales

- La **clase PI** está reservada a los inversores institucionales que se suscriban antes de que el subfondo haya alcanzado un tamaño crítico en términos de activos gestionados. La suscripción inicial mínima es de 1.000.000 de euros o su equivalente en moneda para las clases denominadas en moneda extranjera (este mínimo puede modificarse a discreción del Consejo de Administración siempre que se garantice la igualdad de trato de los accionistas en el mismo Día de Valoración). Esta clase permanecerá abierta a la suscripción hasta que se produzca uno de los siguientes acontecimientos: (i) el plazo fijado por el Consejo de Administración ha expirado, (ii) el subfondo ha alcanzado un tamaño crítico en términos de activos gestionados, según lo definido por el Consejo de Administración, (iii) el Consejo de Administración ha decidido, por razones justificadas, cerrar esta clase a la suscripción. El Consejo de Administración podrá reabrir esta clase de acciones a su discreción y sin previo aviso a los inversores.
- La **clase R** está reservada a aquellos 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 compartimento. Y
  - no tienen derecho a recibir de la Sociedad Gestora. En cumplimiento de las leyes y reglamentos que les son aplicables. honorarios. comisiones u otros beneficios monetarios en relación con la prestación del servicio de inversión antes mencionado.
- La **clase R2** está reservada:
  - A los distribuidores y/o intermediarios aprobados por la Sociedad Gestora que no perciban. respecto de las inversiones en esta clase. ninguna forma de remuneración de una entidad del grupo Candriam, cuando las inversiones finales en las acciones se realicen en el marco de un mandato.
  - A los OIC aprobados por la Sociedad Gestora.
- La **clase S** se ofrece a los inversores institucionales especialmente habilitados por la Sociedad Gestora. Cuya suscripción inicial mínima es de EUR 25.000.000. o por decisión del Consejo de Administración. su equivalente en cualquier otra divisa o su equivalente en divisas para las clases denominadas en divisas. (Este mínimo puede ser modificado a discreción del Consejo de Administración siempre que se asegure el tratamiento igualitario de los accionistas un mismo día de evaluación).
- La **clase S2** se ofrece a los inversores institucionales especialmente habilitados por la Sociedad Gestora. Cuya suscripción inicial mínima es de EUR 100.000.000. o por decisión del Consejo de Administración. su equivalente en cualquier otra divisa o su equivalente en divisas para las clases denominadas en divisas. (Este mínimo puede ser modificado a discreción del Consejo de Administración siempre que se asegure el tratamiento igualitario de los accionistas un mismo día de evaluación).
- La **clase S3** se ofrece a los inversores institucionales especialmente habilitados por la Sociedad Gestora. Cuya suscripción inicial mínima es de EUR 175.000.000. o por decisión del Consejo de Administración. su equivalente en cualquier otra divisa o su equivalente en divisas para las clases denominadas en divisas. (Este mínimo puede ser modificado a discreción del Consejo de Administración siempre que se asegure el tratamiento igualitario de los accionistas un mismo día de evaluación).
- La **clase S4** es una clase de acciones sin comisión de rendimiento, reservada a inversores institucionales/profesionales, distribuidores y/o intermediarios, aprobados por la Sociedad Gestora, que invierten a través de Spezialfonds, con una suscripción inicial mínima de 75.000.000 euros o su equivalente en moneda extranjera para las clases denominadas en moneda extranjera (este mínimo puede modificarse a discreción del Consejo de Administración siempre que se garantice la igualdad de trato de los accionistas en el mismo Día de Valoración).
- La **clase V** está reservada exclusivamente a los inversores institucionales cuya suscripción inicial mínima es de EUR 20.000.000, o por decisión del Consejo de Administración, su equivalente en cualquier otra divisa o su equivalente en divisas para las clases denominadas en divisas. (Este mínimo puede ser modificado a discreción del Consejo de Administración siempre que se asegure el tratamiento igualitario de los accionistas un mismo día de evaluación).
- La **clase V2** es una clase de acciones sin comisión de rentabilidad, reservada a inversores institucionales / profesionales, distribuidores y/o intermediarios. aprobados por la Sociedad Gestora, cuya suscripción inicial mínima sea de EUR 20.000.000 o su equivalente en divisas para las clases denominadas en divisas (este importe podrá ser revisado a discreción de los consejeros; en este caso, debe asegurarse la igualdad de trato entre los accionistas para un mismo día de valoración).
- A **clase Z** está reservada:
  - A los inversores institucionales/ profesionales aprobados por la Sociedad Gestora. La actividad de gestión de cartera para esta clase está directamente remunerada a través del contrato concluido con el inversor, por lo que no se percibirá ninguna comisión de gestión de cartera sobre los activos de esta clase.
  - A los OIC aprobados por la Sociedad Gestora y gestionados por una entidad del grupo Candriam.

La parte correspondiente al tenedor de una acción de capitalización en el beneficio anual se capitaliza, mientras que la acción de distribución confiere a su tenedor el derecho a percibir, en forma de dividendo en efectivo. una parte alícuota del beneficio anual.

Además, cada clase de podrá aplicar una política de cobertura específica:

- Una cobertura frente a las fluctuaciones de la divisa de referencia: dicha cobertura pretende reducir el efecto de las fluctuaciones de los tipos de cambio entre la divisa de referencia del compartimento y la divisa en la que está denominada la clase de acciones. Este tipo de cobertura pretende lograr una rentabilidad (ajustada principalmente por la diferencia de tipos de interés entre las dos divisas) razonablemente comparable entre la clase cubierta y la (equivalente) denominada en la divisa de referencia del compartimento. Este tipo de cobertura se identificará añadiendo el sufijo H a la denominación de la clase.

## Otras notas a los estados financieros

### Note 1 - Aspectos generales

- Una cobertura contra la exposición cambiaria de los activos que componen la cartera: dicha cobertura pretende reducir el efecto de las fluctuaciones de los tipos de cambio entre las divisas de los activos del compartimento y la divisa en la que está denominada la clase. Este tipo de cobertura se identificará añadiendo el sufijo AH a la denominación de la clase.

Las acciones emitidas se describen en detalle en la sección "Movimiento del número de acciones durante el periodo" de los diferentes compartimentos.

### Note 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.

El valor liquidativo de cada subfondo se ha calculado el 1 de julio de 2021 a partir de los últimos precios conocidos en el momento de la valoración.

#### a) Valoración de la cartera de valores de cada compartimento

La valoración de cualquier valor cotizado en bolsa o en 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 este 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) Beneficios (pérdidas) netos(as) realizados(as) sobre las ventas de las inversiones

Los beneficios o pérdidas realizados(as) sobre las ventas de las inversiones de cada compartimento se calculan basándose en el coste medio de las inversiones vendidas.

#### c) Conversión de las divisas extranjeras

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

Los ingresos y gastos en una moneda diferente a la moneda de referencia de cada subfondo se convierten a esa moneda a los tipos de cambio vigentes en la fecha de la transacción.

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

Tipos de cambio utilizados a 30 de junio de 2021:

|         |             |     |         |          |     |         |             |     |
|---------|-------------|-----|---------|----------|-----|---------|-------------|-----|
| 1 EUR = | 113,5217    | ARS | 1 EUR = | 1,57965  | AUD | 1 EUR = | 5,9507      | BRL |
| 1 EUR = | 1,4685      | CAD | 1 EUR = | 1,0962   | CHF | 1 EUR = | 863,46568   | CLP |
| 1 EUR = | 7,66195     | CNH | 1 EUR = | 7,66265  | CNY | 1 EUR = | 4.428,15093 | COP |
| 1 EUR = | 25,507      | CZK | 1 EUR = | 7,43625  | DKK | 1 EUR = | 67,62       | DOP |
| 1 EUR = | 0,85845     | GBP | 1 EUR = | 9,2095   | HKD | 1 EUR = | 351,03      | HUF |
| 1 EUR = | 17.195,5543 | IDR | 1 EUR = | 88,14795 | INR | 1 EUR = | 131,62305   | JPY |
| 1 EUR = | 23,61185    | MXN | 1 EUR = | 4,9233   | MYR | 1 EUR = | 10,2049     | NOK |
| 1 EUR = | 1,69715     | NZD | 1 EUR = | 4,54495  | PEN | 1 EUR = | 4,51475     | PLN |
| 1 EUR = | 4,9245      | RON | 1 EUR = | 86,63445 | RUB | 1 EUR = | 10,142      | SEK |
| 1 EUR = | 1,5941      | SGD | 1 EUR = | 38,0081  | THB | 1 EUR = | 10,3025     | TRY |
| 1 EUR = | 32,3513     | UAH | 1 EUR = | 1,1859   | USD | 1 EUR = | 16,93315    | ZAR |

#### d) Estados financieros consolidado de la SICAV

El estado combinado del activo neto de la SICAV y el estado combinado de variaciones de los activos netos en EUR son la suma del estado del activo neto, el estado de variaciones de los activos netos de cada compartimento convertido en moneda de la SICAV sobre la base de los tipos de cambio vigentes en la fecha de cierre.

Las inversiones por parte de algunos compartimentos de la SICAV en otros compartimentos de la misma no han sido eliminadas del estado combinado del activo neto a fecha de 30 de junio de 2021. A fecha de 30 de junio de 2021, el total de las inversiones intra-SICAV ascendían a EUR 124.654.935. Por consiguiente, el activo neto combinado al cierre ascendería a EUR 13.401.541.947 si no se tuviesen en cuenta estas inversiones intra-SICAV.

# Candriam Bonds

## Otras notas a los estados financieros

### Note 2 - Principales métodos contables

#### d) Estados financieros consolidado de la SICAV

| Compartimentos                               | Inversiones intra-SICAV                                | Importe<br>(en EUR) |
|----------------------------------------------|--------------------------------------------------------|---------------------|
| Candriam Bonds Credit Opportunities          | Candriam Bonds Credit Alpha Z EUR C                    | 5.041.475           |
| Candriam Bonds Credit Opportunities          | Candriam Bonds Floating Rate Notes V EUR C             | 15.023.300          |
| Candriam Bonds Emerging Markets              | Candriam Bonds Emerging Markets Corporate Z USD C      | 12.777.310          |
| Candriam Bonds Emerging Markets              | Candriam Bonds Emerging Markets Total Return Z USD C   | 14.697.410          |
| Candriam Bonds Emerging Markets Total Return | Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies Z USD C  | 2.267.416           |
| Candriam Bonds Euro                          | Candriam Bonds Euro Long Term Z EUR C                  | 5.457.750           |
| Candriam Bonds Euro                          | Candriam Bonds Floating Rate Notes I EUR C             | 2.400.400           |
| Candriam Bonds Euro Corporate                | Candriam Bonds Capital Securities Z EUR C              | 11.725.409          |
| Candriam Bonds Euro Corporate                | Candriam Bonds Emerging Markets Z EUR H C              | 600                 |
| Candriam Bonds Euro Diversified              | Candriam Bonds Convertible Defensive Z EUR C           | 7.571.784           |
| Candriam Bonds Euro Diversified              | Candriam Bonds Credit Alpha Z EUR C                    | 6.048.560           |
| Candriam Bonds Euro Diversified              | Candriam Bonds Global Inflation Short Duration Z EUR C | 6.045.300           |
| Candriam Bonds Euro Diversified              | Candriam Bonds Total Return I EUR C                    | 1.488               |
| Candriam Bonds Euro High Yield               | Candriam Bonds Credit Alpha Z EUR C                    | 15.094.182          |
| Candriam Bonds Euro Short Term               | Candriam Bonds Floating Rate Notes I EUR C             | 12.002.000          |
| Candriam Bonds International                 | Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies Z EUR C  | 1.008.774           |
| Candriam Bonds Total Return                  | Candriam Bonds Emerging Markets Corporate I EUR H C    | 2.478.176           |
| Candriam Bonds Total Return                  | Candriam Bonds Emerging Markets Total Return Z EUR c   | 5.013.602           |
| <b>TOTAL</b>                                 |                                                        | <b>124.654.936</b>  |

#### e) Valoración de las opciones y los futuros

Las opciones y futuros admitidos a cotización en una Bolsa oficial o negociados en cualquier otro mercado organizado se valoran al último precio conocido. Si los valores se negocian en varios mercados, la valoración se basará en la última cotización conocida del mercado en el cual la SICAV haya establecido su contrato.

Cuando las opciones y contratos a plazo no se negocien en una Bolsa o en otro mercado organizado, el precio se calculará sobre la base del valor probable de realización, estimado con prudencia y de buena fe. El valor de mercado de las opciones se incluye en el estado del activo neto en "Opciones (posición larga) / (posición corta) al valor de mercado".

Los(as) beneficios / (pérdidas) realizados(as) y la variación de la plusvalía / minusvalía sin realizar sobre opciones se incluyen en el estado de las operaciones y variaciones de los activos netos, respectivamente en "Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre opciones" y "Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre opciones".

La plusvalía / minusvalía sin realizar sobre los contratos de futuros se indica en el estado del activo neto en "Plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre futuros". Las variaciones en el valor de mercado de contratos de futuros abiertos se registran como plusvalía / minusvalía sin realizar en el estado de las variaciones de los activos netos en "Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre futuros". Los beneficios o pérdidas realizados, que representan la diferencia entre el valor del contrato en el momento de ser abierto y su valor a su cierre, se indican al cierre o vencimiento de los contratos de futuros en el estado de las variaciones en "Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre futuros".

Para información detallada sobre opciones o futuros financieros en circulación, si los hubiera, consulte la sección "Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados".

#### f) Valoración de los contratos de cambio a plazo

Los contratos de cambio a plazo se valoran a los tipos de cambio a plazo en la fecha de cierre aplicables para el período restante hasta el vencimiento. La plusvalía / minusvalía sin realizar sobre los contratos de divisas a plazo se indica en el estado del activo neto en "Plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo".

Los(as) beneficios / (pérdidas) realizados(as) y la variación de la plusvalía / minusvalía sin realizar que resulte de estos(as) se incluyen en el estado de las operaciones y variaciones de los activos netos, respectivamente en "Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre contratos de cambio a plazo" y "Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo".

Para información detallada sobre los contratos de cambio a plazo pendientes, si los hubiera, consulte la sección "Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados".

#### g) Valoración de los "Non-Deliverable Forwards" ("NDF")

Los contratos a plazo sin entrega ("NDF") son contratos a corto plazo sobre divisas extranjeras con poca liquidez o no convertibles. Estos contratos se valoran sobre la base de los tipos cambiarios a plazo prevalecientes en la fecha de cierre y aplicables al período residual hasta la fecha de vencimiento. Los beneficios o las pérdidas sin realizar resultantes de los NDF se incluyen en el estado del activo neto en "Plusvalía / (minusvalía) neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo".

## Otras notas a los estados financieros

### Note 2 - Principales métodos contables

#### g) Valoración de los "Non-Deliverable Forwards" ("NDF")

Por lo general los NDF se cotizan y liquidan en USD. Los(as) beneficios / (pérdidas) realizados(as) y la variación de la plusvalía / minusvalía sin realizar que resulte de estos(as) se incluyen en el estado de las operaciones y variaciones de los activos netos, respectivamente en "Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre contratos de cambio a plazo" y "Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre contratos de cambio a plazo".

Para información detallada sobre los contratos por NDF pendientes, si los hubiera, consulte el apartado «Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados».

#### h) Valoración de los "Contracts for difference" ("CFD")

Los CFD se valoraran a su valor razonable que se basara respectivamente en las ultimas curvas conocidas de spread, de tipos, y en la ultima cotizacion de cierre conocida del valor subyacente. Los beneficios o (las pérdidas) sin realizar resultantes de "CFD" se contabilizan en el estado del activo neto en "Plusvalía / (minusvalía) neta sin realizar sobre CFD".

Los(as) beneficios / (pérdidas) realizados(as) y la variación de la plusvalía / minusvalía sin realizar que resulte de estos(as) se incluyen en el estado de las operaciones y variaciones de los activos netos, respectivamente en "Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre CFD" y "Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre CFD".

Para información detallada sobre los contratos por diferencia (CFD) pendientes, si los hubiera, consulte el apartado «Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados».

#### i) Valoración de los "credit default swaps" ("CDS")

El valor de un "credit default swap" está determinado por comparación entre los flujos futuros actualizados sobre el valor de la prima anual, pagada por el comprador de la protección, y el valor actual de las pérdidas esperadas del activo de referencia en caso de eventos de crédito precisados en el contrato de swap. Los beneficios o las pérdidas sin realizar resultantes de "credit default swaps" (seguros de crédito contra impago) se contabilizan en el estado del activo neto en "Plusvalía / (minusvalía) neta sin realizar sobre swaps".

Los(as) beneficios / (pérdidas) realizados(as) y la variación de la plusvalía / minusvalía sin realizar que resulte de estos(as) se incluyen en el estado de las operaciones y variaciones de los activos netos, respectivamente en "Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre swaps" y "Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre swaps".

Para información detallada sobre los contratos por (CDS) pendientes, si los hubiera, consulte el apartado «Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados».

#### j) Valoración de los swaps de rendimiento total ("TRS")

Los swaps de rendimiento total se valoran en función del ajuste diario a valor de mercado basado en el valor de mercado del activo subyacente. Los beneficios o las pérdidas sin realizar resultantes de swaps de rendimiento total (seguros de crédito contra impago) se contabilizan en el estado del activo neto en "Plusvalía / (minusvalía) neta sin realizar sobre swaps".

Los(as) beneficios / (pérdidas) realizados(as) y la variación de la plusvalía / minusvalía sin realizar que resulte de estos(as) se incluyen en el estado de las operaciones y variaciones de los activos netos, respectivamente en "Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre swaps" y "Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre swaps".

Para información detallada sobre los contratos por (TRS) pendientes, si los hubiera, consulte el apartado «Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados».

#### k) Valoración de los swaps de tipos de interés ("IRS")

Los swaps de tipos de interés se valoran a su "fair value". Los beneficios o las pérdidas sin realizar resultantes de swaps de tipos de interés se contabilizan en el estado del activo neto en "Plusvalía / (minusvalía) neta sin realizar sobre swaps".

Los(as) beneficios / (pérdidas) realizados(as) y la variación de la plusvalía / minusvalía sin realizar que resulte de estos(as) se incluyen en el estado de las operaciones y variaciones de los activos netos, respectivamente en "Beneficio / (Pérdida) neto(a) realizado(a) sobre swaps" y "Variación de la plusvalía / minusvalía neta sin realizar sobre swaps".

Para información detallada sobre los contratos por (IRS) pendientes, si los hubiera, consulte el apartado «Notas a los estados financieros - Lista de instrumentos derivados».

#### l) Operaciones con pacto de recompra

Un pacto de recompra inversa es un acuerdo por el que, a cambio de una suma, la SICAV recibe (adquiere) valores mobiliarios de una contraparte que acuerda recomprarlos a un precio y en un plazo especificado entre las dos partes en el momento de la formalización del acuerdo. Un pacto de recompra inversa es similar a un préstamo otorgado por la SICAV a la contraparte en cuanto a sus efectos, el cual está garantizado mediante valores mobiliarios. La SICAV contabiliza el pacto de recompra como si se tratase de un préstamo y lo refleja en el Balance en "Cuentas a cobrar/a pagar por pactos de recompra inversa". Todo interés a cobrar/a pagar (en caso de que haya tipos de interés negativos) respecto a esta transacción se contabiliza en el Balance como otros activos/pasivos. Por lo general un pacto de recompra inversa tiene una corta duración y no puede transmitirse. La SICAV valora este tipo de pacto al coste, lo que al combinarse con los intereses acumulados ofrece una aproximación del valor al que recomprará los valores la contraparte. Los intereses percibidos o abonados (en caso de que haya tipos de interés negativos) se registran en el Estado de variación patrimonial dentro del apartado "Intereses sobre pactos de recompra inversa".

## Otras notas a los estados financieros

### Note 2 - Principales métodos contables

#### m) Costes de transacción

Durante el período cerrado al 30 de junio de 2021, la SICAV ha incurrido en costes de transacción y gastos de corretaje relacionados con la compra y venta de valores mobiliarios, instrumentos del mercado monetario, otros activos elegibles e instrumentos derivados. Estos gastos se incluyen en el estado de variaciones de los activos netos, en la partida "Costes de transacción".

Por otra parte, de conformidad con las prácticas de los mercados de renta fija, se aplica un "bid-offer spread" al efectuar transacciones de compra o de venta de valores. Según este principio, los precios de venta y de compra aplicados por el intermediario financiero para una determinada transacción no son idénticos y su diferencia constituye la remuneración del intermediario financiero.

#### n) Ingresos

Los ingresos por intereses se contabilizan conforme a lo dispuesto para la inversión subyacente. Los ingresos se contabilizan netos de las respectivas retenciones en la fuente, si las hubiere. Los dividendos se contabilizan en la fecha del ex-dividendo.

#### o) Abreviaturas utilizadas en carteras de valores

A: Anual  
FL.R: Floating Rate Notes  
Q: Trimestral  
S: Semestral  
XX: Bonos perpetuos  
ZCP o U: Cupón cero

### Note 3 - Comisiones de gestión

Candriam Luxembourg, sociedad comanditaria por acciones de Derecho luxemburgués, con Domicilio social en SERENITY - Bloc B, 19-21, Route d'Arlon à 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 denunciar dicho contrato y notificárselo a la otra parte por correo certificado con acuse de recibo, con un preaviso de 90 días.

Candriam Luxembourg es una filial de Candriam Group, entidad del Grupo New York Life Insurance Company. Recibió la aprobación de la Sociedad Gestora en el sentido de lo dispuesto en el capítulo 15 de la Ley de 2010 relativa a los OIC y está autorizada a ejercer las actividades de gestión colectiva de carteras de inversión y de asesoramiento en inversiones.

Por medio de un contrato de delegación, la Sociedad Gestora delegó la aplicación de la gestión de la cartera de algunos compartimentos de la SICAV, bajo su control y su responsabilidad y corriendo con todos los gastos, en su filial belga Candriam Belgium, cuyo Domicilio social se encuentra situado en 58, Avenue des Arts, B-1000 Bruselas. Dicho contrato puede ser rescindido por ambas partes mediante notificación escrita con un plazo de antelación de 90 días.

Los compartimentos correspondientes son los siguientes:

Candriam Bonds Euro, Candriam Bonds Euro Corporate ex-Financials, Candriam Bonds Euro Diversified, Candriam Bonds Euro Government, Candriam Bonds Euro Long Term, Candriam Bonds Euro Short Term, Candriam Bonds Floating Rate Notes, Candriam Bonds Global Government, Candriam Bonds Global Inflation Short Duration, Candriam Bonds International, Candriam Bonds Total Return Defensive.

Por medio de un contrato de delegación, la Sociedad Gestora delegó la aplicación de la gestión de la cartera de algunos otros compartimentos de la SICAV, bajo su control y su responsabilidad y corriendo con todos los gastos, en su filial francesa Candriam France, una sociedad por acciones simplificada, cuyo Domicilio social se encuentra situado en 40, rue Washington, F-75408 París Cedex 08. Este contrato puede ser rescindido por ambas partes con un preaviso por escrito de 90 días. Candriam France, una sociedad por acciones simplificada. Sociedad Gestora de carteras constituida en Francia en 1988 por un período definido.

Los compartimentos correspondientes son los siguientes:

Candriam Bonds Capital Securities, Candriam Bonds Convertible Defensive, Candriam Bonds Credit Alpha, Candriam Bonds Credit Opportunities, Candriam Bonds Euro Corporate, Candriam Bonds Euro High Yield and Candriam Bonds Global High Yield.

# Candriam Bonds

## Otras notas a los estados financieros

### Note 3 - Comisiones de gestión

La Sociedad Gestora delegó una parte de la implementación de la gestión de carteras de los compartimentos Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies, Candriam Bonds Emerging Markets. Candriam Bonds Emerging Markets Total Return y Candriam Bonds Total Return a Candriam Belgium y confió la otra parte a su sucursal británica, UK establishment. 200 Aldersgate, Aldersgate Street, London EC1A4HD, United Kingdom.

Los tipos en vigor a 30 de junio de 2021 son:

| Compartimentos                                | Clase de acciones | Tipo de acción | ISIN         | Comisiones de gestión |
|-----------------------------------------------|-------------------|----------------|--------------|-----------------------|
| Candriam Bonds Capital Securities             | C                 | Capitalización | LU1616742737 | 1,00%                 |
|                                               | I                 | Capitalización | LU1616743388 | 0,40%                 |
|                                               | R                 | Capitalización | LU1616743545 | 0,50%                 |
|                                               | Z                 | Capitalización | LU1616743974 | 0,00%                 |
| Candriam Bonds Convertible Defensive          | C                 | Capitalización | LU0459959929 | 0,75%                 |
|                                               | C                 | Distribución   | LU0459960000 | 0,75%                 |
|                                               | I                 | Capitalización | LU0459960182 | 0,35%                 |
|                                               | R2                | Capitalización | LU1410483926 | 0,30%                 |
|                                               | R2                | Distribución   | LU1410484064 | 0,30%                 |
|                                               | Z                 | Capitalización | LU0459960349 | 0,00%                 |
| Candriam Bonds Credit Alpha                   | C                 | Capitalización | LU2098772366 | 1,00%                 |
|                                               | I                 | Capitalización | LU2098772523 | 0,55%                 |
|                                               | R                 | Capitalización | LU2098773331 | 0,55%                 |
|                                               | S                 | Capitalización | LU2098774065 | 0,04%                 |
|                                               | V                 | Capitalización | LU2098774149 | 0,45%                 |
|                                               | Z                 | Capitalización | LU2098774222 | 0,00%                 |
| Candriam Bonds Credit Opportunities           | C                 | Capitalización | LU0151324422 | 1,00%                 |
|                                               | C                 | Distribución   | LU0151324851 | 1,00%                 |
|                                               | C USD H           | Capitalización | LU1375972251 | 1,00%                 |
|                                               | CQ                | Distribución   | LU1269889157 | 1,00%                 |
|                                               | I                 | Capitalización | LU0151325312 | 0,50%                 |
|                                               | I USD H           | Capitalización | LU1375972335 | 0,50%                 |
|                                               | IQ                | Distribución   | LU1269889314 | 0,50%                 |
|                                               | N                 | Capitalización | LU0151324935 | 1,60%                 |
|                                               | R                 | Capitalización | LU1120697633 | 0,50%                 |
|                                               | R CHF H           | Capitalización | LU1184245659 | 0,50%                 |
|                                               | R GBP             | Capitalización | LU1184245493 | 0,50%                 |
|                                               | R2                | Capitalización | LU1410484494 | 0,40%                 |
|                                               | R2                | Distribución   | LU1410484577 | 0,40%                 |
|                                               | S                 | Capitalización | LU0151333506 | 0,25%                 |
|                                               | S3                | Capitalización | LU2026166152 | 0,40%                 |
|                                               | Z                 | Capitalización | LU0252969745 | 0,00%                 |
| Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies | C                 | Capitalización | LU0616945522 | 1,00%                 |
|                                               | C                 | Distribución   | LU0616945795 | 1,00%                 |
|                                               | C EUR             | Capitalización | LU0616945282 | 1,00%                 |
|                                               | C EUR             | Distribución   | LU0616945449 | 1,00%                 |
|                                               | CQ                | Distribución   | LU1269889405 | 1,00%                 |
|                                               | I                 | Capitalización | LU0616946090 | 0,55%                 |
|                                               | I EUR             | Capitalización | LU0616945878 | 0,55%                 |
|                                               | I EUR H           | Capitalización | LU1258426821 | 0,55%                 |
|                                               | N EUR             | Capitalización | LU0616946256 | 1,60%                 |
|                                               | R                 | Capitalización | LU0942152934 | 0,65%                 |
|                                               | R EUR             | Capitalización | LU1184246038 | 0,65%                 |
|                                               | R GBP             | Capitalización | LU1184246202 | 0,65%                 |
|                                               | R2                | Distribución   | LU1410485038 | 0,25%                 |
|                                               | R2 EUR            | Distribución   | LU1410485202 | 0,25%                 |
|                                               | V                 | Capitalización | LU0616946504 | 0,30%                 |
|                                               | Z                 | Capitalización | LU0616946769 | 0,00%                 |
|                                               | Z EUR             | Capitalización | LU0616946686 | 0,00%                 |
| Candriam Bonds Emerging Markets               | C                 | Capitalización | LU0083568666 | 1,00%                 |
|                                               | C                 | Distribución   | LU0083569045 | 1,00%                 |
|                                               | C EUR H           | Capitalización | LU0594539719 | 1,00%                 |
|                                               | CQ                | Distribución   | LU1269889587 | 1,00%                 |
|                                               | I                 | Capitalización | LU0144746764 | 0,55%                 |

# Candriam Bonds

## Otras notas a los estados financieros

### Note 3 - Comisiones de gestión

| Compartimentos                               | Clase de acciones | Tipo de acción | ISIN         | Comisiones de gestión |
|----------------------------------------------|-------------------|----------------|--------------|-----------------------|
| Candriam Bonds Emerging Markets              | I                 | Distribución   | LU1184247275 | 0,55%                 |
|                                              | I EUR             | Capitalización | LU1184247432 | 0,55%                 |
|                                              | I EUR H           | Capitalización | LU0594539982 | 0,55%                 |
|                                              | I GBP             | Capitalización | LU1120698953 | 0,65%                 |
|                                              | IQ EUR H          | Distribución   | LU1490969497 | 0,55%                 |
|                                              | IQ GBP H          | Distribución   | LU1410492919 | 0,65%                 |
|                                              | L                 | Capitalización | LU0574791835 | 1,00%                 |
|                                              | N                 | Capitalización | LU0144751251 | 1,60%                 |
|                                              | R                 | Capitalización | LU0942153155 | 0,65%                 |
|                                              | R CHF H           | Capitalización | LU1258427126 | 0,65%                 |
|                                              | R EUR             | Capitalización | LU1184246624 | 0,65%                 |
|                                              | R EUR H           | Capitalización | LU1764521966 | 0,65%                 |
|                                              | R GBP H           | Capitalización | LU1184246970 | 0,65%                 |
|                                              | RQ                | Distribución   | LU2178471681 | 0,65%                 |
|                                              | R2                | Capitalización | LU1410485897 | 0,25%                 |
|                                              | R2                | Distribución   | LU1410485970 | 0,25%                 |
|                                              | R2 EUR H          | Capitalización | LU1410486192 | 0,25%                 |
|                                              | V EUR             | Capitalización | LU0891848607 | 0,30%                 |
|                                              | V EUR H           | Capitalización | LU0616945100 | 0,30%                 |
|                                              | V2                | Capitalización | LU1410485624 | 0,44%                 |
|                                              | V2 GBP            | Capitalización | LU1708110207 | 0,50%                 |
|                                              | V2Q GBP H         | Distribución   | LU1708110462 | 0,50%                 |
|                                              | Z                 | Capitalización | LU0252942387 | 0,00%                 |
|                                              | Z                 | Distribución   | LU1410485467 | 0,00%                 |
|                                              | Z EUR H           | Capitalización | LU1582239619 | 0,00%                 |
| Candriam Bonds Emerging Markets Corporate    | C                 | Capitalización | LU2026166749 | 1,20%                 |
|                                              | C                 | Distribución   | LU2026166822 | 1,20%                 |
|                                              | I                 | Capitalización | LU2026167127 | 0,55%                 |
|                                              | I                 | Distribución   | LU2026167390 | 0,00%                 |
|                                              | I EUR H           | Capitalización | LU2026167473 | 0,55%                 |
|                                              | I2                | Capitalización | LU2026167556 | 0,65%                 |
|                                              | R                 | Capitalización | LU2026167804 | 0,65%                 |
|                                              | R2                | Capitalización | LU2026169503 | 0,30%                 |
|                                              | R2                | Distribución   | LU2092203855 | 0,30%                 |
|                                              | Z                 | Capitalización | LU2026170006 | 0,00%                 |
| Candriam Bonds Emerging Markets Total Return | Z                 | Distribución   | LU2026170188 | 0,00%                 |
|                                              | C                 | Capitalización | LU1708105629 | 1,00%                 |
|                                              | C EUR H           | Capitalización | LU1708106270 | 0,00%                 |
|                                              | I                 | Capitalización | LU1708106601 | 0,45%                 |
|                                              | I EUR H           | Capitalización | LU1708107161 | 0,45%                 |
|                                              | R                 | Capitalización | LU1708107831 | 0,55%                 |
| Candriam Bonds Euro                          | Z                 | Capitalización | LU1708109290 | 0,00%                 |
|                                              | C                 | Capitalización | LU0011975413 | 0,60%                 |
|                                              | C                 | Distribución   | LU0011975330 | 0,60%                 |
|                                              | I                 | Capitalización | LU0144743829 | 0,20%                 |
|                                              | R                 | Capitalización | LU0942153239 | 0,30%                 |
|                                              | R2                | Capitalización | LU1410486432 | 0,15%                 |
|                                              | V                 | Capitalización | LU0391256418 | 0,12%                 |
|                                              | Z                 | Capitalización | LU0252943781 | 0,00%                 |
| Candriam Bonds Euro Corporate                | Z                 | Distribución   | LU1410486275 | 0,00%                 |
|                                              | C                 | Capitalización | LU0237839757 | 0,60%                 |
|                                              | C                 | Distribución   | LU0237840094 | 0,60%                 |
|                                              | I                 | Capitalización | LU0237841142 | 0,30%                 |
|                                              | N                 | Capitalización | LU0237840680 | 1,00%                 |
|                                              | R                 | Capitalización | LU0942153403 | 0,40%                 |
|                                              | Z                 | Capitalización | LU0252947006 | 0,00%                 |
| Candriam Bonds Euro Diversified              | Z                 | Distribución   | LU1410487083 | 0,00%                 |
|                                              | C                 | Capitalización | LU0093577855 | 0,60%                 |
|                                              | C                 | Distribución   | LU0093578077 | 0,60%                 |
|                                              | I                 | Capitalización | LU0144744124 | 0,20%                 |

# Candriam Bonds

## Otras notas a los estados financieros

### Note 3 - Comisiones de gestión

| Compartimentos                     | Clase de acciones | Tipo de acción | ISIN         | Comisiones de gestión |
|------------------------------------|-------------------|----------------|--------------|-----------------------|
| Candriam Bonds Euro Diversified    | R                 | Capitalización | LU1269890080 | 0,30%                 |
|                                    | R2                | Distribución   | LU1410488057 | 0,15%                 |
|                                    | Z                 | Capitalización | LU0252961767 | 0,00%                 |
| Candriam Bonds Euro Government     | C                 | Capitalización | LU0157930404 | 0,60%                 |
|                                    | C                 | Distribución   | LU0157930313 | 0,60%                 |
|                                    | I                 | Capitalización | LU0156671926 | 0,20%                 |
|                                    | I                 | Distribución   | LU1258427555 | 0,20%                 |
|                                    | N                 | Capitalización | LU0156671843 | 0,80%                 |
|                                    | R                 | Capitalización | LU1269889744 | 0,30%                 |
|                                    | R2                | Distribución   | LU1410487752 | 0,00%                 |
|                                    | Z                 | Capitalización | LU0252949713 | 0,00%                 |
| Candriam Bonds Euro High Yield     | Z                 | Distribución   | LU1410487836 | 0,00%                 |
|                                    | C                 | Capitalización | LU0012119607 | 1,00%                 |
|                                    | C                 | Distribución   | LU0012119789 | 1,00%                 |
|                                    | C USD H           | Capitalización | LU1258428280 | 1,00%                 |
|                                    | CQ                | Distribución   | LU1269890163 | 1,00%                 |
|                                    | I                 | Capitalización | LU0144746509 | 0,60%                 |
|                                    | I                 | Distribución   | LU1258427985 | 0,60%                 |
|                                    | I GBP             | Capitalización | LU1184247861 | 0,60%                 |
|                                    | I USD H           | Capitalización | LU1375972509 | 0,60%                 |
|                                    | L                 | Capitalización | LU0574792569 | 1,00%                 |
|                                    | N                 | Capitalización | LU0144751095 | 1,40%                 |
|                                    | R                 | Capitalización | LU0942153742 | 0,65%                 |
|                                    | R CHF H           | Capitalización | LU1258428017 | 0,65%                 |
|                                    | R GBP             | Capitalización | LU1184247606 | 0,65%                 |
|                                    | RQ                | Distribución   | LU1375972848 | 0,65%                 |
|                                    | RQ GBP H          | Distribución   | LU1375972921 | 0,65%                 |
|                                    | R2                | Capitalización | LU1410488487 | 0,25%                 |
|                                    | R2                | Distribución   | LU1410488560 | 0,25%                 |
|                                    | S                 | Capitalización | LU1432307756 | 0,35%                 |
|                                    | S                 | Distribución   | LU1010337324 | 0,35%                 |
|                                    | S CHF H           | Capitalización | LU2130893154 | 0,35%                 |
|                                    | S GBP H           | Capitalización | LU2130893238 | 0,35%                 |
|                                    | S USD H           | Capitalización | LU2130892933 | 0,35%                 |
|                                    | S USD H           | Distribución   | LU2130893071 | 0,35%                 |
|                                    | S2                | Capitalización | LU1633811333 | 0,26%                 |
|                                    | S4                | Capitalización | LU1410488305 | 0,33%                 |
|                                    | V                 | Capitalización | LU0891843558 | 0,30%                 |
|                                    | Z                 | Capitalización | LU0252971055 | 0,00%                 |
| Candriam Bonds Euro Long Term      | C                 | Capitalización | LU0077500055 | 0,60%                 |
|                                    | C                 | Distribución   | LU0108056432 | 0,60%                 |
|                                    | I                 | Capitalización | LU0144745956 | 0,20%                 |
|                                    | Z                 | Capitalización | LU0252963110 | 0,00%                 |
| Candriam Bonds Euro Short Term     | C                 | Capitalización | LU0157929810 | 0,40%                 |
|                                    | C                 | Distribución   | LU0157929737 | 0,40%                 |
|                                    | I                 | Capitalización | LU0156671504 | 0,20%                 |
|                                    | I                 | Distribución   | LU0594540485 | 0,20%                 |
|                                    | N                 | Capitalización | LU0156671413 | 0,80%                 |
|                                    | R                 | Capitalización | LU1269890593 | 0,25%                 |
|                                    | R2                | Distribución   | LU1410489881 | 0,10%                 |
|                                    | S                 | Capitalización | LU1184248083 | 0,12%                 |
|                                    | Z                 | Capitalización | LU0252964431 | 0,00%                 |
| Candriam Bonds Floating Rate Notes | BF                | Capitalización | LU2178471418 | 0,00%                 |
|                                    | C                 | Capitalización | LU1838941372 | 0,30%                 |
|                                    | I                 | Capitalización | LU1838941539 | 0,15%                 |
|                                    | PI                | Capitalización | LU1838941703 | 0,08%                 |
|                                    | R                 | Capitalización | LU1838941612 | 0,15%                 |
|                                    | R2                | Distribución   | LU2240495791 | 0,08%                 |
|                                    | V                 | Capitalización | LU1838941885 | 0,10%                 |
|                                    | Z                 | Capitalización | LU1838941968 | 0,00%                 |

# Candriam Bonds

## Otras notas a los estados financieros

### Note 3 - Comisiones de gestión

| Compartimentos                                 | Clase de acciones | Tipo de acción | ISIN         | Comisiones de gestión |
|------------------------------------------------|-------------------|----------------|--------------|-----------------------|
| Candriam Bonds Global Government               | C                 | Capitalización | LU0157931550 | 0,60%                 |
|                                                | C                 | Distribución   | LU0157931394 | 0,60%                 |
|                                                | I                 | Capitalización | LU0156673039 | 0,20%                 |
|                                                | I AH              | Capitalización | LU0391256509 | 0,20%                 |
|                                                | R                 | Capitalización | LU2043253751 | 0,30%                 |
|                                                | Z                 | Capitalización | LU0252978738 | 0,00%                 |
| Candriam Bonds Global High Yield               | C                 | Capitalización | LU0170291933 | 1,00%                 |
|                                                | C                 | Distribución   | LU0170293392 | 1,00%                 |
|                                                | CQ                | Distribución   | LU1269891567 | 1,00%                 |
|                                                | I                 | Capitalización | LU0170293806 | 0,55%                 |
|                                                | I USD H           | Capitalización | LU1599350359 | 0,55%                 |
|                                                | N                 | Capitalización | LU0170293632 | 1,60%                 |
|                                                | R                 | Capitalización | LU1269891641 | 0,65%                 |
|                                                | RQ GBP            | Distribución   | LU1375973226 | 0,65%                 |
|                                                | RQ GBP H          | Distribución   | LU1375973143 | 0,65%                 |
|                                                | R2                | Capitalización | LU1410489964 | 0,25%                 |
|                                                | R2                | Distribución   | LU1410490038 | 0,25%                 |
|                                                | V                 | Capitalización | LU0891839952 | 0,30%                 |
|                                                | Z                 | Capitalización | LU0252968697 | 0,00%                 |
| Candriam Bonds Global Inflation Short Duration | C                 | Capitalización | LU0165520114 | 0,60%                 |
|                                                | C                 | Distribución   | LU0165520973 | 0,60%                 |
|                                                | I                 | Capitalización | LU0165522086 | 0,30%                 |
|                                                | R                 | Capitalización | LU0942153825 | 0,30%                 |
|                                                | R2                | Capitalización | LU1410488990 | 0,15%                 |
|                                                | R2                | Distribución   | LU1410489022 | 0,15%                 |
|                                                | Z                 | Capitalización | LU0252962658 | 0,00%                 |
| Candriam Bonds International                   | C                 | Capitalización | LU0012119433 | 0,60%                 |
|                                                | C                 | Distribución   | LU0012119516 | 0,60%                 |
|                                                | I                 | Capitalización | LU0144746335 | 0,30%                 |
|                                                | R                 | Capitalización | LU1269891724 | 0,40%                 |
|                                                | R2                | Capitalización | LU1410491358 | 0,15%                 |
|                                                | Z                 | Capitalización | LU0252972020 | 0,00%                 |
| Candriam Bonds Total Return                    | C                 | Capitalización | LU0252128276 | 0,75%                 |
|                                                | C                 | Distribución   | LU0252129167 | 0,75%                 |
|                                                | C USD H           | Capitalización | LU1184248596 | 0,75%                 |
|                                                | CQ                | Distribución   | LU1269892029 | 0,75%                 |
|                                                | I                 | Capitalización | LU0252132039 | 0,50%                 |
|                                                | I                 | Distribución   | LU1120698102 | 0,50%                 |
|                                                | I USD H           | Capitalización | LU1184249644 | 0,50%                 |
|                                                | N                 | Capitalización | LU0252131148 | 1,10%                 |
|                                                | R                 | Capitalización | LU1184248752 | 0,40%                 |
|                                                | R GBP H           | Capitalización | LU1184248919 | 0,40%                 |
|                                                | R2                | Capitalización | LU1410491788 | 0,19%                 |
|                                                | R2                | Distribución   | LU1410491861 | 0,19%                 |
|                                                | S                 | Capitalización | LU1511858513 | 0,40%                 |
|                                                | S                 | Distribución   | LU1511858430 | 0,40%                 |
|                                                | S GBP H           | Capitalización | LU1582239882 | 0,40%                 |
|                                                | Z                 | Capitalización | LU0252136964 | 0,00%                 |
|                                                | Z USD H           | Capitalización | LU1546486744 | 0,00%                 |

Tipo de la comisión de distribución específica relativa a las clases de acciones L (capitalización):

- Candriam Bonds Emerging Markets : 0,07%

- Candriam Bonds Euro High Yield : 0,05%

La siguiente tabla resume las tasas anuales de comisión de gestión aplicadas a las OIC creadas por los diferentes subfondos de Candriam Bonds el 30 de junio de 2021.

|                                                       |       |
|-------------------------------------------------------|-------|
| Candriam Bonds Capital Securities Z C                 | 0,00% |
| Candriam Bonds Convertible Defensive Z C              | 0,00% |
| Candriam Bonds Credit Alpha Z C                       | 0,00% |
| Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies Z C     | 0,00% |
| Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies Z EUR C | 0,00% |

## Otras notas a los estados financieros

### Note 3 - Comisiones de gestión

|                                                                       |       |
|-----------------------------------------------------------------------|-------|
| Candriam Bonds Emerging Markets Corporate I EUR H C                   | 0,65% |
| Candriam Bonds Emerging Markets Corporate Z C                         | 0,00% |
| Candriam Bonds Emerging Markets Total Return Z C                      | 0,00% |
| Candriam Bonds Emerging Markets Z EUR H C                             | 0,00% |
| Candriam Bonds Euro Long Term Z C                                     | 0,00% |
| Candriam Bonds Floating Rate Notes I C                                | 0,25% |
| Candriam Bonds Floating Rate Notes V C                                | 0,15% |
| Candriam Bonds Global Inflation Short Duration Z C                    | 0,00% |
| Candriam Bonds Total Return I C                                       | 0,60% |
| Candriam Long Short Credit R EUR cap                                  | 0,70% |
| Candriam Monétaire SICAV V EUR cap                                    | 0,15% |
| Candriam Monétaire SICAV Z C                                          | 0,15% |
| Candriam Money Market Euro AAA Z C                                    | 0,00% |
| Candriam Money Market Euro Z C                                        | 0,00% |
| Candriam Money Market USD Z C                                         | 0,00% |
| Candriam Sustainable Bond Emerging Markets I C                        | 0,65% |
| Candriam Sustainable Bond Euro Z C                                    | 0,00% |
| Candriam Sustainable Bond Global R AH C                               | 0,40% |
| Candriam Sustainable Bond Global V AH C                               | 0,25% |
| Candriam Sustainable Bond Global V USD AH C                           | 0,25% |
| Candriam Sustainable Bond Global VQ AH D                              | 0,25% |
| Cleome Index Euro Long Term Bonds I C                                 | 0,15% |
| Cleome Index Euro Long Term Bonds Z C                                 | 0,00% |
| Cleome Index Euro Short Term Bonds Z C                                | 0,00% |
| G Fund European Convertible Bonds IC EUR                              | 0,50% |
| GaveKal China Fixed Income Fund RMB CNH cap                           | 0,50% |
| ishares China CNY Bond UCITS ETF USD cap                              | 0,35% |
| JPM Funds - Global Convertibles Fund I EUR cap                        | 0,75% |
| Schroder International Selection Fund Global Convertible Bond C EUR H | 0,75% |
| UBAM - Global Convertible Bond IC EUR                                 | 0,90% |

### Note 4 - Gastos Operativos y Administrativos

La SICAV corre con los gastos operativos y administrativos corrientes en los que se haya incurrido para cubrir todos los gastos fijos y variables, costes, comisiones y demás gastos, según se definen a continuación (los "Gastos Operativos y Administrativos").

Los Gastos Operativos y Administrativos abarcan los gastos siguientes, sin que esta lista sea exhaustiva:

a) gastos en los que ha incurrido directamente la SICAV, incluidos, entre otros, las comisiones y gastos del Banco Depositario, las comisiones y costes de los auditores, los costes de cobertura de las acciones ("share class hedging"), incluidos aquellos facturados por la Sociedad Gestora, los honorarios pagados a los Consejeros, así como los costes y gastos razonables incurridos por o para los Consejeros;

b) una "comisión por servicios de inversión" abonada a la Sociedad Gestora que incluye el importe restante de los Gastos Operativos y Administrativos tras deducir los gastos detallados en la sección (a) anterior, es decir, entre otros, las comisiones y gastos del Agente Domiciliario, del Agente Administrativo, del Agente de Transferencias y Tenedor del Registro, del Agente de Pagos Principal, los costes relacionados con el registro y mantenimiento de dicho registro en todas las jurisdicciones (como las comisiones percibidas por las autoridades de control pertinentes, los gastos de traducción y la remuneración de los representantes en el extranjero y de los agentes de pago locales), los gastos de inscripción y de mantenimiento en Bolsa, el coste de publicación de las cotizaciones, el franqueo, los costes de telecomunicaciones, los costes de preparación, impresión, traducción y distribución de los folletos informativos, de los documentos de datos fundamentales para el inversor, de las notificaciones a los accionistas, de los informes financieros o de todo otro documento destinado a los accionistas, los honorarios y costes legales, los gastos y costes relacionados con la suscripción de cualquier abono/licencia o todo otro recurso a informaciones o datos de pago, los gastos generados por el uso de una marca depositada por la SICAV, los gastos con servicios de análisis y comisiones atribuibles a la Sociedad Gestora y/o a sus delegados y/o a todo otro agente nombrado por la propia SICAV y/o a expertos independientes.

Los Gastos Operativos y Administrativos se expresan en porcentaje anual del valor liquidativo medio de cada clase de acciones.

A final de un período determinado, si los costos y gastos reales fuesen superiores al porcentaje de los Gastos Operativos y Administrativos fijado para una clase de acciones, entonces la Sociedad Gestora se hará cargo de la diferencia. Por el contrario, si los costos y gastos reales fuesen inferiores al porcentaje de los Gastos Operativos y Administrativos fijado para una clase de acciones, la Sociedad Gestora conservaría la diferencia.

La Sociedad Gestora podrá dar instrucciones a la SICAV para proceder al pago de todos o parte de los gastos según se enumeran anteriormente directamente sobre sus activos. En tal caso, el importe de los Gastos Operativos y Administrativos se reducirá en consecuencia.

Los tipos máximos en vigor a 30 de junio de 2021 son:

# Candriam Bonds

## Otras notas a los estados financieros

### Note 4 - Gastos Operativos y Administrativos

| Compartimentos                                | Clase de acciones | Tipo de acción | ISIN         | MAX   |
|-----------------------------------------------|-------------------|----------------|--------------|-------|
| Candriam Bonds Capital Securities             | C                 | Capitalización | LU1616742737 | 0,35% |
|                                               | I                 | Capitalización | LU1616743388 | 0,28% |
|                                               | R                 | Capitalización | LU1616743545 | 0,35% |
|                                               | Z                 | Capitalización | LU1616743974 | 0,28% |
| Candriam Bonds Convertible Defensive          | C                 | Capitalización | LU0459959929 | 0,29% |
|                                               | C                 | Distribución   | LU0459960000 | 0,29% |
|                                               | I                 | Capitalización | LU0459960182 | 0,23% |
|                                               | R2                | Capitalización | LU1410483926 | 0,29% |
|                                               | R2                | Distribución   | LU1410484064 | 0,29% |
|                                               | Z                 | Capitalización | LU0459960349 | 0,23% |
| Candriam Bonds Credit Alpha                   | C                 | Capitalización | LU2098772366 | 0,33% |
|                                               | I                 | Capitalización | LU2098772523 | 0,25% |
|                                               | R                 | Capitalización | LU2098773331 | 0,33% |
|                                               | S                 | Capitalización | LU2098774065 | 0,25% |
|                                               | V                 | Capitalización | LU2098774149 | 0,25% |
|                                               | Z                 | Capitalización | LU2098774222 | 0,25% |
| Candriam Bonds Credit Opportunities           | C                 | Capitalización | LU0151324422 | 0,33% |
|                                               | C                 | Distribución   | LU0151324851 | 0,33% |
|                                               | C USD H           | Capitalización | LU1375972251 | 0,33% |
|                                               | CQ                | Distribución   | LU1269889157 | 0,33% |
|                                               | I                 | Capitalización | LU0151325312 | 0,25% |
|                                               | I USD H           | Capitalización | LU1375972335 | 0,25% |
|                                               | IQ                | Distribución   | LU1269889314 | 0,25% |
|                                               | N                 | Capitalización | LU0151324935 | 0,33% |
|                                               | R                 | Capitalización | LU1120697633 | 0,33% |
|                                               | R CHF H           | Capitalización | LU1184245659 | 0,33% |
|                                               | R GBP             | Capitalización | LU1184245493 | 0,33% |
|                                               | R2                | Capitalización | LU1410484494 | 0,33% |
|                                               | R2                | Distribución   | LU1410484577 | 0,33% |
|                                               | S                 | Capitalización | LU0151333506 | 0,25% |
|                                               | S3                | Capitalización | LU2026166152 | 0,25% |
|                                               | Z                 | Capitalización | LU0252969745 | 0,25% |
| Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies | C                 | Capitalización | LU0616945522 | 0,35% |
|                                               | C                 | Distribución   | LU0616945795 | 0,35% |
|                                               | C EUR             | Capitalización | LU0616945282 | 0,35% |
|                                               | C EUR             | Distribución   | LU0616945449 | 0,35% |
|                                               | CQ                | Distribución   | LU1269889405 | 0,35% |
|                                               | I                 | Capitalización | LU0616946090 | 0,28% |
|                                               | I EUR             | Capitalización | LU0616945878 | 0,28% |
|                                               | I EUR H           | Capitalización | LU1258426821 | 0,28% |
|                                               | N EUR             | Capitalización | LU0616946256 | 0,35% |
|                                               | R                 | Capitalización | LU0942152934 | 0,35% |
|                                               | R EUR             | Capitalización | LU1184246038 | 0,35% |
|                                               | R GBP             | Capitalización | LU1184246202 | 0,35% |
|                                               | R2                | Distribución   | LU1410485038 | 0,35% |
|                                               | R2 EUR            | Distribución   | LU1410485202 | 0,35% |
|                                               | V                 | Capitalización | LU0616946504 | 0,28% |
|                                               | Z                 | Capitalización | LU0616946769 | 0,28% |
|                                               | Z EUR             | Capitalización | LU0616946686 | 0,28% |
| Candriam Bonds Emerging Markets               | C                 | Capitalización | LU0083568666 | 0,35% |
|                                               | C                 | Distribución   | LU0083569045 | 0,35% |
|                                               | C EUR H           | Capitalización | LU0594539719 | 0,35% |
|                                               | CQ                | Distribución   | LU1269889587 | 0,35% |
|                                               | I                 | Capitalización | LU0144746764 | 0,28% |
|                                               | I                 | Distribución   | LU1184247275 | 0,28% |
|                                               | I EUR             | Capitalización | LU1184247432 | 0,28% |
|                                               | I EUR H           | Capitalización | LU0594539982 | 0,28% |
|                                               | I GBP             | Capitalización | LU1120698953 | 0,28% |
|                                               | IQ EUR H          | Distribución   | LU1490969497 | 0,28% |
|                                               | IQ GBP H          | Distribución   | LU1410492919 | 0,28% |

# Candriam Bonds

## Otras notas a los estados financieros

### Note 4 - Gastos Operativos y Administrativos

| Compartimentos                               | Clase de acciones | Tipo de acción | ISIN         | MAX   |
|----------------------------------------------|-------------------|----------------|--------------|-------|
| Candriam Bonds Emerging Markets              | L                 | Capitalización | LU0574791835 | 0,35% |
|                                              | N                 | Capitalización | LU0144751251 | 0,35% |
|                                              | R                 | Capitalización | LU0942153155 | 0,35% |
|                                              | R CHF H           | Capitalización | LU1258427126 | 0,35% |
|                                              | R EUR             | Capitalización | LU1184246624 | 0,35% |
|                                              | R EUR H           | Capitalización | LU1764521966 | 0,35% |
|                                              | R GBP H           | Capitalización | LU1184246970 | 0,35% |
|                                              | RQ                | Distribución   | LU2178471681 | 0,35% |
|                                              | R2                | Capitalización | LU1410485897 | 0,35% |
|                                              | R2                | Distribución   | LU1410485970 | 0,35% |
|                                              | R2 EUR H          | Capitalización | LU1410486192 | 0,35% |
|                                              | V EUR             | Capitalización | LU0891848607 | 0,28% |
|                                              | V EUR H           | Capitalización | LU0616945100 | 0,28% |
|                                              | V2                | Capitalización | LU1410485624 | 0,28% |
|                                              | V2 GBP            | Capitalización | LU1708110207 | 0,28% |
|                                              | V2Q GBP H         | Distribución   | LU1708110462 | 0,28% |
|                                              | Z                 | Capitalización | LU0252942387 | 0,28% |
|                                              | Z                 | Distribución   | LU1410485467 | 0,28% |
|                                              | Z EUR H           | Capitalización | LU1582239619 | 0,28% |
| Candriam Bonds Emerging Markets Corporate    | C                 | Capitalización | LU2026166749 | 0,35% |
|                                              | C                 | Distribución   | LU2026166822 | 0,35% |
|                                              | I                 | Capitalización | LU2026167127 | 0,28% |
|                                              | I                 | Distribución   | LU2026167390 | 0,28% |
|                                              | I EUR H           | Capitalización | LU2026167473 | 0,28% |
|                                              | I2                | Capitalización | LU2026167556 | 0,28% |
|                                              | R                 | Capitalización | LU2026167804 | 0,35% |
|                                              | R2                | Capitalización | LU2026169503 | 0,35% |
|                                              | R2                | Distribución   | LU2092203855 | 0,35% |
|                                              | Z                 | Capitalización | LU2026170006 | 0,28% |
|                                              | Z                 | Distribución   | LU2026170188 | 0,28% |
| Candriam Bonds Emerging Markets Total Return | C                 | Capitalización | LU1708105629 | 0,35% |
|                                              | C EUR H           | Capitalización | LU1708106270 | 0,35% |
|                                              | I                 | Capitalización | LU1708106601 | 0,28% |
|                                              | I EUR H           | Capitalización | LU1708107161 | 0,28% |
|                                              | R                 | Capitalización | LU1708107831 | 0,35% |
|                                              | Z                 | Capitalización | LU1708109290 | 0,28% |
| Candriam Bonds Euro                          | C                 | Capitalización | LU0011975413 | 0,29% |
|                                              | C                 | Distribución   | LU0011975330 | 0,29% |
|                                              | I                 | Capitalización | LU0144743829 | 0,23% |
|                                              | R                 | Capitalización | LU0942153239 | 0,29% |
|                                              | R2                | Capitalización | LU1410486432 | 0,29% |
|                                              | V                 | Capitalización | LU0391256418 | 0,23% |
|                                              | Z                 | Capitalización | LU0252943781 | 0,23% |
|                                              | Z                 | Distribución   | LU1410486275 | 0,23% |
| Candriam Bonds Euro Corporate                | C                 | Capitalización | LU0237839757 | 0,29% |
|                                              | C                 | Distribución   | LU0237840094 | 0,29% |
|                                              | I                 | Capitalización | LU0237841142 | 0,23% |
|                                              | N                 | Capitalización | LU0237840680 | 0,29% |
|                                              | R                 | Capitalización | LU0942153403 | 0,29% |
|                                              | Z                 | Capitalización | LU0252947006 | 0,23% |
|                                              | Z                 | Distribución   | LU1410487083 | 0,00% |
| Candriam Bonds Euro Diversified              | C                 | Capitalización | LU0093577855 | 0,33% |
|                                              | C                 | Distribución   | LU0093578077 | 0,33% |
|                                              | I                 | Capitalización | LU0144744124 | 0,25% |
|                                              | R                 | Capitalización | LU1269890080 | 0,33% |
|                                              | R2                | Distribución   | LU1410488057 | 0,33% |
|                                              | Z                 | Capitalización | LU0252961767 | 0,25% |
| Candriam Bonds Euro Government               | C                 | Capitalización | LU0157930404 | 0,33% |
|                                              | C                 | Distribución   | LU0157930313 | 0,33% |
|                                              | I                 | Capitalización | LU0156671926 | 0,25% |

# Candriam Bonds

## Otras notas a los estados financieros

### Note 4 - Gastos Operativos y Administrativos

| Compartimentos                     | Clase de acciones | Tipo de acción | ISIN         | MAX   |
|------------------------------------|-------------------|----------------|--------------|-------|
| Candriam Bonds Euro Government     | I                 | Distribución   | LU1258427555 | 0,25% |
|                                    | N                 | Capitalización | LU0156671843 | 0,33% |
|                                    | R                 | Capitalización | LU1269889744 | 0,33% |
|                                    | R2                | Distribución   | LU1410487752 | 0,33% |
|                                    | Z                 | Capitalización | LU0252949713 | 0,25% |
|                                    | Z                 | Distribución   | LU1410487836 | 0,25% |
| Candriam Bonds Euro High Yield     | C                 | Capitalización | LU0012119607 | 0,35% |
|                                    | C                 | Distribución   | LU0012119789 | 0,35% |
|                                    | C USD H           | Capitalización | LU1258428280 | 0,35% |
|                                    | CQ                | Distribución   | LU1269890163 | 0,35% |
|                                    | I                 | Capitalización | LU0144746509 | 0,28% |
|                                    | I                 | Distribución   | LU1258427985 | 0,28% |
|                                    | I GBP             | Capitalización | LU1184247861 | 0,28% |
|                                    | I USD H           | Capitalización | LU1375972509 | 0,28% |
|                                    | L                 | Capitalización | LU0574792569 | 0,35% |
|                                    | N                 | Capitalización | LU0144751095 | 0,35% |
|                                    | R                 | Capitalización | LU0942153742 | 0,35% |
|                                    | R CHF H           | Capitalización | LU1258428017 | 0,35% |
|                                    | R GBP             | Capitalización | LU1184247606 | 0,35% |
|                                    | RQ                | Distribución   | LU1375972848 | 0,35% |
|                                    | RQ GBP H          | Distribución   | LU1375972921 | 0,35% |
|                                    | R2                | Capitalización | LU1410488487 | 0,35% |
|                                    | R2                | Distribución   | LU1410488560 | 0,35% |
|                                    | S                 | Capitalización | LU1432307756 | 0,28% |
|                                    | S                 | Distribución   | LU1010337324 | 0,28% |
|                                    | S CHF H           | Capitalización | LU2130893154 | 0,28% |
|                                    | S GBP H           | Capitalización | LU2130893238 | 0,28% |
|                                    | S USD H           | Capitalización | LU2130892933 | 0,28% |
|                                    | S USD H           | Distribución   | LU2130893071 | 0,28% |
|                                    | S2                | Capitalización | LU1633811333 | 0,28% |
|                                    | S4                | Capitalización | LU1410488305 | 0,28% |
|                                    | V                 | Capitalización | LU0891843558 | 0,28% |
|                                    | Z                 | Capitalización | LU0252971055 | 0,28% |
| Candriam Bonds Euro Long Term      | C                 | Capitalización | LU0077500055 | 0,33% |
|                                    | C                 | Distribución   | LU0108056432 | 0,33% |
|                                    | I                 | Capitalización | LU0144745956 | 0,25% |
|                                    | Z                 | Capitalización | LU0252963110 | 0,25% |
| Candriam Bonds Euro Short Term     | C                 | Capitalización | LU0157929810 | 0,33% |
|                                    | C                 | Distribución   | LU0157929737 | 0,33% |
|                                    | I                 | Capitalización | LU0156671504 | 0,25% |
|                                    | I                 | Distribución   | LU0594540485 | 0,25% |
|                                    | N                 | Capitalización | LU0156671413 | 0,33% |
|                                    | R                 | Capitalización | LU1269890593 | 0,33% |
|                                    | R2                | Distribución   | LU1410489881 | 0,33% |
|                                    | S                 | Capitalización | LU1184248083 | 0,25% |
|                                    | Z                 | Capitalización | LU0252964431 | 0,25% |
| Candriam Bonds Floating Rate Notes | BF                | Capitalización | LU2178471418 | 0,25% |
|                                    | C                 | Capitalización | LU1838941372 | 0,33% |
|                                    | I                 | Capitalización | LU1838941539 | 0,25% |
|                                    | PI                | Capitalización | LU1838941703 | 0,25% |
|                                    | R                 | Capitalización | LU1838941612 | 0,33% |
|                                    | R2                | Distribución   | LU2240495791 | 0,33% |
|                                    | V                 | Capitalización | LU1838941885 | 0,25% |
|                                    | Z                 | Capitalización | LU1838941968 | 0,25% |
| Candriam Bonds Global Government   | C                 | Capitalización | LU0157931550 | 0,33% |
|                                    | C                 | Distribución   | LU0157931394 | 0,33% |
|                                    | I                 | Capitalización | LU0156673039 | 0,25% |
|                                    | I AH              | Capitalización | LU0391256509 | 0,25% |
|                                    | R                 | Capitalización | LU2043253751 | 0,33% |
|                                    | Z                 | Capitalización | LU0252978738 | 0,25% |

# Candriam Bonds

## Otras notas a los estados financieros

### Note 4 - Gastos Operativos y Administrativos

| Compartimentos                                 | Clase de acciones | Tipo de acción | ISIN         | MAX   |
|------------------------------------------------|-------------------|----------------|--------------|-------|
| Candriam Bonds Global High Yield               | C                 | Capitalización | LU0170291933 | 0,35% |
|                                                | C                 | Distribución   | LU0170293392 | 0,35% |
|                                                | CQ                | Distribución   | LU1269891567 | 0,35% |
|                                                | I                 | Capitalización | LU0170293806 | 0,28% |
|                                                | I USD H           | Capitalización | LU1599350359 | 0,28% |
|                                                | N                 | Capitalización | LU0170293632 | 0,35% |
|                                                | R                 | Capitalización | LU1269891641 | 0,35% |
|                                                | RQ GBP            | Distribución   | LU1375973226 | 0,35% |
|                                                | RQ GBP H          | Distribución   | LU1375973143 | 0,35% |
|                                                | R2                | Capitalización | LU1410489964 | 0,35% |
|                                                | R2                | Distribución   | LU1410490038 | 0,35% |
|                                                | V                 | Capitalización | LU0891839952 | 0,28% |
|                                                | Z                 | Capitalización | LU0252968697 | 0,28% |
| Candriam Bonds Global Inflation Short Duration | C                 | Capitalización | LU0165520114 | 0,33% |
|                                                | C                 | Distribución   | LU0165520973 | 0,33% |
|                                                | I                 | Capitalización | LU0165522086 | 0,25% |
|                                                | R                 | Capitalización | LU0942153825 | 0,33% |
|                                                | R2                | Capitalización | LU1410488990 | 0,33% |
|                                                | R2                | Distribución   | LU1410489022 | 0,33% |
|                                                | Z                 | Capitalización | LU0252962658 | 0,25% |
| Candriam Bonds International                   | C                 | Capitalización | LU0012119433 | 0,29% |
|                                                | C                 | Distribución   | LU0012119516 | 0,29% |
|                                                | I                 | Capitalización | LU0144746335 | 0,23% |
|                                                | R                 | Capitalización | LU1269891724 | 0,29% |
|                                                | R2                | Capitalización | LU1410491358 | 0,29% |
|                                                | Z                 | Capitalización | LU0252972020 | 0,23% |
| Candriam Bonds Total Return                    | C                 | Capitalización | LU0252128276 | 0,29% |
|                                                | C                 | Distribución   | LU0252129167 | 0,29% |
|                                                | C USD H           | Capitalización | LU1184248596 | 0,29% |
|                                                | CQ                | Distribución   | LU1269892029 | 0,29% |
|                                                | I                 | Capitalización | LU0252132039 | 0,23% |
|                                                | I                 | Distribución   | LU1120698102 | 0,23% |
|                                                | I USD H           | Capitalización | LU1184249644 | 0,23% |
|                                                | N                 | Capitalización | LU0252131148 | 0,29% |
|                                                | R                 | Capitalización | LU1184248752 | 0,29% |
|                                                | R GBP H           | Capitalización | LU1184248919 | 0,29% |
|                                                | R2                | Capitalización | LU1410491788 | 0,29% |
|                                                | R2                | Distribución   | LU1410491861 | 0,29% |
|                                                | S                 | Capitalización | LU1511858513 | 0,23% |
|                                                | S                 | Distribución   | LU1511858430 | 0,23% |
|                                                | S GBP H           | Capitalización | LU1582239882 | 0,23% |
|                                                | Z                 | Capitalización | LU0252136964 | 0,23% |
|                                                | Z USD H           | Capitalización | LU1546486744 | 0,23% |

### Note 5 - Comisiones de rentabilidad

Como remuneración de su actividad de gestión de carteras, la Sociedad Gestora percibe igualmente "comisiones de rentabilidad" para ciertos compartimentos, según se detalla a continuación.

El método de cálculo de las comisiones de rentabilidad se especifica en las diferentes fichas técnicas anexas al folleto de la SICAV actualmente en vigor.

El período de referencia será el ejercicio y estas comisiones se pagarán al finalizar el año natural.

Dos tercios de las comisiones de rentabilidad constatadas al 31 de diciembre de 20120 serán trasladados al ejercicio siguiente y serán o bien reducidos por reversión de la provisión resultante de una rentabilidad inferior al índice (dentro del límite de la provisión devengada), o bien aumentados por toda nueva provisión por comisión de rentabilidad superior al índice.

En cada valoración de la clase, se determina un activo de referencia suponiendo una inversión teórica correspondiente al rendimiento del índice del conjunto de las suscripciones recibidas en el período (asimilándose el activo neto contable del cierre del ejercicio anterior a una suscripción de inicio del período).

# Candriam Bonds

## Otras notas a los estados financieros

### Note 5 - Comisiones de rentabilidad

| Compartimentos                                | Clase de acciones           | Tipo de acción              | Índice                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-----------------------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Candriam Bonds Capital Securities             | I                           | Capitalización              | 30 % ICE BofA Contingent Capital Index Hedged EUR (Total Return) + 70% ICE BofA Euro Financial Subordinated & Lower Tier-2 Index (Total Return)                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| Candriam Bonds Convertible Defensive          | I                           | Capitalización              | Eonia Capitalised                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| Candriam Bonds Credit Alpha                   | Todas las clases excepto S  | Capitalización              | Eonia Capitalised                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| Candriam Bonds Credit Opportunities           | Todas las clases excepto S3 | Capitalización Distribución | Eonia Capitalised (para las clases denominadas en EUR)<br>FED FUNDS EFFECTIVE RATE US (para las clases denominadas en USD)<br>ICE BofA Euro Currency Overnight Deposit Offered Rate – GBP(para las clases denominadas en GBP)<br>SARON Capitalised (para las clases denominadas en CHF)                                                                                                                                   |
| Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies | I, V                        | Capitalización              | J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified (Total Return) in USD (para las clases denominadas en USD)<br>J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified (Total Return) in EUR (para las clases denominadas en EUR)<br>J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified (Total Return) in EUR cross hedged (para las clases denominadas en EUR)<br>J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified (Total Return) in GBP (para las clases denominadas en GBP) |
| Candriam Bonds Emerging Markets               | I, V<br>I                   | Capitalización Distribución | J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified (Total Return) (para las clases denominadas en USD)<br>J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified hedged in EURO (para las clases cubiertas expresadas en EUR)<br>J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified in EUR (para las clases no cubiertas expresadas en EUR)<br>J.P. Morgan GBI-EM EMBI Global Diversified (Total Return) hedged in CHF (para las clases cubiertas expresadas en CHF) |
| Candriam Bonds Emerging Markets Corporate     | I<br>I                      | Capitalización Distribución | JP Morgan CEMBI Broad Diversified (Total Return) per le classi non coperte esprime in USD)<br>J.P. Morgan CEMBI Broad Diversified (Total Return) hedged in EUR (para las clases cubiertas expresadas en EUR)                                                                                                                                                                                                              |
| Candriam Bonds Euro                           | I, V                        | Capitalización              | iBoxx Euro Overall (Total Return)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| Candriam Bonds Euro Corporate                 | I                           | Capitalización              | iBoxx EUR Corporate (Total Return)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| Candriam Bonds Euro Diversified               | I                           | Capitalización              | Bloomberg Barclays Euro Aggregate 1-10 years Year Index (Total Return)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| Candriam Bonds Euro Government                | I<br>I                      | Capitalización Distribución | JPM EMU (Total Return)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| Candriam Bonds Euro High Yield                | I, V<br>I                   | Capitalización Distribución | ICE BofA BB-B Euro Non-Financial High Yield Constrained Index (Total Return) (para las clases denominadas en EUR)<br>ICE BofA BB-B Euro Non-Financial High Yield Constrained Index (Total Return) in GBP para las clases denominadas en GBP)<br>ICE BofA BB-B Euro Non-Financial High Yield Constrained Index (Total Return) hedged in USD (para las clases cubiertas expresadas en USD)                                  |
| Candriam Bonds Euro Long Term                 | I                           | Capitalización              | Markit iBoxx EUR Overall 7+ Index (Total Return)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| Candriam Bonds Euro Short Term                | I<br>I                      | Capitalización Distribución | iBoxx EUR Overall 1-3 (Total Return)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| Candriam Bonds Global High Yield              | I                           | Capitalización              | ICE BofA BB-B Global High Yield Non-Financial Constrained Index Hedged EUR (Total Return) (para las clases denominadas en EUR)<br>ICE BofA BB-B Global High Yield Non-Financial Constrained Index Hedged USD (Total Return) (para las clases cubiertas expresadas en USD)                                                                                                                                                 |
| Candriam Bonds International                  | I                           | Capitalización              | Bloomberg Barclays Global Aggregate Index Hedged EUR (Total Return) (para las clases denominadas en EUR)<br>Bloomberg Barclays Global Aggregate Index (Total Return) USD (para las clases no cubiertas expresadas en USD)                                                                                                                                                                                                 |
| Candriam Bonds Total Return                   | I, V<br>I                   | Capitalización Distribución | EONIA Capitalised +2% (para las clases denominadas en EUR)<br>Sonia + 2% (para las clases cubiertas expresadas en GBP)<br>Fed Funds +2% (para las clases cubiertas expresadas en USD)                                                                                                                                                                                                                                     |
| Candriam Bonds Total Return Defensive         | I                           | Capitalización              | EONIA Capitalised +1%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |

En caso de recompra, el último activo de referencia calculado y el conjunto acumulado de las suscripciones recibidas en la última valoración se reducirán previamente de manera proporcional al número de acciones recompradas. Del mismo modo, se asignará definitivamente a una cuenta específica de terceros, al prorrata del número de acciones recompradas, una parte proporcional de la provisión para la comisión de rentabilidad sobre el volumen emitido constatada a efectos contables en la última valoración. Esta parte proporcional de la comisión de rentabilidad se atribuirá a la Sociedad Gestora desde el momento de la recompra.

Las reversiones de provisiones se contabilizan en la partida "Otros ingresos".

## Otras notas a los estados financieros

### Note 6 - Tasa de suscripción

La SICAV se rige por la legislación fiscal de Luxemburgo. En virtud de la legislación y de las normas vigentes actualmente, la SICAV está sujeta en Luxemburgo a una tasa anual del 0,05% del valor del activo neto de la SICAV; esta tasa se reduce al 0,01% para las clases reservadas a los inversores institucionales. Este impuesto es pagadero trimestralmente en función de los activos netos de la SICAV calculado al final del trimestre al que se refiere la tributación.

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 es imputado a 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 compartimentos. La Ley del 17 de junio de 2013 modifica la tasa anual para los Organismos de Inversión Colectiva. los organismos de crédito y las aseguradoras al 0,0925% con efecto a partir del 1 de enero de 2014.

La Sicav presentó, con carácter cautelar, una solicitud de devolución de la tasa ante la administración fiscal belga y ante el Tribunal de Primera Instancia de Bruselas. Actualmente no se puede prejuzgar el resultado del litigio o cualquier reembolso en beneficio de la Sicav. En un caso similar, el Estado belga interpuso un recurso de casación contra las decisiones del Tribunal de Apelación en favor del demandante. El caso sigue pendiente.

### Note 7 - Préstamos sobre títulos

La Sociedad Gestora, a través de un contrato de delegación con fecha del 18 de febrero de 2014, delegó la ejecución de las operaciones de préstamo y empréstito de valores, bajo su control y responsabilidad, a Candriam France, sociedad por acciones simplificada cuyo domicilio social se sitúa en el 40, rue Washington, F-75408 Paris. Este contrato podrá ser rescindido por cualquiera de las partes mediante notificación por escrito con 90 días de antelación.

Para el ejercicio cerrado el 30 de junio de 2021, la composición de los préstamos sobre títulos era la siguiente:

| Compartimentos                                 | Moneda | Valor de mercado de valores prestados | Valores garantía |
|------------------------------------------------|--------|---------------------------------------|------------------|
| Candriam Bonds Capital Securities              | EUR    | 700.052                               | 736.185          |
| Candriam Bonds Convertible Defensive           | EUR    | 41.071.501                            | 42.331.754       |
| Candriam Bonds Euro                            | EUR    | 90.319.172                            | 92.513.728       |
| Candriam Bonds Euro Corporate                  | EUR    | 4.500.992                             | 4.748.478        |
| Candriam Bonds Euro Diversified                | EUR    | 75.531.232                            | 77.669.124       |
| Candriam Bonds Euro Government                 | EUR    | 340.596.589                           | 346.724.404      |
| Candriam Bonds Euro Long Term                  | EUR    | 23.494.672                            | 23.885.675       |
| Candriam Bonds Euro Short Term                 | EUR    | 188.442.208                           | 190.372.088      |
| Candriam Bonds Floating Rate Notes             | EUR    | 2.331.251                             | 2.449.348        |
| Candriam Bonds Global Government               | EUR    | 13.554.912                            | 13.650.645       |
| Candriam Bonds Global Inflation Short Duration | EUR    | 38.473.602                            | 38.886.958       |
| Candriam Bonds International                   | EUR    | 4.874.909                             | 5.213.445        |
| Candriam Bonds Total Return                    | EUR    | 57.092.031                            | 58.896.891       |

Los tipos de garantías financieras permitidos son los siguientes:

- efectivo denominado en la moneda de referencia del compartimento correspondiente;
- valores de deuda de buena calidad (con calificación mínima de BBB-/ Baa3 o equivalente por parte de una de las agencias de calificación) emitidos por un emisor del sector público de un país de la OCDE (Estados. supranacionales. ...) y cuyo tamaño de emisión sea de EUR 250 millones como mínimo;
- valores de deuda de buena calidad (con calificación mínima de BBB-/ Baa3 o equivalente por parte de una de las agencias de calificación) emitidos por un emisor del sector privado de un país de la OCDE y cuyo tamaño de emisión sea de EUR 250 millones como mínimo;
- acciones que se coticen o negocien en un mercado reglamentado de un Estado miembro de la Unión Europea o en una bolsa de valores de un Estado que sea parte de la OCDE, siempre que dichas acciones estén incluidas en un índice importante;
- acciones o participaciones de organismos de inversión colectiva que ofrezcan una liquidez adecuada y que inviertan en instrumentos del mercado monetario, bonos de buena calidad o acciones que cumplan con las condiciones mencionadas anteriormente.

Los valores prestados se valoran sobre la base de la última cotización conocida. Los valores así como los intereses a recibir correspondientes figuran en el Estado de los activos netos.

Los importes de los ingresos de las transacciones se incluyen en el apartado "Intereses sobre préstamos de títulos" del Estado de variaciones de los activos netos.

Las contrapartes vinculadas al programa de préstamos de títulos son: BNP Paribas Securities Services SCA, BNP Paribas, Natixis SA, Société Générale SA, BofA Securities, Banco Santander, Goldman Sachs.

Se han contabilizado los ingresos siguientes durante el ejercicio cerrado a 30 de junio de 2021 :

# Candriam Bonds

## Otras notas a los estados financieros

### Note 7 - Préstamos sobre títulos

| Compartimentos                                 | Moneda | Bruto total cantidad de ingresos por préstamos de valores | Gastos y comisiones directos-indirectos deducidos de los ingresos brutos por préstamo de valores | Neto total cantidad de ingresos por préstamos de valores |
|------------------------------------------------|--------|-----------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------|
| Candriam Bonds Capital Securities              | EUR    | 246                                                       | 98                                                                                               | 147                                                      |
| Candriam Bonds Convertible Defensive           | EUR    | 44.384                                                    | 17.754                                                                                           | 26.631                                                   |
| Candriam Bonds Euro                            | EUR    | 47.175                                                    | 18.870                                                                                           | 28.305                                                   |
| Candriam Bonds Euro Corporate                  | EUR    | 2.299                                                     | 920                                                                                              | 1.380                                                    |
| Candriam Bonds Euro Corporate ex-Financials    | EUR    | 218                                                       | 87                                                                                               | 131                                                      |
| Candriam Bonds Euro Diversified                | EUR    | 37.239                                                    | 14.896                                                                                           | 22.344                                                   |
| Candriam Bonds Euro Government                 | EUR    | 151.698                                                   | 60.679                                                                                           | 91.019                                                   |
| Candriam Bonds Euro Long Term                  | EUR    | 11.395                                                    | 4.558                                                                                            | 6.837                                                    |
| Candriam Bonds Euro Short Term                 | EUR    | 57.393                                                    | 22.957                                                                                           | 34.436                                                   |
| Candriam Bonds Floating Rate Notes             | EUR    | 138                                                       | 55                                                                                               | 83                                                       |
| Candriam Bonds Global Government               | EUR    | 13.763                                                    | 5.505                                                                                            | 8.258                                                    |
| Candriam Bonds Global Inflation Short Duration | EUR    | 38.583                                                    | 15.433                                                                                           | 23.150                                                   |
| Candriam Bonds International                   | EUR    | 1.981                                                     | 792                                                                                              | 1.189                                                    |
| Candriam Bonds Total Return                    | EUR    | 23.807                                                    | 9.523                                                                                            | 14.284                                                   |

Los costes y comisiones directos e indirectos percibidos por Candriam France y Candriam Luxembourg ascienden al 19% y el 1% para todos los subfondos, respectivamente. Las comisiones percibidas por CACEIS Bank, Luxembourg Branch ascienden al 20 % de los ingresos brutos. Candriam France y Candriam Luxembourg son partes relacionadas de la SICAV.

### Note 8 - Pactos de recompra inversa

A 30 de junio de 2021, las posiciones abiertas de recompra inversa son las siguientes:

#### Candriam Bonds Credit Alpha

| Moneda       | Nomínale   | Fecha de vencimiento | Denominación             | Contraparte              | Créditos sobre acuerdos de recompra inversa (en EUR) |
|--------------|------------|----------------------|--------------------------|--------------------------|------------------------------------------------------|
| EUR          | 8.736.000  | 29/07/2021           | FRANCE 4,25 06-23 25/10A | CACEIS Bank, Lux. Branch | 9.998.352                                            |
| EUR          | 15.400.000 | 06/09/2021           | FRANCE 0,50 20-40 25/05A | CACEIS Bank, Lux. Branch | 14.999.600                                           |
| <b>TOTAL</b> |            |                      |                          |                          | <b>24.997.952</b>                                    |

### Note 9 - Dividendos

La SICAV distribuyó los siguientes dividendos durante el período terminado el 30 de junio de 2021:

| Compartimentos                                | Clase de acciones | Moneda | Dividendo | Ex-date    |
|-----------------------------------------------|-------------------|--------|-----------|------------|
| Candriam Bonds Convertible Defensive          | C                 | EUR    | 1,20      | 28/04/2021 |
|                                               | R2                | EUR    | 1,50      | 28/04/2021 |
| Candriam Bonds Credit Opportunities           | C                 | EUR    | 0,14      | 28/04/2021 |
|                                               | CQ                | EUR    | 0,94      | 02/02/2021 |
|                                               | CQ                | EUR    | 0,96      | 04/05/2021 |
|                                               | IQ                | EUR    | 9,40      | 02/02/2021 |
|                                               | IQ                | EUR    | 9,83      | 04/05/2021 |
|                                               | R2                | EUR    | 0,15      | 28/04/2021 |
| Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies | C                 | USD    | 3,71      | 28/04/2021 |
|                                               | C EUR             | EUR    | 3,05      | 28/04/2021 |
|                                               | CQ                | USD    | 1,89      | 02/02/2021 |
|                                               | CQ                | USD    | 2,16      | 04/05/2021 |
|                                               | R2                | USD    | 6,92      | 28/04/2021 |
|                                               | R2 EUR            | EUR    | 6,46      | 28/04/2021 |

# Candriam Bonds

## Otras notas a los estados financieros

### Note 9 - Dividendos

| Compartimentos                                 | Clase de acciones | Moneda | Dividendo | Ex-date    |
|------------------------------------------------|-------------------|--------|-----------|------------|
| Candriam Bonds Emerging Markets                | C                 | USD    | 44,47     | 28/04/2021 |
|                                                | CQ                | USD    | 1,81      | 02/02/2021 |
|                                                | CQ                | USD    | 1,69      | 04/05/2021 |
|                                                | I                 | USD    | 71,20     | 28/04/2021 |
|                                                | IQ EUR H          | EUR    | 12,34     | 02/02/2021 |
|                                                | IQ EUR H          | EUR    | 13,96     | 04/05/2021 |
|                                                | IQ GBP H          | GBP    | 11,96     | 02/02/2021 |
|                                                | IQ GBP H          | GBP    | 14,07     | 04/05/2021 |
|                                                | RQ                | USD    | 2,00      | 02/02/2021 |
|                                                | RQ                | USD    | 1,65      | 04/05/2021 |
|                                                | R2                | USD    | 6,65      | 28/04/2021 |
|                                                | V2Q GBP H         | GBP    | 11,91     | 02/02/2021 |
|                                                | V2Q GBP H         | GBP    | 14,01     | 04/05/2021 |
|                                                | Z                 | USD    | 74,15     | 28/04/2021 |
| Candriam Bonds Emerging Markets Corporate      | C                 | USD    | 5,48      | 28/04/2021 |
|                                                | I                 | USD    | 54,39     | 28/04/2021 |
|                                                | R2                | USD    | 5,55      | 28/04/2021 |
| Candriam Bonds Euro                            | C                 | EUR    | 1,57      | 28/04/2021 |
|                                                | Z                 | EUR    | 8,77      | 28/04/2021 |
| Candriam Bonds Euro Corporate                  | C                 | EUR    | 40,34     | 28/04/2021 |
|                                                | Z                 | EUR    | 11,52     | 28/04/2021 |
| Candriam Bonds Euro Corporate ex-Financials    | C                 | EUR    | 0,86      | 28/04/2021 |
| Candriam Bonds Euro Diversified                | C                 | EUR    | 0,32      | 28/04/2021 |
| Candriam Bonds Euro Government                 | C                 | EUR    | 6,81      | 28/04/2021 |
|                                                | I                 | EUR    | 8,38      | 28/04/2021 |
|                                                | R2                | EUR    | 0,89      | 28/04/2021 |
|                                                | Z                 | EUR    | 8,94      | 28/04/2021 |
| Candriam Bonds Euro High Yield                 | C                 | EUR    | 5,77      | 28/04/2021 |
|                                                | CQ                | EUR    | 1,19      | 02/02/2021 |
|                                                | CQ                | EUR    | 1,19      | 04/05/2021 |
|                                                | I                 | EUR    | 49,86     | 28/04/2021 |
|                                                | RQ                | EUR    | 1,15      | 02/02/2021 |
|                                                | RQ                | EUR    | 1,15      | 04/05/2021 |
|                                                | RQ GBP H          | GBP    | 1,12      | 02/02/2021 |
|                                                | RQ GBP H          | GBP    | 1,16      | 04/05/2021 |
|                                                | R2                | EUR    | 4,78      | 28/04/2021 |
|                                                | S                 | EUR    | 24,67     | 28/04/2021 |
|                                                | S USD H           | USD    | 48,37     | 28/04/2021 |
| Candriam Bonds Euro Long Term                  | C                 | EUR    | 54,50     | 28/04/2021 |
| Candriam Bonds Global Government               | C                 | EUR    | 0,41      | 28/04/2021 |
| Candriam Bonds Global High Yield               | C                 | EUR    | 4,67      | 28/04/2021 |
|                                                | CQ                | EUR    | 1,32      | 02/02/2021 |
|                                                | CQ                | EUR    | 1,52      | 04/05/2021 |
|                                                | RQ GBP            | GBP    | 1,33      | 02/02/2021 |
|                                                | RQ GBP            | GBP    | 1,52      | 04/05/2021 |
|                                                | RQ GBP H          | GBP    | 1,25      | 02/02/2021 |
|                                                | RQ GBP H          | GBP    | 1,48      | 04/05/2021 |
|                                                | R2                | EUR    | 7,21      | 28/04/2021 |
|                                                |                   |        |           |            |
| Candriam Bonds Global Inflation Short Duration | C                 | EUR    | 0,55      | 28/04/2021 |
|                                                | R2                | EUR    | 0,75      | 28/04/2021 |
| Candriam Bonds International                   | C                 | EUR    | 3,40      | 28/04/2021 |
| Candriam Bonds Total Return                    | C                 | EUR    | 1,88      | 28/04/2021 |
|                                                | CQ                | EUR    | 0,52      | 02/02/2021 |
|                                                | CQ                | EUR    | 0,47      | 04/05/2021 |
|                                                | I                 | EUR    | 20,16     | 28/04/2021 |
|                                                | R2                | EUR    | 2,20      | 28/04/2021 |
|                                                | S                 | EUR    | 22,00     | 28/04/2021 |

## Otras notas a los estados financieros

### Note 10 - Swing Pricing

Para todos los compartimentos de la SICAV se ha previsto la siguiente medida :

Los días de valoración en los que la diferencia entre el importe de las suscripciones y el importe de los rescates de un compartimento (es decir. las transacciones netas) sobrepase un umbral fijado previamente por el Consejo de Administración, este se reserva el derecho de :

- para determinar el valor neto de los activos mediante la adición a los activos (en el caso de suscripciones netas) o deduciendo de los activos (en el caso de los reembolsos netos) un cierto porcentaje de las comisiones y costos correspondientes para comercializar prácticas en la compra o venta de valores : Candriam Bonds Credit Alpha, Candriam Bonds Credit Opportunities, Candriam Bonds Global High Yield y Candriam Bonds Euro High Yield;
- evalúe la cartera de valores del compartimento sobre la base de los precios de compra o venta o estableciendo spreads en un nivel representativo del mercado en cuestión (en el caso de entradas o salidas netas, respectivamente) : Candriam Bonds Capital Securities, Candriam Bonds Convertible Defensive, Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies, Candriam Bonds Emerging Markets, Candriam Bonds Emerging Markets Corporate, Candriam Bonds Emerging Markets Total Return, Candriam Bonds Euro, Candriam Bonds Euro Corporate, Candriam Bonds Euro Corporate Ex-Financials, Candriam Bonds Euro Diversified, Candriam Bonds Euro Government, Candriam Bonds Euro Long Term, Candriam Bonds Euro Short Term, Candriam Bonds Floating Rate Notes, Candriam Bonds Global Government, Candriam Bonds Inflation Short Duration, Candriam Bonds International, Candriam Bonds Total Return y Candriam Bonds Total Return Defensive.

El proceso de swing pricing se aplicó a todos los compartimentos durante el período, excepto a Candriam Bonds Convertible Defensive, Candriam Bonds Credit Alpha y Candriam Bonds Euro Diversified. Al 30 de Junio de 2021, no se han realizado los ajustes mencionados anteriormente.

El swing factor

El swing factor es la cantidad por la cual se ajusta el VL cuando se activa el proceso de swing pricing una vez que las suscripciones o reembolsos netos superan el umbral de swing. Los factores que se consideran cuando se fija el factor de ajuste son, entre otros, los siguientes:

Para el método de alto rendimiento:

- Bid-ask spread

Para el método de renta fija:

- Política de precios de oscilación
- Spread oferta-demanda

| Compartimentos                      | Porcentaje del flujo de entrada para el swing Factor (%) | Porcentaje del flujo de salida para el swing Factor (%) |
|-------------------------------------|----------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| Candriam Bonds Credit Alpha         | 0,34                                                     | 0,34                                                    |
| Candriam Bonds Credit Opportunities | 0,34                                                     | 0,34                                                    |
| Candriam Bonds Euro High Yield      | 0,33                                                     | 0,33                                                    |
| Candriam Bonds Global High Yield    | 0,36                                                     | 0,36                                                    |

### Note 11 - Efectivos en banco e intermediario financiero

El Efectivo en banco y en intermediarios financieros en el Estado del activo neto incluye las cuentas de efectivo y el efectivo en cuentas de corretaje sobre contratos futuros y cotizadas opciones.

La porción relativa al efectivo mantenido en cuentas de corretaje incluido en el rubro “Efectivo en banco y corretaje” en el estado de activos netos en 30 de junio de 2021 se desglosa de la siguiente manera :

| Compartimentos                                | Moneda | Efectivos en intermediario financiero |
|-----------------------------------------------|--------|---------------------------------------|
| Candriam Bonds Capital Securities             | EUR    | 64.423                                |
| Candriam Bonds Convertible Defensive          | EUR    | 339.574                               |
| Candriam Bonds Credit Alpha                   | EUR    | 317.810                               |
| Candriam Bonds Credit Opportunities           | EUR    | 2.673.686                             |
| Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies | USD    | 1.058.570                             |
| Candriam Bonds Emerging Markets               | USD    | 7.799.831                             |
| Candriam Bonds Emerging Markets Corporate     | USD    | 214.800                               |
| Candriam Bonds Emerging Markets Total Return  | USD    | 522.081                               |
| Candriam Bonds Euro                           | EUR    | 863.826                               |
| Candriam Bonds Euro Corporate                 | EUR    | 1.277.146                             |
| Candriam Bonds Euro Diversified               | EUR    | 1.400.582                             |
| Candriam Bonds Euro Government                | EUR    | 1.631.960                             |
| Candriam Bonds Euro High Yield                | EUR    | 6.893.087                             |
| Candriam Bonds Euro Long Term                 | EUR    | 151.375                               |
| Candriam Bonds Euro Short Term                | EUR    | 332.258                               |
| Candriam Bonds Floating Rate Notes            | EUR    | 319.169                               |
| Candriam Bonds Global Government              | EUR    | 307.296                               |

# Candriam Bonds

## Otras notas a los estados financieros

### Note 11 - Efectivos en banco e intermediario financiero

| Compartimentos                                 | Moneda | Efectivos en intermediario financiero |
|------------------------------------------------|--------|---------------------------------------|
| Candriam Bonds Global High Yield               | EUR    | 25.535                                |
| Candriam Bonds Global Inflation Short Duration | EUR    | 796.084                               |
| Candriam Bonds International                   | EUR    | 337.872                               |
| Candriam Bonds Total Return                    | EUR    | 10.307.995                            |

### Note 12 - Collateral

En relación con los instrumentos derivados OTC, se ha recibido efectivo como garantía de Barclays Capital, Barclays Bank Ireland Plc, BNP Paribas Paris, Bank of New York, CACEIS Bank, Lux. Branch, Citigroup Global Markets Europe AG, Crédit Suisse, Goldman Sachs Intl, Paris Branch, J.P. Morgan AG, Morgan Stanley, Société Générale y UBS Europe SE:

| Compartimentos                                 | Moneda | Garantía en efectivo pagada | Garantía en efectivo recibida |
|------------------------------------------------|--------|-----------------------------|-------------------------------|
| Candriam Bonds Capital Securities              | EUR    | -                           | 366.403                       |
| Candriam Bonds Convertible Defensive           | EUR    | 1.834.308                   | -                             |
| Candriam Bonds Credit Alpha                    | EUR    | -                           | 80.000                        |
| Candriam Bonds Credit Opportunities            | EUR    | 33.693.368                  | -                             |
| Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies  | USD    | 1.320.070                   | -                             |
| Candriam Bonds Emerging Markets                | USD    | 3.209.949                   | -                             |
| Candriam Bonds Emerging Markets Total Return   | USD    | 140.116                     | -                             |
| Candriam Bonds Euro                            | EUR    | 479.999                     | -                             |
| Candriam Bonds Euro Corporate                  | EUR    | -                           | 3.896                         |
| Candriam Bonds Euro Diversified                | EUR    | 1.510.000                   | -                             |
| Candriam Bonds Euro High Yield                 | EUR    | 7.157.946                   | -                             |
| Candriam Bonds Euro Short Term                 | EUR    | 1.499.870                   | -                             |
| Candriam Bonds Floating Rate Notes             | EUR    | 2.439.950                   | -                             |
| Candriam Bonds Global Government               | EUR    | -                           | 188                           |
| Candriam Bonds Global High Yield               | EUR    | 5.317.675                   | -                             |
| Candriam Bonds Global Inflation Short Duration | EUR    | 4.083.324                   | -                             |
| Candriam Bonds International                   | EUR    | 678.169                     | -                             |
| Candriam Bonds Total Return                    | EUR    | 12.026.090                  | -                             |

### Note 13 - Cambios en la composición de la cartera

La lista de las compras y ventas de los títulos que componen las carteras de valores está a disposición del inversor gratuitamente en el domicilio de la SICAV.

### Note 14 - Hechos posteriores

No hay ningún acontecimiento posterior.

### Información suplementaria

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

La sociedad gestora no ejerce los derechos de voto de los fondos considerados. Para todas las cuestiones relacionadas con el compromiso, nos remitimos a la política de compromiso y a los informes asociados, todos ellos disponibles en el sitio web de Candriam [www.candriam.com/en/professional/market-insights/sri-publications](http://www.candriam.com/en/professional/market-insights/sri-publications).

# Candriam Bonds

## Información suplementaria

Transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización, y por el que se modifica el Reglamento (UE) n° 648/2012

| Préstamos sobre títulos            | Candriam Bonds<br>Capital Securities | Candriam Bonds<br>Convertible<br>Defensive | Candriam Bonds<br>Euro                    | Candriam Bonds<br>Euro Corporate |
|------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------------|-------------------------------------------|----------------------------------|
|                                    | (en EUR)                             | (en EUR)                                   | (en EUR)                                  | (en EUR)                         |
| Activos utilizados                 |                                      |                                            |                                           |                                  |
| En valor absoluta                  | 700.052                              | 41.071.501                                 | 90.319.172                                | 4.500.992                        |
| Como % de los activos prestables   | 1,45%                                | 14,56%                                     | 16,77%                                    | 0,56%                            |
| Como % del valor liquidativo total | 1,41%                                | 13,66%                                     | 16,57%                                    | 0,50%                            |
| Las 10 contrapartes principales    |                                      |                                            |                                           |                                  |
| Nombre 1                           | Banco Santander                      | BNP Paribas<br>Arbitrage                   | BNP Paribas SA                            | Banco Santander                  |
| Importe                            | 700.052                              | 15.474.866                                 | 31.543.359                                | 3.481.972                        |
| País de residencia                 | España                               | Francia                                    | Francia                                   | España                           |
| Nombre 2                           | -                                    | BNP Paribas<br>Securities Services<br>SCA  | BNP Paribas<br>Securities Services<br>SCA | BNP Paribas SA                   |
| Importe                            | -                                    | 10.788.944                                 | 27.331.451                                | 1.019.020                        |
| País de residencia                 | -                                    | Francia                                    | Francia                                   | Francia                          |
| Nombre 3                           | -                                    | Société Générale SA                        | Société Générale SA                       | -                                |
| Importe                            | -                                    | 7.249.405                                  | 16.894.569                                | -                                |
| País de residencia                 | -                                    | Francia                                    | Francia                                   | -                                |
| Nombre 4                           | -                                    | Natixis SA                                 | Banco Santander                           | -                                |
| Importe                            | -                                    | 4.679.379                                  | 12.282.163                                | -                                |
| País de residencia                 | -                                    | Francia                                    | España                                    | -                                |
| Nombre 5                           | -                                    | Scotiabank                                 | BNP Paribas<br>Arbitrage                  | -                                |
| Importe                            | -                                    | 2.675.402                                  | 2.267.630                                 | -                                |
| País de residencia                 | -                                    | Canadá                                     | Francia                                   | -                                |
| Nombre 6                           | -                                    | BNP Paribas SA                             | -                                         | -                                |
| Importe                            | -                                    | 203.506                                    | -                                         | -                                |
| País de residencia                 | -                                    | Francia                                    | -                                         | -                                |
| Transacción por país               | España<br>700.052                    | Francia<br>38.396.100                      | Francia<br>78.037.008                     | España<br>3.481.972              |
|                                    | -                                    | Canadá<br>2.675.402                        | España<br>12.282.163                      | Francia<br>1.019.020             |
|                                    | -                                    | España<br>712.919                          | -                                         | -                                |
|                                    | -                                    | -                                          | -                                         | -                                |
| Operaciones de liquidación         |                                      |                                            |                                           |                                  |
| - bipartito                        | -                                    | 203.506                                    | 28.706.192                                | 1.019.020                        |
| - tripartito                       | 700.052                              | 40.867.995                                 | 61.612.980                                | 3.481.972                        |
| Perfil de vencimiento de las OFV   |                                      |                                            |                                           |                                  |
| Menos de 1 día                     | -                                    | -                                          | -                                         | -                                |
| Entre 1 día y 1 semana             | -                                    | -                                          | -                                         | -                                |
| Entre 1 semana y 1 mes             | -                                    | -                                          | 4.618.584                                 | -                                |
| Entre 1 mes y 3 meses              | -                                    | -                                          | 20.783.668                                | -                                |
| De 3 meses y 1 año                 | -                                    | -                                          | -                                         | -                                |
| Más de 1 año                       | -                                    | -                                          | -                                         | -                                |
| Vencimientos abiertos              | 700.052                              | 41.071.501                                 | 64.916.920                                | 4.500.992                        |
| Garantía recibida                  |                                      |                                            |                                           |                                  |
| Tipo:                              |                                      |                                            |                                           |                                  |
| Cash                               | -                                    | -                                          | -                                         | -                                |
| Obligaciones                       | -                                    | 20.129.654                                 | 42.159.883                                | 1.074.328                        |
| Acciones                           | 736.185                              | 22.202.100                                 | 50.353.845                                | 3.674.150                        |
|                                    | 736.185                              | 42.331.754                                 | 92.513.728                                | 4.748.478                        |

# Candriam Bonds

## Información suplementaria

Transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización, y por el que se modifica el Reglamento (UE) nº 648/2012

| Préstamos sobre títulos                        | Candriam Bonds<br>Capital Securities | Candriam Bonds<br>Convertible<br>Defensive | Candriam Bonds Euro        | Candriam Bonds<br>Euro Corporate |
|------------------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------------|----------------------------|----------------------------------|
|                                                | (en EUR)                             | (en EUR)                                   | (en EUR)                   | (en EUR)                         |
| Calidad de la garantía real:<br>Moneda:<br>EUR | A+ to BBB<br>736.185                 | A- to BBB<br>42.331.754                    | BBB+ to BBB-<br>92.513.728 | AA+ to BBB-<br>4.748.478         |
| Perfil de vencimiento de la garantía real :    |                                      |                                            |                            |                                  |
| Menos de 1 día                                 | -                                    | -                                          | -                          | -                                |
| Entre 1 día y 1 semana                         | -                                    | -                                          | -                          | -                                |
| Entre 1 semana y 1 mes                         | -                                    | -                                          | -                          | -                                |
| Entre 1 mes y 3 meses                          | -                                    | -                                          | -                          | -                                |
| De 3 meses y 1 año                             | -                                    | -                                          | -                          | -                                |
| Más de 1 año                                   | -                                    | 20.129.654                                 | 42.159.883                 | 1.074.328                        |
| Vencimientos abiertos                          | 736.185                              | 22.202.100                                 | 50.353.845                 | 3.674.150                        |
| Los 10 principales emisores de garantía real   |                                      |                                            |                            |                                  |
| Nombre 1                                       | TOTALENERGIES<br>SE                  | WILLIAMS<br>COMPANIES                      | ESPAGNE 5.4 01 23          | NRW 1.1 03-34                    |
| Importe                                        | 73.558                               | 3.854.055                                  | 29.943.286                 | 1.074.328                        |
| Nombre 2                                       | TRIPADVISOR INC                      | DT WOHNEN 01-26                            | PROSIEBENSAT.1 M           | FLUTTER ENTER-DI                 |
| Importe                                        | 73.545                               | 3.702.945                                  | 2.534.157                  | 367.144                          |
| Nombre 3                                       | ESSILORLUXOTTICA                     | MIZUHO FINANCIAL                           | CARVANA CO                 | SAFRAN SA                        |
| Importe                                        | 73.534                               | 1.084.272                                  | 2.534.153                  | 367.138                          |
| Nombre 4                                       | BNP PARIBAS                          | DAIICHI SANKYO                             | CLARIVATE PLC              | TOTALENERGIES                    |
| Importe                                        | 73.532                               | 1.084.270                                  | 2.534.151                  | 367.137                          |
| Nombre 5                                       | SAFRAN SA                            | RECRUIT HOLDINGS                           | SCOUT24 AG                 | TRIPADVISOR INC                  |
| Importe                                        | 73.516                               | 1.084.261                                  | 2.534.149                  | 367.133                          |
| Nombre 6                                       | DANONE                               | MORGAN STANLEY                             | TWILIO INC - A             | DANONE                           |
| Importe                                        | 73.515                               | 1.084.217                                  | 2.534.146                  | 367.126                          |
| Nombre 7                                       | PANDORA A S                          | FUJITSU LTD                                | HORIZON THERAPEU           | BNP PARIBAS                      |
| Importe                                        | 73.506                               | 1.084.207                                  | 2.534.135                  | 367.106                          |
| Nombre 8                                       | FLUTTER ENTER-DI                     | DH EURO 2.5 07-25                          | BRENNTAG SE                | PANDORA A S                      |
| Importe                                        | 73.429                               | 1.084.114                                  | 2.534.130                  | 367.100                          |
| Nombre 9                                       | WILLIS TOWERS WA                     | NATL GR 0.19 01-25                         | UBISOFT ENTERTAI           | ESSILORLUXOTTIC                  |
| Importe                                        | 73.414                               | 1.084.095                                  | 2.534.107                  | 367.081                          |
| Nombre 10                                      | L OREAL                              | TAKE PH 2.25 11-26                         | DOORDASH INC-A             | WILLIS TOWERS WA                 |
| Importe                                        | 73.386                               | 1.083.908                                  | 2.534.056                  | 367.071                          |
| Componentes de ingresos y gastos               |                                      |                                            |                            |                                  |
| Componente de ingresos del fondo               |                                      |                                            |                            |                                  |
| En valor absoluta                              | 147                                  | 26.630                                     | 28.305                     | 1.380                            |
| En % de ingresos brutos                        | 60%                                  | 60%                                        | 60%                        | 60%                              |
| Componente de ingresos de Candriam             |                                      |                                            |                            |                                  |
| En valor absoluta                              | 49                                   | 8.877                                      | 9.435                      | 460                              |
| En % de ingresos brutos                        | 20%                                  | 20%                                        | 20%                        | 20%                              |
| Componente de ingresos de terceros             |                                      |                                            |                            |                                  |
| En valor absoluta                              | 49                                   | 8.877                                      | 9.435                      | 460                              |
| En % de ingresos brutos                        | 20%                                  | 20%                                        | 20%                        | 20%                              |

# Candriam Bonds

## Información suplementaria

Transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización, y por el que se modifica el Reglamento (UE) n° 648/2012

| Préstamos sobre títulos            | Candriam Bonds<br>Euro Corporate ex-<br>Financials<br><br>(en EUR) | Candriam Bonds<br>Euro Diversified<br><br>(en EUR) | Candriam Bonds<br>Euro Government<br><br>(en EUR) | Candriam Bonds<br>Euro Long Term<br><br>(en EUR) |
|------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|---------------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| Activos utilizados                 | -                                                                  | -                                                  | -                                                 | -                                                |
| En valor absoluta                  | -                                                                  | 75.531.232                                         | 340.596.589                                       | 23.494.672                                       |
| Como % de los activos prestables   | -                                                                  | 12,19%                                             | 41,69%                                            | 23,14%                                           |
| Como % del valor liquidativo total | -                                                                  | 11,99%                                             | 41,16%                                            | 22,91%                                           |
| Las 10 contrapartes principales    |                                                                    |                                                    |                                                   |                                                  |
| Nombre 1                           | -                                                                  | BNP Paribas SA                                     | BNP Paribas<br>Securities Services<br>SCA         | BNP Paribas SA                                   |
| Importe                            | -                                                                  | 33.230.314                                         | 113.270.910                                       | 10.397.193                                       |
| País de residencia                 | -                                                                  | Francia                                            | Francia                                           | Francia                                          |
| Nombre 2                           | -                                                                  | BNP Paribas<br>Securities Services<br>SCA          | BNP Paribas SA                                    | BNP Paribas<br>Securities Services<br>SCA        |
| Importe                            | -                                                                  | 19.443.061                                         | 90.382.933                                        | 4.808.489                                        |
| País de residencia                 | -                                                                  | Francia                                            | Francia                                           | Francia                                          |
| Nombre 3                           | -                                                                  | Société Générale SA                                | Banco Santander                                   | Banco Santander                                  |
| Importe                            | -                                                                  | 11.175.461                                         | 76.545.434                                        | 4.144.793                                        |
| País de residencia                 | -                                                                  | Francia                                            | España                                            | España                                           |
| Nombre 4                           | -                                                                  | Banco Santander                                    | Société Générale SA                               | Société Générale SA                              |
| Importe                            | -                                                                  | 8.577.372                                          | 46.003.488                                        | 3.621.219                                        |
| País de residencia                 | -                                                                  | España                                             | Francia                                           | Francia                                          |
| Nombre 5                           | -                                                                  | BofA Securities<br>Europe SA                       | BofA Securities<br>Europe SA                      | BNP Paribas<br>Arbitrage                         |
| Importe                            | -                                                                  | 3.105.025                                          | 14.283.115                                        | 522.978                                          |
| País de residencia                 | -                                                                  | Francia                                            | Francia                                           | Francia                                          |
| Nombre 6                           | -                                                                  | -                                                  | Natixis SA                                        | -                                                |
| Importe                            | -                                                                  | -                                                  | 110.710                                           | -                                                |
| País de residencia                 | -                                                                  | -                                                  | Francia                                           | -                                                |
| Transacción por país               | -                                                                  | Francia                                            | Francia                                           | Francia                                          |
|                                    | -                                                                  | 66.953.861                                         | 264.051.155                                       | 19.349.879                                       |
|                                    | -                                                                  | España                                             | España                                            | España                                           |
|                                    | -                                                                  | 8.577.372                                          | 76.545.434                                        | 4.144.793                                        |
| Operaciones de liquidación         |                                                                    |                                                    |                                                   |                                                  |
| - bipartito                        | -                                                                  | 33.230.314                                         | 82.619.037                                        | 7.166.817                                        |
| - tripartito                       | -                                                                  | 42.300.918                                         | 257.977.552                                       | 16.327.854                                       |
| Perfil de vencimiento de las OFV   |                                                                    |                                                    |                                                   |                                                  |
| Menos de 1 día                     | -                                                                  | -                                                  | -                                                 | -                                                |
| Entre 1 día y 1 semana             | -                                                                  | -                                                  | -                                                 | -                                                |
| Entre 1 semana y 1 mes             | -                                                                  | -                                                  | 25.116.278                                        | -                                                |
| Entre 1 mes y 3 meses              | -                                                                  | 19.443.061                                         | 83.369.093                                        | 4.808.489                                        |
| De 3 meses y 1 año                 | -                                                                  | -                                                  | -                                                 | -                                                |
| Más de 1 año                       | -                                                                  | -                                                  | -                                                 | -                                                |
| Vencimientos abiertos              | -                                                                  | 56.088.172                                         | 232.111.218                                       | 18.686.183                                       |
| Garantía recibida                  |                                                                    |                                                    |                                                   |                                                  |
| Tipo:                              |                                                                    |                                                    |                                                   |                                                  |
| Cash                               | -                                                                  | -                                                  | -                                                 | -                                                |
| Obligaciones                       | -                                                                  | 42.404.933                                         | 119.809.790                                       | 13.242.502                                       |
| Acciones                           | -                                                                  | 35.264.191                                         | 226.914.614                                       | 10.643.173                                       |
|                                    | -                                                                  | 77.669.124                                         | 346.724.404                                       | 23.885.675                                       |

# Candriam Bonds

## Información suplementaria

Transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización, y por el que se modifica el Reglamento (UE) n° 648/2012

| Préstamos sobre títulos                        | Candriam Bonds<br>Euro Corporate ex-<br>Financials<br><br>(en EUR) | Candriam Bonds Euro<br>Diversified<br><br>(en EUR) | Candriam Bonds Euro<br>Government<br><br>(en EUR) | Candriam Bonds<br>Euro Long Term<br><br>(en EUR) |
|------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|---------------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| Calidad de la garantía real:<br>Moneda:<br>EUR | -<br>-                                                             | AA- to BBB-<br>77.669.124                          | AAA to BBB-<br>346.724.404                        | AA+ to BBB-<br>23.885.675                        |
| Perfil de vencimiento de la garantía real :    |                                                                    |                                                    |                                                   |                                                  |
| Menos de 1 día                                 | -                                                                  | -                                                  | -                                                 | -                                                |
| Entre 1 día y 1 semana                         | -                                                                  | -                                                  | -                                                 | -                                                |
| Entre 1 semana y 1 mes                         | -                                                                  | -                                                  | -                                                 | -                                                |
| Entre 1 mes y 3 meses                          | -                                                                  | -                                                  | -                                                 | -                                                |
| De 3 meses y 1 año                             | -                                                                  | -                                                  | 1.808.339                                         | 476.833                                          |
| Más de 1 año                                   | -                                                                  | 42.404.933                                         | 118.001.451                                       | 12.765.669                                       |
| Vencimientos abiertos                          | -                                                                  | 35.264.191                                         | 226.914.614                                       | 10.643.173                                       |
| Los 10 principales emisores de garantía real   |                                                                    |                                                    |                                                   |                                                  |
| Nombre 1                                       | -                                                                  | ESPAGNE 3.8 04-24                                  | SPAI GO 1.2 10-40                                 | NRW 1.1 03-34                                    |
| Importe                                        | -                                                                  | 19.721.899                                         | 32.484.997                                        | 6.170.500                                        |
| Nombre 2                                       | -                                                                  | ITAL BUO 0.95 03-23                                | ITAL BU 0.0 04-26                                 | CRED SU 4.28 01-28                               |
| Importe                                        | -                                                                  | 8.870.456                                          | 29.909.016                                        | 3.259.313                                        |
| Nombre 3                                       | -                                                                  | ESPAGNE 5.4 01-23                                  | BAYERN 0.01 03-23                                 | IREL GO 0.0 10-31                                |
| Importe                                        | -                                                                  | 6.223.156                                          | 20.787.123                                        | 1.351.083                                        |
| Nombre 4                                       | -                                                                  | SPAI GO 1.45 10-27                                 | SPAI GO 1.45 10-27                                | PUMA SE                                          |
| Importe                                        | -                                                                  | 3.077.720                                          | 14.436.148                                        | 477.510                                          |
| Nombre 5                                       | -                                                                  | AIRBUS SE                                          | HORIZON THERAPEU                                  | STRAUMANN HLDG-                                  |
| Importe                                        | -                                                                  | 1.122.359                                          | 13.647.131                                        | 477.508                                          |
| Nombre 6                                       | -                                                                  | ROCHE HLDG-GENUS                                   | INTESA SANPAOLO                                   | HANNOVER RUECK                                   |
| Importe                                        | -                                                                  | 1.122.254                                          | 13.040.468                                        | 477.503                                          |
| Nombre 7                                       | -                                                                  | UNITEDHEALTH GRP                                   | SHOIFY INC - A                                    | RH                                               |
| Importe                                        | -                                                                  | 1.122.120                                          | 9.850.871                                         | 477.463                                          |
| Nombre 8                                       | -                                                                  | FACEBOOK INC-A                                     | CARVANA CO                                        | DOORDASH INC-A                                   |
| Importe                                        | -                                                                  | 1.122.091                                          | 9.505.362                                         | 477.460                                          |
| Nombre 9                                       | -                                                                  | ESPAGNE 4.70 07 41                                 | TWILIO INC - A                                    | TWILIO INC - A                                   |
| Importe                                        | -                                                                  | 1.121.960                                          | 9.505.071                                         | 477.448                                          |
| Nombre 10                                      | -                                                                  | WILL PA 4.5 11-23                                  | DOORDASH INC-A                                    | CARVANA CO                                       |
| Importe                                        | -                                                                  | 1.121.738                                          | 9.504.856                                         | 477.310                                          |
| Componentes de ingresos y gastos               |                                                                    |                                                    |                                                   |                                                  |
| Componente de ingresos del fondo               |                                                                    |                                                    |                                                   |                                                  |
| En valor absoluta                              | 131                                                                | 22.344                                             | 91.019                                            | 6.837                                            |
| En % de ingresos brutos                        | 60%                                                                | 60%                                                | 60%                                               | 60%                                              |
| Componente de ingresos de Candriam             |                                                                    |                                                    |                                                   |                                                  |
| En valor absoluta                              | 44                                                                 | 7.448                                              | 30.340                                            | 2.279                                            |
| En % de ingresos brutos                        | 20%                                                                | 20%                                                | 20%                                               | 20%                                              |
| Componente de ingresos de terceros             |                                                                    |                                                    |                                                   |                                                  |
| En valor absoluta                              | 44                                                                 | 7.448                                              | 30.340                                            | 2.279                                            |
| En % de ingresos brutos                        | 20%                                                                | 20%                                                | 20%                                               | 20%                                              |

# Candriam Bonds

## Información suplementaria

Transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización, y por el que se modifica el Reglamento (UE) n° 648/2012

| Préstamos sobre títulos            | Candriam Bonds<br>Euro Short Term         | Candriam Bonds<br>Floating Rate Notes | Candriam Bonds<br>Global Government       | Candriam Bonds<br>Global Inflation<br>Short Duration |
|------------------------------------|-------------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------------|
|                                    | (en EUR)                                  | (en EUR)                              | (en EUR)                                  | (en EUR)                                             |
| Activos utilizados                 |                                           |                                       |                                           |                                                      |
| En valor absoluta                  | 188.442.208                               | 2.331.251                             | 13.554.912                                | 38.473.602                                           |
| Como % de los activos prestables   | 13,05%                                    | 0,42%                                 | 10,64%                                    | 15,28%                                               |
| Como % del valor liquidativo total | 12,99%                                    | 0,42%                                 | 10,31%                                    | 15,11%                                               |
| Las 10 contrapartes principales    |                                           |                                       |                                           |                                                      |
| Nombre 1                           | Société Générale SA                       | Banco Santander                       | Banco Santander                           | Société Générale SA                                  |
| Importe                            | 170.477.570                               | 2.331.251                             | 7.026.204                                 | 20.622.999                                           |
| País de residencia                 | Francia                                   | España                                | España                                    | Francia                                              |
| Nombre 2                           | BNP Paribas SA                            | -                                     | BNP Paribas<br>Securities Services<br>SCA | BNP Paribas<br>Securities Services<br>SCA            |
| Importe                            | 9.526.723                                 | -                                     | 5.141.934                                 | 17.850.603                                           |
| País de residencia                 | Francia                                   | -                                     | Francia                                   | Francia                                              |
| Nombre 3                           | BNP Paribas<br>Securities Services<br>SCA | -                                     | Société Générale SA                       | -                                                    |
| Importe                            | 6.763.081                                 | -                                     | 1.070.157                                 | -                                                    |
| País de residencia                 | Francia                                   | -                                     | Francia                                   | -                                                    |
| Nombre 4                           | BofA Securities<br>Europe SA              | -                                     | BNP Paribas SA                            | -                                                    |
| Importe                            | 1.115.241                                 | -                                     | 316.617                                   | -                                                    |
| País de residencia                 | Francia                                   | -                                     | Francia                                   | -                                                    |
| Nombre 5                           | Mizuho International<br>PLC               | -                                     | -                                         | -                                                    |
| Importe                            | 559.595                                   | -                                     | -                                         | -                                                    |
| País de residencia                 | Gran Bretaña                              | -                                     | -                                         | -                                                    |
| Transacción por país               | Francia<br>187.882.613                    | España<br>2.331.251                   | España<br>7.026.204                       | Francia<br>38.473.602                                |
|                                    | Gran Bretaña<br>559.595                   | -                                     | Francia<br>6.528.708                      | -                                                    |
| Operaciones de liquidación         |                                           |                                       |                                           |                                                      |
| - bipartito                        | 9.526.723                                 | -                                     | 316.617                                   | -                                                    |
| - tripartito                       | 178.915.485                               | 2.331.251                             | 13.238.295                                | 38.473.602                                           |
| Perfil de vencimiento de las OFV   |                                           |                                       |                                           |                                                      |
| Menos de 1 día                     | -                                         | -                                     | -                                         | -                                                    |
| Entre 1 día y 1 semana             | -                                         | -                                     | -                                         | -                                                    |
| Entre 1 semana y 1 mes             | -                                         | -                                     | -                                         | -                                                    |
| Entre 1 mes y 3 meses              | 6.763.081                                 | -                                     | 2.985.815                                 | 17.850.603                                           |
| De 3 meses y 1 año                 | -                                         | -                                     | -                                         | -                                                    |
| Más de 1 año                       | -                                         | -                                     | -                                         | -                                                    |
| Vencimientos abiertos              | 181.679.127                               | 2.331.251                             | 10.569.097                                | 20.622.999                                           |
| Garantía recibida                  |                                           |                                       |                                           |                                                      |
| Tipo:                              |                                           |                                       |                                           |                                                      |
| Cash                               | -                                         | -                                     | -                                         | -                                                    |
| Obligaciones                       | 184.270.208                               | -                                     | 2.055.490                                 | 4.109.191                                            |
| Acciones                           | 6.101.880                                 | 2.449.348                             | 11.595.155                                | 34.777.767                                           |
|                                    | 190.372.088                               | 2.449.348                             | 13.650.645                                | 38.886.958                                           |

# Candriam Bonds

## Información suplementaria

Transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización, y por el que se modifica el Reglamento (UE) n° 648/2012

| Préstamos sobre títulos                      | Candriam Bonds Euro Short Term | Candriam Bonds Floating Rate Notes | Candriam Bonds Global Government | Candriam Bonds Global Inflation Short Duration |
|----------------------------------------------|--------------------------------|------------------------------------|----------------------------------|------------------------------------------------|
|                                              | (en EUR)                       | (en EUR)                           | (en EUR)                         | (en EUR)                                       |
| Calidad de la garantía real:                 | AAA to BBB-                    | A+ to BBB-                         | A+ to BBB-                       | AA- to BBB+                                    |
| Moneda:                                      |                                |                                    |                                  |                                                |
| EUR                                          | 190.372.088                    | 2.449.348                          | 13.650.645                       | 38.886.958                                     |
| Perfil de vencimiento de la garantía real :  |                                |                                    |                                  |                                                |
| Menos de 1 día                               | -                              | -                                  | -                                | -                                              |
| Entre 1 día y 1 semana                       | -                              | -                                  | -                                | -                                              |
| Entre 1 semana y 1 mes                       | -                              | -                                  | -                                | -                                              |
| Entre 1 mes y 3 meses                        | -                              | -                                  | -                                | -                                              |
| De 3 meses y 1 año                           | 676.107                        | -                                  | 297.329                          | -                                              |
| Más de 1 año                                 | 183.594.101                    | -                                  | 1.758.161                        | 4.109.191                                      |
| Vencimientos abiertos                        | 6.101.880                      | 2.449.348                          | 11.595.155                       | 34.777.767                                     |
| Los 10 principales emisores de garantía real |                                |                                    |                                  |                                                |
| Nombre 1                                     | ITAL BUO 0.1 05-22             | BNP PARIBAS                        | BNP PARIBAS                      | NOVO NORDISK-B                                 |
| Importe                                      | 53.729.971                     | 244.754                            | 703.586                          | 2.058.521                                      |
| Nombre 2                                     | BNP PAR 0.85 02-29             | TOTALENERGIES SE                   | DANONE                           | ERSTE GROUP BANK                               |
| Importe                                      | 35.099.461                     | 244.746                            | 703.579                          | 2.058.502                                      |
| Nombre 3                                     | BELGIUM KING 4.5 26            | TRIPADVISOR INC                    | TOTALENERGIES SE                 | AIRBUS SE                                      |
| Importe                                      | 34.342.196                     | 244.745                            | 703.576                          | 2.058.479                                      |
| Nombre 4                                     | REGI WA 0.05 06-25             | L OREAL                            | TRIPADVISOR INC                  | SHOPIFY INC - A                                |
| Importe                                      | 20.402.697                     | 244.742                            | 703.561                          | 2.058.479                                      |
| Nombre 5                                     | ITAL BU 0.4 05-30              | WILLIS TOWERS WA                   | PANDORA A S                      | FACEBOOK INC-A                                 |
| Importe                                      | 10.142.258                     | 244.714                            | 703.546                          | 2.058.468                                      |
| Nombre 6                                     | IREL GO 0.0 10-31              | DANONE                             | FLUTTER ENTER-DI                 | CUMMINS INC                                    |
| Importe                                      | 9.757.977                      | 244.713                            | 703.509                          | 2.058.436                                      |
| Nombre 7                                     | EUROP INV BK 3 2022            | PANDORA A S                        | L OREAL                          | UNITEDHEALTH GRP                               |
| Importe                                      | 8.354.377                      | 244.698                            | 703.497                          | 2.058.428                                      |
| Nombre 8                                     | ITAL BU 0.65 05-26             | SAFRAN SA                          | SAFRAN SA                        | ROCHE HLDG-GENUS                               |
| Importe                                      | 7.315.183                      | 244.685                            | 703.496                          | 2.058.416                                      |
| Nombre 9                                     | ESPAGNE 3.8 30 04 2            | ESSILORLUXOTTICA                   | ESSILORLUXOTTICA                 | ESPAGNE 4.70 07 41                             |
| Importe                                      | 2.742.231                      | 244.672                            | 703.486                          | 2.057.468                                      |
| Nombre 10                                    | FRAN GO 0.5 06-44              | FLUTTER ENTER-DI                   | WILLIS TOWERS WA                 | CELL TE 0.5 07-28                              |
| Importe                                      | 1.126.356                      | 244.616                            | 703.414                          | 2.051.723                                      |
| Componentes de ingresos y gastos             |                                |                                    |                                  |                                                |
| Componente de ingresos del fondo             |                                |                                    |                                  |                                                |
| En valor absoluta                            | 34.436                         | 83                                 | 8.258                            | 23.150                                         |
| En % de ingresos brutos                      | 60%                            | 60%                                | 60%                              | 60%                                            |
| Componente de ingresos de Candriam           |                                |                                    |                                  |                                                |
| En valor absoluta                            | 11.479                         | 28                                 | 2.753                            | 7.717                                          |
| En % de ingresos brutos                      | 20%                            | 20%                                | 20%                              | 20%                                            |
| Componente de ingresos de terceros           |                                |                                    |                                  |                                                |
| En valor absoluta                            | 11.479                         | 28                                 | 2.753                            | 7.717                                          |
| En % de ingresos brutos                      | 20%                            | 20%                                | 20%                              | 20%                                            |

# Candriam Bonds

## Información suplementaria

Transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización, y por el que se modifica el Reglamento (UE) nº 648/2012

| Préstamos sobre títulos            | Candriam Bonds<br>International<br>(en EUR) | Candriam Bonds<br>Total Return<br>(en EUR) |
|------------------------------------|---------------------------------------------|--------------------------------------------|
| Activos utilizados                 |                                             |                                            |
| En valor absoluta                  | 4.874.909                                   | 57.092.031                                 |
| Como % de los activos prestables   | 4,52%                                       | 6,66%                                      |
| Como % del valor liquidativo total | 4,45%                                       | 5,85%                                      |
| Las 10 contrapartes principales    |                                             |                                            |
| Nombre 1                           | BNP Paribas SA                              | BNP Paribas<br>Securities Services<br>SCA  |
| Importe                            | 1.594.969                                   | 31.301.197                                 |
| País de residencia                 | Francia                                     | Francia                                    |
| Nombre 2                           | Banco Santander                             | BNP Paribas SA                             |
| Importe                            | 1.029.738                                   | 19.793.208                                 |
| País de residencia                 | España                                      | Francia                                    |
| Nombre 3                           | BNP Paribas<br>Arbitrage                    | BNP Paribas<br>Arbitrage                   |
| Importe                            | 987.053                                     | 3.308.246                                  |
| País de residencia                 | Francia                                     | Francia                                    |
| Nombre 4                           | BNP Paribas<br>Securities Services<br>SCA   | Banco Santander                            |
| Importe                            | 811.915                                     | 2.689.380                                  |
| País de residencia                 | Francia                                     | España                                     |
| Nombre 5                           | Société Générale SA                         | -                                          |
| Importe                            | 451.234                                     | -                                          |
| País de residencia                 | Francia                                     | -                                          |
| Transacción por país               | Francia                                     | Francia                                    |
|                                    | 3.845.171                                   | 54.402.651                                 |
|                                    | España                                      | España                                     |
|                                    | 1.029.738                                   | 2.689.380                                  |
| Operaciones de liquidación         |                                             |                                            |
| - bipartito                        | 1.594.969                                   | 19.793.208                                 |
| - tripartito                       | 3.279.940                                   | 37.298.823                                 |
| Perfil de vencimiento de las OFV   |                                             |                                            |
| Menos de 1 día                     | -                                           | -                                          |
| Entre 1 día y 1 semana             | -                                           | -                                          |
| Entre 1 semana y 1 mes             | -                                           | -                                          |
| Entre 1 mes y 3 meses              | -                                           | -                                          |
| De 3 meses y 1 año                 | -                                           | -                                          |
| Más de 1 año                       | -                                           | -                                          |
| Vencimientos abiertos              | 4.874.909                                   | 57.092.031                                 |
| Garantía recibida                  |                                             |                                            |
| Tipo:                              |                                             |                                            |
| Cash                               |                                             | -                                          |
| Obligaciones                       | 2.440.328                                   | 21.921.913                                 |
| Acciones                           | 2.773.117                                   | 36.974.978                                 |
|                                    | 5.213.445                                   | 58.896.891                                 |

# Candriam Bonds

## Información suplementaria

Transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización, y por el que se modifica el Reglamento (UE) n° 648/2012

| Préstamos sobre títulos                      | Candriam Bonds International<br>(en EUR) | Candriam Bonds Total Return<br>(en EUR) |
|----------------------------------------------|------------------------------------------|-----------------------------------------|
| Calidad de la garantía real:                 | AA+ to BBB-                              | AA+ to BBB-                             |
| Moneda:<br>EUR                               | 5.213.445                                | 58.896.891                              |
| Perfil de vencimiento de la garantía real :  |                                          |                                         |
| Menos de 1 día                               | -                                        | -                                       |
| Entre 1 día y 1 semana                       | -                                        | -                                       |
| Entre 1 semana y 1 mes                       | -                                        | -                                       |
| Entre 1 mes y 3 meses                        | -                                        | -                                       |
| De 3 meses y 1 año                           | -                                        | -                                       |
| Más de 1 año                                 | 2.440.328                                | 21.921.913                              |
| Vencimientos abiertos                        | 2.773.117                                | 36.974.978                              |
| Los 10 principales emisores de garantía real |                                          |                                         |
| Nombre 1                                     | NRW 1.1 03-34                            | LUXE GO 0.0 04-30                       |
| Importe                                      | 1.684.767                                | 10.711.243                              |
| Nombre 2                                     | TRIPADVISOR INC                          | IREL GO 0.0 10-31                       |
| Importe                                      | 102.073                                  | 9.465.795                               |
| Nombre 3                                     | TOTALENERGIES SE                         | MITSUBISHI UFJ F                        |
| Importe                                      | 102.072                                  | 3.124.526                               |
| Nombre 4                                     | DANONE                                   | BANCO SANTANDER                         |
| Importe                                      | 102.057                                  | 3.124.523                               |
| Nombre 5                                     | BNP PARIBAS                              | DAIICHI SANKYO                          |
| Importe                                      | 102.036                                  | 3.124.523                               |
| Nombre 6                                     | FLUTTER ENTER-DI                         | UBS GROUP AG                            |
| Importe                                      | 102.009                                  | 3.124.519                               |
| Nombre 7                                     | ESSILORLUXOTTICA                         | MITSUI OSK LINES                        |
| Importe                                      | 102.008                                  | 3.124.518                               |
| Nombre 8                                     | PANDORA A S                              | MIZUHO FINANCIAL                        |
| Importe                                      | 102.002                                  | 3.124.518                               |
| Nombre 9                                     | SAFRAN SA                                | MORGAN STANLEY                          |
| Importe                                      | 101.970                                  | 3.124.512                               |
| Nombre 10                                    | L OREAL                                  | RECRUIT HOLDINGS                        |
| Importe                                      | 101.946                                  | 3.124.500                               |
| Componentes de ingresos y gastos             |                                          |                                         |
| <i>Componente de ingresos del fondo</i>      |                                          |                                         |
| En valor absoluta                            | 1.189                                    | 14.284                                  |
| En % de ingresos brutos                      | 60%                                      | 60%                                     |
| <i>Componente de ingresos de Candriam</i>    |                                          |                                         |
| En valor absoluta                            | 396                                      | 4.761                                   |
| En % de ingresos brutos                      | 20%                                      | 20%                                     |
| <i>Componente de ingresos de terceros</i>    |                                          |                                         |
| En valor absoluta                            | 396                                      | 4.761                                   |
| En % de ingresos brutos                      | 20%                                      | 20%                                     |

Cada subfondo tiene a CACEIS Bank, Luxembourg Branch, como depositario de las garantías recibidas. Las garantías relativas a las operaciones de préstamo de valores no se reutilizarán

# Candriam Bonds

## Información suplementaria

Transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización, y por el que se modifica el Reglamento (UE) n° 648/2012

| Total Return Swaps                        | Candriam Bonds Credit Alpha<br>(en EUR) | Candriam Bonds Credit Opportunities<br>(en EUR) | Candriam Bonds Euro High Yield<br>(en EUR) |
|-------------------------------------------|-----------------------------------------|-------------------------------------------------|--------------------------------------------|
| Activos utilizados                        |                                         |                                                 |                                            |
| En valor absoluta                         | 286.697                                 | 4.195.622                                       | 4.728.567                                  |
| En % del valor total de los activos netos | 0,28%                                   | 0,27%                                           | 0,15%                                      |
| Nomínale                                  | 17.000.000                              | 398.000.000                                     | 287.399.993                                |
| En % del valor neto de los activos        | 16,67%                                  | 25,32%                                          | 52,71%                                     |
| Las 10 contrapartes principales           |                                         |                                                 |                                            |
| Nombre 1                                  | Barclays Bank Irlanda Plc               | Goldman Sachs Intl. Paris Branch                | BNP Paribas Paris                          |
| Importe                                   | 8.000.000                               | 179.000.000                                     | 94.099.993                                 |
| País de residencia                        | Irlanda                                 | Francia                                         | Francia                                    |
| Nombre 2                                  | Goldman Sachs Intl. Paris Branch        | Barclays Bank Irlanda Plc                       | Security Pacific National Bank             |
| Importe                                   | 5.500.000                               | 93.000.000                                      | 67.500.000                                 |
| País de residencia                        | Francia                                 | Irlanda                                         | Estados Unidos de América                  |
| Nombre 3                                  | BNP Paribas Paris                       | J.P. Morgan AG                                  | Goldman Sachs Intl. Paris Branch           |
| Importe                                   | 3.500.000                               | 53.000.000                                      | 62.900.000                                 |
| País de residencia                        | Francia                                 | Alemania                                        | Francia                                    |
| Nombre 4                                  |                                         | Société Générale                                | Société Générale                           |
| Importe                                   |                                         | 23.000.000                                      | 62.900.000                                 |
| País de residencia                        |                                         | Francia                                         | Francia                                    |
| Transacción por país                      | Francia                                 | Francia                                         | Francia                                    |
|                                           | 9.000.000                               | 252.000.000                                     | 219.899.993                                |
|                                           | Irlanda                                 | Irlanda                                         | Estados Unidos de América                  |
|                                           | 8.000.000                               | 93.000.000                                      | 67.500.000                                 |
|                                           |                                         | Alemania                                        |                                            |
|                                           |                                         | 53.000.000                                      |                                            |
| Garantía recibida                         |                                         | Goldman Sachs Intl. Paris Branch                | BNP Paribas Paris                          |
| Cash                                      | -                                       | 13.820.000*                                     | 3.100.000*                                 |
| Cash                                      | -                                       | J.P. Morgan AG                                  | -                                          |
| Cash                                      | -                                       | 620.000*                                        | -                                          |
| Cash                                      | -                                       | Société Générale                                | -                                          |
| Cash                                      | -                                       | 320.000*                                        | -                                          |
| Perfil de vencimiento de las OFV          |                                         |                                                 |                                            |
| Vencimientos abiertos                     | -                                       | 14.760.000                                      |                                            |
| Componentes de ingresos y gastos          |                                         |                                                 |                                            |
| Componente de ingresos del fondo          |                                         |                                                 |                                            |
| En valor absoluta                         | 33.980                                  | 981.729                                         | 561.692                                    |
| En % de ingresos brutos                   | 100%                                    | 100%                                            | 100%                                       |
| Componente de gastos del fondo            |                                         |                                                 |                                            |
| En valor absoluta                         | 404.106                                 | 7.818.467                                       | 3.291.198                                  |

No se prevé la reutilización de las garantías relativas al Total Return Swaps.

(\*) Los importes de las garantías en efectivo reflejan la posición global de cada subfondo frente a las distintas contrapartes.

# Candriam Bonds

## Información suplementaria

Transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización, y por el que se modifica el Reglamento (UE) n° 648/2012

| Cobrar por pactos de recompra inversa        | Candriam Bonds Credit Alpha<br>(en EUR) |
|----------------------------------------------|-----------------------------------------|
| Activos utilizados                           |                                         |
| En valor absoluta                            | 24.997.952                              |
| Como % del valor liquidativo total           | 24,51%                                  |
| Perfil de vencimiento de las OFV             |                                         |
| Menos de 1 día                               | -                                       |
| Entre 1 día y 1 semana                       | -                                       |
| Entre 1 semana y 1 mes                       | 9.998.352                               |
| Entre 1 mes y 3 meses                        | 14.999.600                              |
| De 3 meses y 1 año                           | -                                       |
| Más de 1 año                                 | -                                       |
| Vencimientos abiertos                        | -                                       |
| Garantía recibida                            |                                         |
| Tipo:<br>Obligaciones                        | 24.833.526                              |
| Calidad de la garantía real: A+              | 24.833.526                              |
| Perfil de vencimiento de las OFV             |                                         |
| Menos de 1 día                               | -                                       |
| Entre 1 día y 1 semana                       | -                                       |
| Entre 1 semana y 1 mes                       | -                                       |
| Entre 1 mes y 3 meses                        | -                                       |
| De 3 meses y 1 año                           | -                                       |
| Más de 1 año                                 | 24.833.526                              |
| Vencimientos abiertos                        | -                                       |
| Los 10 principales emisores de garantía real |                                         |
| Nombre 1                                     | Francia                                 |
| Importe                                      | 24.833.526                              |
| Contrapartes                                 |                                         |
| Nombre 1                                     | Caceis Bank. Lux. Branch                |
| Importe                                      | 24.833.526                              |
| Componentes de ingresos y gastos             |                                         |
| Componente de ingresos del fondo             |                                         |
| En valor absoluta                            | -                                       |
| En % de ingresos brutos                      | -                                       |
| Componente de gastos del fondo               |                                         |
| En valor absoluta                            | 29.664                                  |
| En % de los ingresos brutos                  | 100%                                    |

Cada subfondo tiene a CACEIS Bank, Luxembourg Branch, como depositario de las garantías recibidas.

Todas las transacciones son bipartitas.

Las garantías relativas a las operaciones de préstamo de valores no se reutilizarán.