



FIC de derecho francés

FOLLETO SEMESTRAL

CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES

a 30 de junio de 2022

Sociedad Gestora: CANDRIAM France

Depositario: CACEIS Bank

Auditor de cuentas: PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDIT

CANDRIAM France - 40 rue de Washington - 75008, París

ESTADO DEL PATRIMONIO EN EUR

Elementos del estado del patrimonio	Importe al cierre del periodo*
a) Títulos financieros admisibles mencionados en el apartado 1.º del inciso l del artículo L. 214-20 del Código Monetario y Financiero	0,00
b) Activos bancarios	29 162 599,71
c) Otros activos mantenidos por la IIC	305 899 545,77
d) Total de activos mantenidos por la IIC (líneas a+b+c)	335 062 145,48
e) Pasivo	-22 221 562,72
f) Valor liquidativo (líneas d+e = patrimonio neto de la IIC)	312 840 582,76

* Los importes están certificados

NÚMERO DE PARTICIPACIONES EN CIRCULACIÓN Y VALOR LIQUIDATIVO POR PARTICIPACIÓN

Participación	Tipo de participación	Patrimonio neto por participación	Número de participaciones en circulación	Valor liquidativo por participación
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación CLASSIQUE en EUR	C	7 643 217,04	587,97496	12 999,22
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación «I» en EUR	C	159 676 714,54	11 666,77496	13 686,44
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación «I» USD en USD	C	703 457,56	357,00000	1 970,46
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación «N» en EUR	C	420 482,02	2 474,08123	169,95
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación «R» en EUR	C	60 403 407,47	351 544,36768	171,82
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación «U» en EUR	C	7 651 473,70	38 802,68289	197,18
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación «Z» en EUR	C	76 372 412,62	53 710,65500	1 421,92

ELEMENTOS DE LA CARTERA DE VALORES

Elementos de la cartera de valores	Porcentaje del patrimonio neto*	Porcentaje total de los activos**
<p>A) Títulos financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en un mercado regulado en el sentido del artículo L. 422-1 del Código Monetario y Financiero.</p> <p>Y B) Títulos financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en otro mercado regulado, con funcionamiento regular, reconocido, abierto al público y cuyo domicilio se encuentre en un Estado miembro de la Unión Europea o en otro Estado que haya suscrito el acuerdo sobre el Espacio Económico Europeo.</p>	0,00	0,00
<p>C) Títulos financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores de un país tercero o negociados en otro mercado de un país tercero, regulado, con funcionamiento regular, reconocido y abierto al público, siempre y cuando dicha bolsa o mercado no figuren en una lista elaborada por la Autoridad de los Mercados Financieros o su elección haya sido prevista por la ley, por el reglamento o por los estatutos del organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios.</p>	0,00	0,00
<p>D) Títulos financieros de admisibles de emisión reciente mencionados en el apartado 4.º del inciso I del artículo R. 214-11 del Código Monetario y Financiero.</p>	0,00	0,00
<p>E) Otros activos.</p>	7,61	7,10

* Véase el apartado f) del estado del patrimonio

** Véase el apartado d) del estado del patrimonio

DESGLOSE DE LOS ACTIVOS DE A), B), C) Y D) DE LA CARTERA DE VALORES, POR DIVISA

Títulos	Divisa	En importe (EUR)	Porcentaje del patrimonio neto*	Porcentaje total de los activos**
NINGUNA				

* Véase el apartado f) del estado del patrimonio

** Véase el apartado d) del estado del patrimonio

DESGLOSE DE LOS ACTIVOS DE A), B), C) Y D) DE LA CARTERA DE VALORES, POR PAÍS DE RESIDENCIA DEL EMISOR

País	Porcentaje del patrimonio neto*	Porcentaje total de los activos**
NINGUNA		

* Véase el apartado f) del estado del patrimonio

** Véase el apartado d) del estado del patrimonio

DESGLOSE DE LOS OTROS ACTIVOS DE E) DE LA CARTERA DE VALORES, POR TIPO

Tipo de activos	Porcentaje del patrimonio neto*	Porcentaje total de los activos**
Instituciones de inversión colectiva		
OICVM y FIA con vocación general destinados a no profesionales y equivalentes de otros países	7,61	7,10
Otros fondos destinados a no profesionales y equivalentes de otros Estados miembros de la UE	0,00	0,00
Fondos profesionales con vocación general y equivalentes de otros Estados miembros de la UE y organismos de titulización cotizados	0,00	0,00
Otros fondos de inversión profesionales y equivalentes de otros Estados miembros de la UE y organismos de titulización no cotizados	0,00	0,00
Otros organismos no europeos	0,00	0,00
Otros activos		
Otros	0,00	0,00
TOTAL	7,61	7,10

* Véase el apartado f) del estado del patrimonio

** Véase el apartado d) del estado del patrimonio

MOVIMIENTOS EN LA CARTERA DE VALORES DURANTE EL PERIODO EN EUR

Elementos de la cartera de valores	Movimientos (en importe)	
	Adquisiciones	Cesiones
A) Títulos financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en un mercado regulado en el sentido del artículo L. 422-1 del Código Monetario y Financiero.	0,00	0,00
Y B) Títulos financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en otro mercado regulado, con funcionamiento regular, reconocido, abierto al público y cuyo domicilio se encuentre en un Estado miembro de la Unión Europea o en otro Estado que haya suscrito el acuerdo sobre el Espacio Económico Europeo.		
C) Títulos financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores de un país tercero o negociados en otro mercado de un país tercero, regulado, con funcionamiento regular, reconocido y abierto al público, siempre y cuando dicha bolsa o mercado no figuren en una lista elaborada por la Autoridad de los Mercados Financieros o su elección haya sido prevista por la ley, por el reglamento o por los estatutos del organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios.	0,00	0,00
D) Títulos financieros de admisibles de emisión reciente mencionados en el apartado 4.º del inciso I del artículo R. 214-11 del Código Monetario y Financiero.	0,00	0,00
E) Otros activos.	7 422 384,00	0,00

INFORMACIÓN DIVERSA

Entidad depositaria: CACEIS Bank - 1-3 place Valhubert - 75013 - París

El desglose periódico semestral detallado del activo está disponible en un plazo de ocho semanas siguientes al cierre del periodo.

Puede enviarse mediante solicitud a la sociedad gestora:

CANDRIAM France - 40 rue Washington - 75008 - París

Con efecto desde el 1 de julio de 2022 (la «Fecha efectiva»), Candriam Luxembourg absorbió sus filiales Candriam Belgium y Candriam France mediante una fusión luxemburguesa por absorción con arreglo al artículo 1021-1 (y siguientes) de la ley luxemburguesa de sociedades mercantiles del 10 de agosto de 1915, en su versión modificada.

A partir de la Fecha efectiva:

- La denominación de Candriam Luxembourg se ha modificado por Candriam
- La sociedad gestora ha pasado a ser Candriam

INFORMACIÓN SOBRE LOS GASTOS DE GESTIÓN

	30/06/2022
Participaciones CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación CLASSIQUE	
Gastos de gestión variables objeto de provisión	82 211,43
Porcentaje de gastos de gestión variables objeto de provisión	4,44
Gastos de gestión variables cobrados	12 883,77
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,70
Participaciones CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación I	
Gastos de gestión variables objeto de provisión	3 333 486,69
Porcentaje de gastos de gestión variables objeto de provisión	5,20
Gastos de gestión variables cobrados	261 785,40
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,41
Participaciones CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación I USD	
Gastos de gestión variables objeto de provisión	15 586,31
Porcentaje de gastos de gestión variables objeto de provisión	2,69
Gastos de gestión variables cobrados	16 845,03
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	2,91
Participaciones CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación N	
Gastos de gestión variables objeto de provisión	7 353,72
Porcentaje de gastos de gestión variables objeto de provisión	5,39
Gastos de gestión variables cobrados	0,00
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,00
Participaciones CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación R	
Gastos de gestión variables objeto de provisión	1 578 256,71
Porcentaje de gastos de gestión variables objeto de provisión	5,48
Gastos de gestión variables cobrados	112 210,51
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,39
Participaciones CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación U	
Gastos de gestión variables objeto de provisión	122 297,38
Porcentaje de gastos de gestión variables objeto de provisión	4,80
Gastos de gestión variables cobrados	22 569,37
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,89
Participaciones CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación Z	
Gastos de gestión variables objeto de provisión	1 691 402,46
Porcentaje de gastos de gestión variables objeto de provisión	5,10
Gastos de gestión variables cobrados	256 972,25
Porcentaje de gastos de gestión variables cobrados	0,77

«El importe de los gastos de gestión variables mostrado anteriormente corresponde a la suma de las provisiones y las recuperaciones de provisiones que han incidido en el patrimonio neto durante el periodo analizado».

TRANSPARENCIA DE LAS OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES Y DE REUTILIZACIÓN DE LOS INSTRUMENTOS FINANCIEROS - REGLAMENTO SFTR - EN LA MONEDA CONTABLE DE LA IIC (EUR)

a) Títulos y materias primas prestados

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
Importe					
% del patrimonio neto*					

* % excluidos el efectivo y los equivalentes de efectivo

b) Activos pignorados para cada tipo de operación de financiación de valores y TRS expresados en valor absoluto

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
Importe				253 102 113,74	
% del patrimonio neto				80,90%	

c) Diez emisores principales de garantías recibidas (excluido el efectivo) para todos los tipos de operaciones de financiación

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
GOBIERNO FRANCÉS FRANCIA				139 451 163,25	
GOBIERNO NEERLANDÉS PAÍSES BAJOS				24 366 771,05	
GOBIERNO BELGA BÉLGICA				22 836 169,82	
BANCO EUROPEO DE INVERSIONES UNIÓN EUROPEA				18 416 041,96	
GOBIERNO ALEMÁN ALEMANIA				17 836 502,83	
GOBIERNO ITALIANO ITALIA				9 858 273,84	
REINO DE ESPAÑA ESPAÑA				8 820 195,15	
UNIÓN EUROPEA UNIÓN EUROPEA				4 730 750,00	

d) 10 contrapartes principales en valor absoluto de los activos y los pasivos son compensación

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
CACEIS BANK FRANCIA				92 096 382,35	
SOCIETE GENERALE FRANCIA				83 999 999,49	
BNP PARIBAS SECURITIES FRANCIA				77 005 731,90	

e) Tipo y calidad de las garantías

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
Tipo					
- Acciones					
- Obligaciones				246 315 867,90	
- IIC					
- Títulos de deuda negociables					
- Efectivo					
Calificación					
Moneda de la garantía					
- Euro				246 315 867,90	

f) Pago y compensación de contratos

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
Tripartitos				X	
Contraparte central					
Bilaterales	X			X	

g) Vencimiento de la garantía desglosado por tramos

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
Menos de 1 día					
De 1 día a 1 semana					
De 1 semana a 1 mes					
De 1 a 3 meses					
De 3 meses a 1 año				3 955 345,14	
Más de 1 año				242 360 522,76	
Abiertas					

h) Vencimiento de las operaciones de financiación de valores y las TRS desglosado por tramos

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
Menos de 1 día					
De 1 día a 1 semana				142 598 529,95	
De 1 semana a 1 mes				110 503 583,79	
De 1 a 3 meses					
De 3 meses a 1 año					
Más de 1 año					
Abiertas					

i) Datos sobre reutilización de las garantías

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
Importe máximo (%)					
Importe utilizado (%)					
Ingresos para la IIC tras la reinversión de las garantías en efectivo en euros					

j) Datos sobre la conservación de las garantías recibidas por la IIC

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
CACEIS Bank					
Títulos				246 315 867,90	
Efectivo					

k) Datos sobre la conservación las garantías suministradas por la IIC

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
Títulos					
Efectivo					

l) Datos sobre los ingresos y los costes desglosados

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
Ingresos					
- IIC				-617 436,90	
- Gestor					
- Terceros					
Costes					
- IIC					
- Gestor					
- Terceros					

e) Datos sobre el tipo y la calidad de las garantías (colateral)

N/A - Garantía únicamente en efectivo.

i) Datos sobre reutilización de las garantías

La IIC podrá reinvertir las garantías recibidas en efectivo en operaciones con pacto de recompra inversa o en títulos elegibles reglamentariamente para el activo, en especial títulos de capital, productos de tipos, títulos de crédito o participaciones de IIC. Las garantías recibidas en forma de títulos podrán conservarse, venderse o volver a entregarse como garantía. El importe máximo de reutilización es del 100% del efectivo y los títulos recibidos.

k) Datos sobre la conservación las garantías suministradas por la IIC

N/A - Garantía únicamente en efectivo.

l) Datos sobre los ingresos y los costes desglosados

N/A - No se han realizado operaciones de adquisiciones y cesiones temporales de títulos.

CARTERA DE VALORES DETALLADA A 30/06/2022 EN EUR

Designación de los valores	Divisa	Número o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
Instituciones de inversión colectiva				
OICVM y FIA con vocación general destinados a no profesionales y equivalentes de otros países				
FRANCIA				
CANDRIAM MONETAIRE SICAV Participación «V»	EUR	184	18 199 690,24	5,82
TOTAL DE FRANCIA			18 199 690,24	5,82
LUXEMBURGO				
Candriam L Multi-Asset Premia - C Participación Z	EUR	3 543	5 596 239,36	1,79
TOTAL DE LUXEMBURGO			5 596 239,36	1,79
TOTAL OICVM y FIA con vocación general destinados a no profesionales y equivalentes de otros países			23 795 929,60	7,61
TOTAL Instituciones de inversión colectiva			23 795 929,60	7,61
Títulos recibidos en el marco de un pacto de recompra inversa				
ALEMANIA				
ALLEMAGNE 0.1% 15-04-26 IND	EUR	3 978 615	5 000 005,04	1,60
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0.0% 15-05-35	EUR	2 164 152	1 877 315,29	0,60
DEUTSCHLD 0% 4/07/39	EUR	14 850 000	12 123 837,00	3,87
TOTAL DE ALEMANIA			19 001 157,33	6,07
BÉLGICA				
BELGIQUE 0.8% 22-06-25	EUR	1 310 000	1 330 960,00	0,43
BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.4% 22-06-40	EUR	3 800 000	3 116 000,00	1,00
BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 22-06-27	EUR	9 991 638	10 000 191,14	3,19
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.45% 22-06-37	EUR	10 241 000	10 343 410,00	3,30
EUROPEAN UNION 0.0% 06-07-26	EUR	5 000 000	4 820 000,00	1,54
TOTAL DE BÉLGICA			29 610 561,14	9,46
ESPAÑA				
ESPAGNE 1.95% 30-07-30	EUR	7 794 000	7 999 761,60	2,56
ESPAGNE 5.15% 10/28	EUR	801 000	1 000 000,00	0,32
TOTAL DE ESPAÑA			8 999 761,60	2,88
FRANCIA				
E.ETAT0%250423IPMT	EUR	3 968 441	4 000 029,79	1,28
FRANCE 3.25% 25/05/2045	EUR	8 806 306	9 999 560,46	3,19
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.1% 01-03-25	EUR	20 393 000	24 000 000,05	7,67
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.1% 01-03-29	EUR	24 344 721	29 999 999,69	9,59
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.7% 25-07-30	EUR	7 310 077	10 003 295,70	3,20
FRENCH REP 2.1% 25-07-23 IND	EUR	36 488 293	47 999 412,10	15,34
OAT 2.75% 25/10/2027	EUR	10 000 000	10 900 000,00	3,49
REPUBLIQUE FRANCAISE 2.5% 25/05/2030	EUR	4 459 280	5 000 331,76	1,60
TOTAL DE FRANCIA			141 902 629,55	45,36
ITALIA				
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.45% 15-05-25	EUR	9 947 000	10 001 404,12	3,20
TOTAL DE ITALIA			10 001 404,12	3,20
LUXEMBURGO				
BEI 4.125%07-150424 MTN	EUR	17 300 000	18 918 900,00	6,04
TOTAL DE LUXEMBURGO			18 918 900,00	6,04
PAÍSES BAJOS				
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.0% 15-07-30	EUR	5 000 000	4 500 000,00	1,44

CARTERA DE VALORES DETALLADA A 30/06/2022 EN EUR (continuación)

Designación de los valores	Divisa	Número o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
ROYA DES PAYS 0.25% 15-07-25	EUR	20 300 000	20 167 700,00	6,45
TOTAL DE PAÍSES BAJOS			24 667 700,00	7,89
TOTAL Títulos recibidos en el marco de un pacto de recompra inversa			253 102 113,74	80,90
Indemnizaciones sobre títulos recibidos en el marco de un pacto de recompra inversa			-331 324,92	-0,10
Instrumentos financieros a plazo				
Compromisos a plazo firme				
Compromisos a plazo firme en un mercado regulado o similar				
90DAY EURODLR 0324	USD	-372	-490 052,13	-0,15
BP GBPUSD 0922	USD	-270	497 656,51	0,16
CAC 40 FUT 0722	EUR	-57	-19 849,00	-0,01
CBOE VIX FUT 0722	USD	-16	-21 614,42	0,00
CD CADUSD 0922	USD	-433	110 928,31	0,04
CME AUD/USD 0922	USD	-279	635 933,81	0,21
CME BRL/USD 0822	USD	44	-1 377,40	0,00
CME INRUSD 50 0722	USD	-585	108 709,17	0,03
CME JPY/USD 0922	USD	-221	182 882,97	0,06
CMFR ZARUSD 0922	USD	-105	-1 291,31	0,00
DAX 30 IND FU 0922	EUR	-16	88 487,50	0,03
EC EURUSD 0922	USD	-95	207 352,10	0,06
E-MIN RUS 200 0922	USD	-49	198 646,52	0,06
EURO STOXX 50 0922	EUR	-88	32 760,00	0,01
EUR XEUR FOAT E 0922	EUR	-6	-8 820,00	0,00
FGBL BUND 10A 0922	EUR	11	-2 340,00	0,00
FTSE 100 FUT 0922	GBP	41	33 068,08	0,01
FV CBOT UST 5 0922	USD	3	582,89	0,00
HANG SENG FUT 0722	HKD	-3	18,28	0,00
ICE 3M SONIA 0324	GBP	-370	-255 071,74	-0,08
I EURIBOR 3 1223	EUR	-403	-360 425,00	-0,11
JAP GOVT 10 0922	JPY	-17	11 687,70	0,00
KOREA 3YR 0922	KRW	-405	-159 148,40	-0,05
NE NZDUSD 0922	USD	-357	557 678,51	0,18
NK2 TOKYO NIK 0922	JPY	-77	-108 516,07	-0,04
NQ USA NASDAQ 0922	USD	-19	103 970,54	0,03
OSE TOPIX FUT 0922	JPY	-28	-98 148,52	-0,03
PE MXNUSD 0922	USD	713	-350 356,31	-0,11
RY EURJPY 0922	JPY	202	-271 228,58	-0,09
SP 500 MINI 0922	USD	13	3 419,58	0,00
SPI 200 FUT 0922	AUD	-73	72 318,87	0,02
US 10YR NOTE 0922	USD	12	3 228,27	0,00
US TBOND 30 0922	USD	11	15 573,44	0,00
XEUR FBTP BTP 0922	EUR	62	74 280,00	0,02
YM DOW JONES 0922	USD	-21	29 484,91	0,01
TOTAL Compromisos a plazo firme en un mercado regulado o similar			820 429,08	0,26
TOTAL Compromisos a plazo firme			820 429,08	0,26
TOTAL Instrumentos financieros a plazo			820 429,08	0,26

CARTERA DE VALORES DETALLADA A 30/06/2022 EN EUR (continuación)

Designación de los valores	Divisa	Número o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
Solicitudes de margen				
SOLICITUD DE MARGEN CACEIS	HKD	-150	-18,28	0,00
SOLICITUD DE MARGEN CACEIS	AUD	-109 950	-72 318,87	-0,02
SOLICITUD DE MARGEN CACEIS	KRW	216 030 000	159 148,40	0,05
SOLICITUD DE MARGEN CACEIS	USD	-1 860 587,1	-1 779 699,75	-0,57
SOLICITUD DE MARGEN CACEIS	JPY	66 215 000	466 205,47	0,15
SOLICITUD DE MARGEN CACEIS	EUR	195 906,5	195 906,50	0,06
SOLICITUD DE MARGEN CACEIS	GBP	191 110,03	222 014,44	0,07
TOTAL Solicitudes de margen			-808 762,09	-0,26
Créditos			25 320 884,58	8,09
Deudas			-17 183 743,10	-5,49
Cuentas financieras			28 125 055,87	8,99
Patrimonio neto			312 840 582,76	100,00

Participaciones CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación CLASSIQUE	EUR	587,97496	12 999,22
Participaciones CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación I	EUR	11 666,77496	13 686,44
Participaciones CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación I USD	USD	357,00000	1 970,46
Participaciones CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación N	EUR	2 474,08123	169,95
Participaciones CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación R	EUR	351 544,36768	171,82
Participaciones CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación U	EUR	38 802,68289	197,18
Participaciones CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Participación Z	EUR	53 710,65500	1 421,92