



Unselbständiger Investmentfonds (FCP) nach  
französischem Recht

HALBJAHRESBERICHT

## **CANDRIAM MULTI-STRATEGIES**

zum 30. Juni 2023

Verwaltungsgesellschaft: CANDRIAM

Depotbank: CACEIS Bank

Abschlussprüfer: PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDIT

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG IN EUR

Elemente der Vermögensaufstellung	Betrag des Zwischenabschlusses *
a) Zulässige Wertpapiere im Sinne von Artikel L.214-20 Abschnitt I Punkt 1 des französischen Code Monétaire et Financier	0,00
b) Bankguthaben	1 032 993,27
c) Sonstige vom OGA gehaltene Vermögenswerte	39 778 218,03
d) Vermögenswerte im Bestand des OGA insgesamt (Zeilen a+b+c)	40 811 211,30
e) Passiva	-692 106,78
f) Nettoinventarwert (Zeilen d+e = Nettovermögen des OGA)	40 119 104,52

\* Die Beträge weisen Vorzeichen auf

## ANZAHL DER IM UMLAUF BEFINDLICHEN ANTEILE UND NETTOINVENTARWERT JE ANTEIL

Anteil	Art des Anteils	Nettovermögen je Anteil	Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil
CANDRIAM MULTI STRATEGIES Anteil CLASSIQUE	C	40 119 104,52	36 340,984	1 103,96

## ELEMENTE DES WERTPAPIERBESTANDS

Elemente des Wertpapierbestands	Prozentsatz Nettovermögen *	Prozentsatz Vermögenswerte insgesamt **
A) Zulässige Wertpapiere und die Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden, im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Code Monétaire et financier.  Und B) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem sonstigen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist und in einem Mitgliedsstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Unterzeichnerstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum liegt, gehandelt werden.	0,00	0,00
C) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer geregelten Wertpapierbörse eines Drittlandes amtlich notiert sind oder an einem sonstigen Markt eines Drittlandes gehandelt werden, die/der für das Publikum offen, anerkannt ist und ordnungsgemäß funktioniert, sofern diese Börse bzw. dieser Markt nicht auf einer von der Autorité des Marchés Financiers erstellten Liste der ausgeschlossenen Länder steht bzw. sofern die Wahl dieser Börse bzw. dieses Marktes in den gesetzlichen Vorschriften und/oder den Vertragsbedingungen oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist.	0,00	0,00
D) Zulässige Wertpapiere aus Neuemissionen im Sinne von Artikel R.214-11 Abschnitt I Punkt 4 des französischen Code Monétaire et Financier.	0,00	0,00
E) Sonstige Vermögenswerte.	99,15	97,47

\* Siehe f) in der Vermögensaufstellung

\*\* Siehe d) in der Vermögensaufstellung

**AUFTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE VON A), B), C) UND D) DES WERTPAPIERBESTANDS, NACH WÄHRUNG**

<b>Wertpapiere</b>	<b>Währung</b>	<b>Als Betrag (EUR)</b>	<b>Prozentsatz Nettovermögen *</b>	<b>Prozentsatz Vermögenswerte insgesamt **</b>
–				

\* *Siehe f) in der Vermögensaufstellung*

\*\* *Siehe d) in der Vermögensaufstellung*

**AUFTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE VON A), B), C) UND D) DES WERTPAPIERBESTANDS, NACH SITZLAND DES EMITTENTEN**

<b>Land</b>	<b>Prozentsatz Nettovermögen *</b>	<b>Prozentsatz Vermögenswerte insgesamt **</b>
–		

\* *Siehe f) in der Vermögensaufstellung*

\*\* *Siehe d) in der Vermögensaufstellung*

## AUFTEILUNG DER SONSTIGEN VERMÖGENSWERTE VON E) DES WERTPAPIERBESTANDS, NACH ART

Art der Vermögenswerte	Prozentsatz Nettovermögen *	Prozentsatz Vermögenswerte insgesamt **
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>		
OGAW und AIF mit allgemeiner Zielsetzung, die sich an nicht institutionelle Anleger richten, und vergleichbare Fonds aus sonstigen Ländern	99,15	97,47
Sonstige Fonds, die sich an nicht institutionelle Anleger richten, und vergleichbare Fonds aus sonstigen Mitgliedstaaten der EU	0,00	0,00
Institutionelle Fonds mit allgemeiner Zielsetzung und vergleichbare Fonds aus sonstigen Mitgliedstaaten der EU und börsennotierte Organismen für Verbriefungen	0,00	0,00
Sonstige institutionelle Investmentfonds und vergleichbare Fonds aus sonstigen Mitgliedstaaten der EU und nicht börsennotierte Organismen für Verbriefungen	0,00	0,00
Sonstige nicht-europäische Organismen	0,00	0,00
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>		
Sonstiges	0,00	0,00
<b>INSGESAMT</b>	<b>99,15</b>	<b>97,47</b>

\* Siehe f) in der Vermögensaufstellung

\*\* Siehe d) in der Vermögensaufstellung

## VERÄNDERUNGEN DES WERTPAPIERBESTANDS IM LAUFE DES ZEITRAUMS IN EUR

Elemente des Wertpapierbestands	Veränderungen (als Betrag)	
	Käufe	Verkäufe
A) Zulässige Wertpapiere und die Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden, im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Code Monétaire et financier.  Und B) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem sonstigen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist und in einem Mitgliedsstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Unterzeichnerstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum liegt, gehandelt werden.	0,00	0,00
C) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer geregelten Wertpapierbörse eines Drittlandes amtlich notiert sind oder an einem sonstigen Markt eines Drittlandes gehandelt werden, die/der für das Publikum offen, anerkannt ist und ordnungsgemäß funktioniert, sofern diese Börse bzw. dieser Markt nicht auf einer von der Autorité des Marchés Financiers erstellten Liste der ausgeschlossenen Länder steht bzw. sofern die Wahl dieser Börse bzw. dieses Marktes in den gesetzlichen Vorschriften und/oder den Vertragsbedingungen oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist.	0,00	0,00
D) Zulässige Wertpapiere aus Neuemissionen im Sinne von Artikel R.214-11 Abschnitt I Punkt 4 des französischen Code Monétaire et Financier.	0,00	0,00
E) Sonstige Vermögenswerte.	19 443 163,66	16 314 024,33

## INFORMATION ÜBER VARIABLE VERWALTUNGSGEBÜHREN

	30/06/2023
Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der Rückstellung für Verbindlichkeiten aus variablen Verwaltungsgebühren	0,00
Vereinnahmte variable Verwaltungsgebühren	0,00
Prozentualer Anteil der vereinnahmen variablen Verwaltungsgebühren	0,00



**TRANSPARENZ VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN UND DER WEITERVERWENDUNG VON FINANZINSTRUMENTEN – UNTER ANWENDUNG DES SFTR – in der Rechnungswährung des OGA (EUR)**

Im Verlauf des Geschäftsjahres hat der OGAW keine Geschäfte getätigt, die der SFTR-Verordnung unterliegen.

**WERTPAPIERBESTAND ZUM 30.06.2023 IN EUR**

Bezeichnung der Wertpapiere	Währung	Stückzahl/ Nennwert	Zeitwert	% Netto- vermögen
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>OGAW und AIF mit allgemeiner Zielsetzung, die sich an nicht institutionelle Anleger richten, und vergleichbare Fonds aus sonstigen Ländern</b>				
<b>FRANKREICH</b>				
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES I EUR ACC	EUR	136,17936	1 983 625,33	4,95
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE C EUR ACC	EUR	2 702,824	3 835 226,17	9,56
CANDRIAM LONG SHORT CREDIT R EUR ACC	EUR	36 587,5	3 899 129,88	9,72
CANDRIAM MONETAIRE SICAV Z	EUR	5 233	7 856 459,89	19,58
CANDRIAM RISK ARBITRAGE C EUR ACC	EUR	1 597	3 894 987,18	9,70
<b>SUMME FRANKREICH</b>			<b>21 469 428,45</b>	<b>53,51</b>
<b>LUXEMBURG</b>				
CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQ MARK NEUTRAL PI EUR CAP	EUR	607	1 169 852,89	2,91
CANDRIAM BONDS CONVERTIBLE DEFENSIVE I EUR ACC	EUR	382,215	613 134,01	1,53
CANDRIAM BONDS EURO SHORT TERM I EUR ACC	EUR	833,5	1 761 468,89	4,39
CANDRIAM BONDS FLOATING RATE NOTES Z EUR ACC	EUR	2 513	3 834 435,92	9,56
CANDRIAM BONDS TOTAL RETURN I EUR ACC	EUR	2 253,017	3 138 114,73	7,82
CANDRIAM MONEY MARKET EURO AAA Z EUR ACC	EUR	7 297,583	7 790 680,68	19,42
CANDR MONEY MARKET-I-C	EUR	2	1 102,46	0,01
<b>SUMME LUXEMBURG</b>			<b>18 308 789,58</b>	<b>45,64</b>
<b>SUMME OGAW und AIF mit allgemeiner Zielsetzung, die sich an nicht institutionelle Anleger richten, und vergleichbare Fonds aus sonstigen Ländern</b>			<b>39 778 218,03</b>	<b>99,15</b>
<b>SUMME Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			<b>39 778 218,03</b>	<b>99,15</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>			<b>-9 877,51</b>	<b>-0,02</b>
<b>Finanzkonten</b>			<b>350 764,00</b>	<b>0,87</b>
<b>Nettovermögen</b>			<b>40 119 104,52</b>	<b>100,00</b>
<b>Anteile CANDRIAM MULTI STRATEGIES Anteil CLASSIQUE</b>	<b>EUR</b>	<b>36 340,984</b>	<b>1 103,96</b>	

## Informationen für Anleger in der Bundesrepublik Deutschland

Einrichtungen gemäß Art. 92 Abs. 1 der Richtlinie 2009/65/EG in der Fassung der Richtlinie (EU) 2019/1160

Marcard, Stein & Co AG, Ballindamm 36, D-20095 Hamburg:

- Bei dieser Einrichtung können Anträge auf die Zeichnung, die Rücknahme und den Umtausch von Anteilen eingereicht werden.
- Sämtliche für einen Anteilinhaber bestimmte Zahlungen, einschließlich der Rücknahmeerlöse und etwaiger Ausschüttungen, können auf seinen Wunsch hin über diese Einrichtung geleitet werden.
- Der Verkaufsprospekt, die Basisinformationsblätter, die Satzung der SICAV, die letzten veröffentlichten Jahres- und Halbjahresberichte – auf Anfrage jeweils in Papierform – sowie sonstige Angaben und Unterlagen sind bei dieser Einrichtung kostenlos verfügbar.
- Der Nettoinventarwert pro Anteil, die Ausgabe-, Rücknahme-, und Umtauschpreise sind bei dieser Einrichtung kostenlos verfügbar.
- Diese Einrichtung fungiert als Kontaktstelle für die Kommunikation mit der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht.

Die Website [www.candriam.com](http://www.candriam.com):

- Der Verkaufsprospekt, die Basisinformationsblätter, die Satzung der SICAV, die letzten veröffentlichten Jahres- und Halbjahresberichte sowie sonstige Angaben und Unterlagen werden auf dieser Website veröffentlicht und sind dort kostenlos verfügbar.
- Der Nettoinventarwert pro Anteil sowie die Ausgabe-, Rücknahme-, und Umtauschpreise werden auf dieser Website veröffentlicht und sind dort kostenlos verfügbar.

Der Gesellschaftssitz der SICAV:

- Der Verkaufsprospekt, die Basisinformationsblätter, die Satzung der SICAV, die letzten veröffentlichten Jahres- und Halbjahresberichte – auf Anfrage jeweils in Papierform – sowie sonstige Angaben und Unterlagen sind am Gesellschaftssitz der SICAV kostenlos verfügbar.
- Der Nettoinventarwert pro Anteil sowie die Ausgabe-, Rücknahme-, und Umtauschpreise sind am Gesellschaftssitz der SICAV kostenlos verfügbar.

Etwaige Mitteilungen an die Anteilinhaber in Deutschland werden unter [www.candriam.com](http://www.candriam.com) veröffentlicht und an die Anteilinhaber an ihre im Anteilinhaberregister eingetragene Anschrift übersandt. In den folgenden Fällen wird eine Mitteilung per dauerhaftem Datenträger veröffentlicht: Die Aussetzung der Rücknahme der Anteile des Fonds; die Kündigung der Verwaltung des Fonds oder dessen Abwicklung; bei Änderungen von Anlagebedingungen, die mit den bisherigen Anlagegrundsätzen nicht vereinbar sind oder bei anlegerbenachteiligenden Änderungen von wesentlichen Anlegerrechten oder bei anlegerbenachteiligenden Änderungen, die die Vergütungen und Aufwendungserstattungen betreffen, die aus dem Investmentvermögen entnommen werden können (einschließlich der Hintergründe der Änderungen sowie der Rechte der Anleger); die Verschmelzung des Fonds oder eines Teilfonds sowie die Umwandlung des Fonds oder eines Teilfonds in einen Feederfonds.

## **Hinweise für Anleger in Österreich**

### **Kontakt- und Informationsstelle in Österreich**

Kontakt- und Informationsstelle in Österreich gemäß den Bestimmungen nach EU-Richtlinie 2019/1160 Art. 92:

Erste Bank der oesterreichischen Sparkassen AG

Am Belvedere 1,

A-1100 Wien

E-Mail: [foreignfunds0540@erstebank.at](mailto:foreignfunds0540@erstebank.at)