

CANDRIAM GLOBAL ALPHA

DOCUMENTO DE INFORMACIÓN PERIÓDICA SOBRE EL SEMESTRE

a 30 de junio de 2020

ESTADO DEL PATRIMONIO

	30/06/2020
	en importe
TÍTULOS FINANCIEROS	
Acciones y valores similares (1)	0,00
Títulos de deuda (2)	13.366.721,06
ACTIVOS BANCARIOS	
Activo líquido	7.873.418,19
OTROS ACTIVOS	
Participaciones o acciones de IIC	7.779.513,64
Instrumentos financieros a plazo	2.020.387,13
Créditos	25.558.936,79
Otros	44.450.644,92
TOTAL DE ACTIVOS POSEÍDOS	101.049.621,73
PASIVO	
Instrumentos financieros a plazo	-11.243.728,46
Deudas	-4.191.616,59
Cuentas financieras	-2.458,64
Otros	0,00
VALOR LIQUIDATIVO	85.611.818,04

(1) Salvo los bonos de suscripción.

(2) Salvo los instrumentos financieros del mercado monetario, los efectos mercantiles, los bonos de suscripción, los pagarés y los títulos hipotecarios.

VALOR DEL FONDO

Participación Classique

Fecha	Tipo de participaciones	Patrimonio neto en EUR	Número de participaciones	Valor de la participación en EUR
30/06/2020	Capitalización	545.181,51	523,85	1.040,72

Participación I en USD

Fecha	Tipo de participaciones	Patrimonio neto en EUR	Número de participaciones	Valor de la participación en USD
30/06/2020	Capitalización	1.788.798,74	1.334,931	1.505,01

Participación I

Fecha	Tipo de participaciones	Patrimonio neto en EUR	Número de participaciones	Valor de la participación en EUR
30/06/2020	Capitalización	24.402.647,3	21.349,446	1.143,01

Participación N

Fecha	Tipo de participaciones	Patrimonio neto en EUR	Número de participaciones	Valor de la participación en EUR
30/06/2020	Capitalización	149.953,02	131,857	1.137,23

Participación Z

Fecha	Tipo de participaciones	Patrimonio neto en EUR	Número de participaciones	Valor de la participación en EUR
30/06/2020	Capitalización	58.725.237,47	39.717,816	1.478,56

CARTERA DE VALORES

a) Distribución de los instrumentos financieros por países

	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
<p>Títulos financieros elegibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en un 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> <p>Acciones y valores similares (1)</p> <p>Títulos de deuda (2)</p> <p>- ITALIA</p> <p>- FRANCIA</p>	<p>15,61%</p> <p>7,82%</p>	<p>13,23%</p> <p>6,62%</p>
<p>Títulos financieros elegibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores de un país tercero, regulada, con funcionamiento regular y abierta al público, siempre y cuando tal bolsa o mercado no figuren en una lista establecida 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> <p>Acciones y valores similares (1)</p> <p>Títulos de deuda (2)</p>		
<p>Títulos financieros de emisión reciente mencionados en el 4.º apartado del inciso I del artículo R. 214-11 del Código Monetario y Financiero</p> <p>Acciones y valores similares</p> <p>Títulos de deuda</p>	<p>ND</p> <p>ND</p>	<p>ND</p> <p>ND</p>
<p>Otros activos</p> <p>- OICVM francés o europeo con finalidad general</p>	<p>9,09%</p>	<p>7,70%</p>

(1) Salvo los bonos de suscripción.

(2) Salvo los efectos mercantiles, los bonos de suscripción, los pagarés y los títulos hipotecarios.

b) Distribución de los instrumentos financieros por divisas

	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
<p>Títulos financieros elegibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en un 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> <p>Acciones y valores similares (1)</p> <p>Títulos de deuda (2)</p> <p>- Euro</p>	23,43%	19,85%
<p>Títulos financieros elegibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores de un país tercero, regulada, con funcionamiento regular y abierta al público, siempre y cuando tal bolsa o mercado no figuren en una lista establecida 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> <p>Acciones y valores similares (1)</p> <p>Títulos de deuda (2)</p>		
<p>Títulos financieros de emisión reciente mencionados en el 4.º apartado del inciso I del artículo R. 214-11 del Código Monetario y Financiero</p> <p>Acciones y valores similares</p> <p>Títulos de deuda</p>	ND	ND
<p>Otros activos</p> <p>- OICVM francés o europeo con finalidad general</p>	9,09%	7,70%

(1) Salvo los bonos de suscripción.

(2) Salvo los efectos mercantiles, los bonos de suscripción, los pagarés y los títulos hipotecarios.

c) Distribución por vencimiento de los instrumentos financieros

	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
<p>Títulos financieros elegibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en un 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> <p>Títulos de deuda (1)</p> <ul style="list-style-type: none"> - de 0 a 3 meses - de 3 meses a 1 año - de 1 a 3 años - de 3 a 5 años - más de 5 años 	<p>-</p> <p>7,82%</p> <p>15,61%</p> <p>-</p> <p>-</p>	<p>-</p> <p>6,62%</p> <p>13,23%</p> <p>-</p> <p>-</p>
<p>Títulos financieros elegibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores de un país tercero, regulada, con funcionamiento regular y abierta al público, siempre y cuando tal bolsa o mercado no figuren en una lista establecida 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> <p>Títulos de deuda (1)</p> <ul style="list-style-type: none"> - de 0 a 3 meses - de 3 meses a 1 año - de 1 a 3 años - de 3 a 5 años - más de 5 años 	<p>-</p> <p>-</p> <p>-</p> <p>-</p> <p>-</p>	<p>-</p> <p>-</p> <p>-</p> <p>-</p> <p>-</p>
<p>Títulos financieros de emisión reciente mencionados en el 4.º apartado del inciso I del artículo R. 214-11 del Código Monetario y Financiero</p> <p>Acciones y valores similares</p> <p>Títulos de deuda</p>	<p>ND</p> <p>ND</p>	<p>ND</p> <p>ND</p>
<p>Otros activos</p> <ul style="list-style-type: none"> - OICVM francés o europeo con finalidad general 	<p>9,09%</p>	<p>7,70%</p>

(1) Salvo los efectos mercantiles, los bonos de suscripción, los pagarés y los títulos hipotecarios.

d) Distribución por naturaleza de tipos de los instrumentos financieros

	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
<p>Títulos financieros elegibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en un 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> <p>Títulos de deuda (1)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Tipo fijo - Tipo variable - Tipo revisable - Otros 	<p>18,77%</p> <p>-</p> <p>-</p> <p>-</p>	<p>15,90%</p> <p>-</p> <p>-</p> <p>-</p>
<p>Títulos financieros elegibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores de un país tercero, regulada, con funcionamiento regular y abierta al público, siempre y cuando tal bolsa o mercado no figuren en una lista establecida 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> <p>Títulos de deuda (1)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Tipo fijo - Tipo variable - Tipo revisable - Otros 	<p>-</p> <p>-</p> <p>-</p> <p>-</p>	<p>-</p> <p>-</p> <p>-</p> <p>-</p>
<p>Títulos financieros de emisión reciente mencionados en el 4.º apartado del inciso I del artículo R. 214-11 del Código Monetario y Financiero</p> <p>Acciones y valores similares</p> <p>Títulos de deuda</p>	<p>ND</p> <p>ND</p>	<p>ND</p> <p>ND</p>
<p>Otros activos</p> <ul style="list-style-type: none"> - OICVM francés o europeo con finalidad general 	<p>9,09%</p>	<p>7,70%</p>

(1) Salvo los efectos mercantiles, los bonos de suscripción, los pagarés y los títulos hipotecarios.

MOVIMIENTOS REGISTRADOS EN LA COMPOSICIÓN DE LA CARTERA DE VALORES

Movimientos registrados durante el semestre	En importe (en millones de EUR) *
. Adquisiciones	236,58
. Cesiones	238,72

* Importes que tienen en cuenta exclusivamente los instrumentos financieros y los OICVM

APLICACIÓN DE LOS IMPORTES DISTRIBUIBLES

Participación Classique: Capitalización

Participación «I en USD»: Capitalización

Participación I: Capitalización

Participación «N»: Capitalización

Participación Z: Capitalización

PA7325 CANDRIAM GLOBAL ALPHA
30/06/2020

Información suplementaria no
auditada

REGLAMENTO (UE) 2015/2365 DEL PARLAMENTO EUROPEO Y DEL CONSEJO de 25 de noviembre de 2015
Transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización y por el
que se modifica el Reglamento (UE) n.º 648/2012

Pacto de recompra inversa

Información general (en EUR)

Nombre del subfondo	Valor nominal de títulos recibidos en el marco de un pacto de recompra inversa	Valoración global	Total de activos netos	(%) de activos
CANDRIAM GLOBAL ALPHA	35.329.230	37.757.489	85.611.818	44,10
Total	35.329.230	37.757.489		

Nombre de las contrapartes	Valor nominal de títulos recibidos en el marco de un pacto de recompra inversa	Valoración global	Cartera de valores a su valor de valoración	(%) de activos disponibles para el préstamo
BNP PB SS				
GERMANY 0% 11/09/20	9.970.000	9.982.201		
BELGIUM 1.25% 22/04/2033	10.556.230	12.275.585		
CDN PA				
FRANCE OAT 2.25% 25/05/2024	3.599.000	3.999.272		
FRANCE OAT 2.5% 25/10/2020	11.204.000	11.500.431		
Total	35.329.230	37.757.489	27.839.391	32,52

Datos sobre la concentración (en EUR)

10 mayores emisores	Importe de la garantía
Francia	14.803.000
Bélgica	10.556.230
Alemania	9.970.000
Total	35.329.230

10 principales contrapartes	Valoración global
BNP PARIBAS SA	22.257.786
CREDIT DU NORDS SA	15.499.703
Total	37.757.489

Datos de operación agregados para cada tipo de operación de financiación de valores para desglosar separadamente en función de las categorías siguientes (en EUR):

Tipo de garantías	Importe de las garantías
OBLIGACIONES	35.329.230
Total	35.329.230
Calidad de las garantías	Importe de las garantías
AAA	9.970.000
AA	25.359.230
Total	

	35.329.230
--	-------------------

Vencimiento de las garantías	Importe de las garantías
Menos de un día	0
De una jornada a una semana	7.983.000
De una semana a un mes	6.820.000
De uno a tres meses	20.526.230
De tres meses a un año	0
Superior a un año	0
Vencimientos abiertos	0
Total	35.329.230

Divisas de las garantías dinerarias	Importe de las garantías
EUR	35.329.230
Total	35.329.230

Vencimiento de las operaciones de financiación de valores	Valoración global
Menos de un día	
De una jornada a una semana	8.498.919
De una semana a un mes	7.000.784
De uno a tres meses	22.257.786
De tres meses a un año	
Superior a un año	
Vencimientos abiertos	
Total	37.757.489

País en el que están radicadas las contrapartes	Valoración global
FRANCIA	37.757.489
Total	37.757.489

Pago y compensación	Valoración global
Bilateral	37.757.489
Total	37.757.489

Datos sobre la reutilización de las garantías (en EUR)

Reutilización de las garantías	
Parte de las garantías recibidas y reutilizadas	Ninguna
Rendimientos de la reinversión de las garantías en efectivo a favor de la institución de inversión colectiva	Ninguna

Conservación de las garantías recibidas por la institución de inversión colectiva en el marco de las operaciones de financiación de valores (en EUR)

Nombre de los depositarios	Importe de los activos en garantía
RBC IS BK France	35.329.230

Conservación de los activos líquidos recibidos por la institución de inversión colectiva en el marco de las operaciones de financiación de valores y permutas de rentabilidad total (en EUR)

Tipo de cuentas
Cuentas separadas

Datos sobre los ingresos y los costes de cada tipo de operación de financiación de valores (en EUR):

Nombre del subfondo	Riesgo global
CANDRIAM GLOBAL ALPHA	-127.040,51
Total	-127.040,51