



Rapport semestriel non révisé
Candriam Money Market

30 juin 2022

*01.01.2022 – 30.06.2022
SICAV de droit luxembourgeois
R.C.S. Luxembourg B-26803*



Candriam Money Market

SICAV de droit luxembourgeois

Rapport semestriel non révisé pour la période
du 1^{er} janvier 2022 au 30 juin 2022



Table des matières

Administration de la SICAV	4
Détails sur la SICAV	5
État des actifs nets au 30 juin 2022	6
État des variations des actifs nets pour la période clôturée au 30 juin 2022	8
Statistiques	10
Portefeuille-titres au 30 juin 2022	11
Candriam Money Market Euro	11
Candriam Money Market Euro AAA	16
Candriam Money Market USD Sustainable	19
Notes aux états financiers - Tableau des instruments dérivés	22
Autres notes aux états financiers	23
Informations supplémentaires	28



Administration de la SICAV

Conseil d'Administration

Président

Jean-Yves MALDAGUE
Managing Director, Candriam Luxembourg

Administrateurs

Annemarie ARENS
Independent Director

Thierry BLONDEAU
Independent Director

Tanguy DE VILLENFAGNE
Member of the Group Strategic Committee, Candriam Belgium

Damien ROL
Deputy Global Head of Legal, Candriam France

Myriam VANNESTE
Global Head of Product Management, Candriam Belgium

Siège social

5, allée Scheffer
L-2520 Luxembourg

Dépositaire

CACEIS Bank, Luxembourg Branch
5, allée Scheffer
L-2520 Luxembourg

Société de Gestion

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

Les fonctions d'**Agent Administratif**, d'**Agent Domiciliaire** et d'**Agent de Transfert** (en ce compris les activités de **Teneur de Registre**) sont déléguées à :

CACEIS Bank, Luxembourg Branch
5, allée Scheffer
L-2520 Luxembourg

La mise en œuvre des activités de **Gestion de Portefeuille** est déléguée à :

Candriam Belgium
58, Avenue des Arts
B-1000 Bruxelles

Réviseur d'entreprises agréé

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

Réviseur d'entreprises agréé de la Société de Gestion

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



Détails sur la SICAV

Candriam Money Market est une société d'investissement à capital variable (SICAV) constituée conformément à la législation du Grand-Duché de Luxembourg relative aux Organismes de placement collectif et agréée en tant que Fonds monétaire conformément au Règlement MMF.

La SICAV est soumise aux dispositions de la partie I de la loi modifiée du 17 décembre 2010 relatives aux Organismes de placement collectif (« OPC »), telle que modifiée, et de la loi du 10 août 1915 sur les sociétés commerciales, telle que modifiée.

Le capital de la SICAV est à tout moment égal au total de ses actifs nets.

La SICAV est inscrite au Registre de Commerce et des Sociétés de Luxembourg sous le numéro B-26803.

La SICAV met à la disposition des investisseurs plusieurs portefeuilles constituant des ensembles d'actifs distincts représentés par des classes d'actions distinctes (ci-après des « compartiments »).

La SICAV constitue de ce fait une société d'investissement à compartiments multiples.

Les rapports annuels aux actionnaires pour chacun des compartiments, ainsi que les résultats consolidés, sont disponibles sur demande et sans frais auprès du siège social de la SICAV et peuvent être expédiés aux détenteurs d'actions nominatives, à l'adresse indiquée dans le registre des actionnaires, sans frais et sur simple demande.

En outre, les rapports semestriels non révisés sont également disponibles sur demande et sans frais auprès du siège social de la SICAV et peuvent être expédiés aux détenteurs d'actions nominatives, sans frais et sur simple demande.

L'exercice de la SICAV se termine le 31 décembre de chaque année.

Les actions ne sont disponibles que sous forme nominative.

L'Assemblée Générale Annuelle des Actionnaires de la SICAV se tient chaque année au siège social de la SICAV, ou à tout autre endroit au Luxembourg spécifié sur la convocation.

Elle a lieu dans les six mois suivant la fin de l'exercice.

Les avis relatifs à toutes les assemblées générales sont envoyés à tous les détenteurs d'actions nominatives, à l'adresse figurant au registre des actionnaires, au moins huit jours avant la tenue de l'assemblée en question. Ces avis précisent l'heure et le lieu de l'assemblée générale, ainsi que les conditions d'admission, l'ordre du jour et les exigences de la loi luxembourgeoise en matière de quorum et de majorité nécessaires.

De plus, les avis seront publiés dans le Mémorial, Recueil des Sociétés et Associations du Grand-Duché de Luxembourg et dans un journal luxembourgeois, le « Luxemburger Wort », si la législation l'exige, ainsi que dans la presse des pays où la SICAV est commercialisée si la législation de ces pays l'exige.

La valeur nette d'inventaire par action de chaque compartiment, le prix d'émission et de rachat des actions de chaque compartiment ainsi que les changements intervenus dans le portefeuille peuvent être obtenus auprès du siège social de la SICAV.

Le prospectus, les informations clés pour l'investisseur, les statuts et les rapports financiers de la SICAV sont tenus gratuitement à la disposition du public au siège social de la SICAV.



État des actifs nets au 30 juin 2022

		Candriam Money Market Euro	Candriam Money Market Euro AAA	Candriam Money Market USD Sustainable
		EUR	EUR	USD
Actifs				
Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation	2a	1,430,104,296	281,993,341	104,808,885
Liquidités en banque et courtier		115,719,911	38,732,623	9,235,270
A recevoir sur souscriptions		4,223,970	0	6,013,116
Intérêts et dividendes à recevoir, nets		2,891,847	544,401	198,602
Plus-value nette non réalisée sur contrats de change à terme	2d	0	0	400,779
Total des actifs		1,552,940,024	321,270,365	120,656,652
Passifs				
À payer pour investissements achetés		85,800,589	15,006,502	0
Montant dû sur les rachats		2,440,388	0	8,096,659
Commissions de gestion à payer	4	187,170	6,561	18,395
Charges opérationnelles et administratives à payer	5	76,355	15,825	6,539
Taxe d'abonnement à payer	6	123,055	0	7,265
Total des passifs		88,627,557	15,028,888	8,128,858
Total des actifs nets		1,464,312,467	306,241,477	112,527,794



État des actifs nets au 30 juin 2022

		Combinés
		EUR
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation	2a	1,812,350,050
Liquidités en banque et courtier		163,286,309
A recevoir sur souscriptions		9,975,671
Intérêts et dividendes à recevoir, nets		3,626,216
Plus-value nette non réalisée sur contrats de change à terme	2d	383,355
Total des actifs		1,989,621,601
Passifs		
À payer pour investissements achetés		100,807,091
Montant dû sur les rachats		10,185,052
Commissions de gestion à payer	4	211,326
Charges opérationnelles et administratives à payer	5	98,435
Taxe d'abonnement à payer	6	130,004
Total des passifs		111,431,908
Total des actifs nets		1,878,189,693



État des variations des actifs nets pour la période clôturée au 30 juin 2022

		Candriam Money Market Euro	Candriam Money Market Euro AAA	Candriam Money Market USD Sustainable
		EUR	EUR	USD
Actifs nets au début de l'exercice		1,333,059,823	326,824,499	121,258,156
Revenus				
Dividendes, nets		15,707	11,955	0
Intérêts sur obligations et instruments du marché monétaire, nets	2f	2,602,130	615,309	421,702
Intérêts bancaires		221	7	14,958
Autres revenus		1,116	305	53
Total des revenus		2,619,174	627,576	436,713
Frais				
Commissions de gestion	4	1,080,244	37,511	109,984
Charges opérationnelles et administratives	5	407,515	84,572	36,869
Commissions de dépositaire	5	31,738	7,073	2,609
Taxe d'abonnement	6	175,511	0	9,218
Intérêts bancaires		344,241	189,661	5,603
Total des frais		2,039,249	318,817	164,283
Revenus / (Pertes) net(te)s des investissements		579,925	308,759	272,430
Bénéfice / (Perte) net(te) réalisé(e) sur ventes d'investissements	2b	(6,445,252)	(1,152,137)	(425,345)
Bénéfice / (Perte) net(te) réalisé(e) sur contrats de change à terme	2d	115,034	85,345	3,190,100
Bénéfice / (Perte) de change, net(te)		(138,386)	(104,677)	(2,576,006)
Bénéfice / (Perte) net(te) réalisé(e)		(5,888,679)	(862,710)	461,179
Variation de la plus-value / moins-value nette non réalisée sur investissements	2a	708,560	(117,592)	(628,258)
Variation de la plus-value / moins-value nette non réalisée sur contrats de change à terme	2d	0	0	242,532
Augmentation / (diminution) nette des actifs nets provenant des opérations		(5,180,119)	(980,302)	75,453
Évolution du capital				
Souscriptions d'actions		1,186,640,044	724,234,196	179,602,978
Rachats d'actions		(1,050,207,281)	(743,836,916)	(188,408,793)
Différence de change		0	0	0
Actifs nets à la fin de l'exercice		1,464,312,467	306,241,477	112,527,794



État des variations des actifs nets pour la période clôturée au 30 juin 2022

		Combinés
		EUR
Actifs nets au début de l'exercice		1,766,513,022
Revenus		
Dividendes, nets		27,662
Intérêts sur obligations et instruments du marché monétaire, nets	2f	3,620,808
Intérêts bancaires		14,536
Autres revenus		1,472
Total des revenus		3,664,478
Frais		
Commissions de gestion	4	1,222,958
Charges opérationnelles et administratives	5	527,353
Commissions de dépositaire	5	41,307
Taxe d'abonnement	6	184,328
Intérêts bancaires		539,261
Total des frais		2,515,207
Revenus / (Pertes) net(te)s des investissements		1,149,271
Bénéfice / (Perte) net(te) réalisé(e) sur ventes d'investissements	2b	(8,004,243)
Bénéfice / (Perte) net(te) réalisé(e) sur contrats de change à terme	2d	3,251,792
Bénéfice / (Perte) de change, net(te)		(2,707,079)
Bénéfice / (Perte) net(te) réalisé(e)		(6,310,259)
Variation de la plus-value / moins-value nette non réalisée sur investissements	2a	(9,977)
Variation de la plus-value / moins-value nette non réalisée sur contrats de change à terme	2d	231,988
Augmentation / (diminution) nette des actifs nets provenant des opérations		(6,088,248)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		2,082,669,140
Rachats d'actions		(1,974,262,087)
Différence de change		9,357,866
Actifs nets à la fin de l'exercice		1,878,189,693



Statistiques

Candriam Money Market Euro

Nom	ISIN	Type d'action	Devise	Nombre d'actions en circulation	Valeur nette d'inventaire par action au 30.06.2022	Valeur nette d'inventaire par action au 31.12.2021	Valeur nette d'inventaire par action au 31.12.2020
Total des actifs nets			EUR		1,464,312,467	1,333,059,823	1,401,398,342
C	LU0093583077	Capitalisation	EUR	710,795.80	507.93	510.67	515.88
C	LU0093583234	Distribution	EUR	67,783.72	353.07	355.12	359.02
I	LU0206982331	Capitalisation	EUR	812,469.00	542.49	544.23	547.38
R	LU0936337848	Capitalisation	EUR	1,345.51	97.87	98.20	98.78
R2	LU1389877876	Distribution	EUR	2,700.00	146.77	147.28	148.22
V	LU0323048693	Capitalisation	EUR	347,170.99	1,004.36	1,007.36	1,012.69
Z	LU0391999124	Capitalisation	EUR	286,732.09	1,009.24	1,012.04	1,016.97

Candriam Money Market Euro AAA

Nom	ISIN	Type d'action	Devise	Nombre d'actions en circulation	Valeur nette d'inventaire par action au 30.06.2022	Valeur nette d'inventaire par action au 31.12.2021	Valeur nette d'inventaire par action au 31.12.2020
Total des actifs nets			EUR		306,241,477	326,824,499	252,223,573
C	LU0354091653	Capitalisation	EUR	572,945.44	101.88	102.22	102.92
C*	LU0354091737	Distribution	EUR	-	-	99.97	-
I	LU0354091901	Capitalisation	EUR	22,944.13	1,042.33	1,045.55	1,052.32
I	LU0354127358	Distribution	EUR	267.88	1,022.40	1,025.56	1,032.20
R	LU0936338655	Capitalisation	EUR	479.36	149.29	149.77	-
V	LU0354092115	Capitalisation	EUR	120,726.44	1,044.91	1,048.09	1,054.77
V	LU0354092206	Distribution	EUR	1.00	1,030.09	1,032.72	1,038.39
Z	LU0391999470	Capitalisation	EUR	92,772.50	1,050.53	1,053.57	1,059.97

Candriam Money Market USD Sustainable

Nom	ISIN	Type d'action	Devise	Nombre d'actions en circulation	Valeur nette d'inventaire par action au 30.06.2022	Valeur nette d'inventaire par action au 31.12.2021	Valeur nette d'inventaire par action au 31.12.2020
Total des actifs nets			USD		112,527,794	121,258,156	175,112,698
C	LU0049341216	Capitalisation	USD	85,662.08	549.34	549.25	550.27
C	LU0094032728	Distribution	USD	19,464.58	365.91	365.99	367.01
I	LU0206982414	Capitalisation	USD	61,382.68	572.33	571.71	571.77
I	LU0355214700	Distribution	USD	684.00	543.25	542.66	542.52
V	LU0323048347	Capitalisation	USD	1.00	1,107.36	1,105.34	1,104.57
Z	LU0391999553	Capitalisation	USD	20,513.83	1,113.61	1,111.68	1,110.18

* Cette classe d'actions est inactive depuis le 03.03.2022.



Candriam Money Market Euro

Portefeuille-titres au 30 juin 2022

Dénomination	Quantité	Devise	Valeur d'évaluation (en EUR)	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs ou traitées sur un autre marché réglementé				
Obligations				
Belgique				
BELFIUS BANQUE SA 0.75 17-22 12/09A	13,700,000	EUR	13,714,590	0.94
COFINIMMO SA ZCP 250722	12,000,000	EUR	12,007,239	0.82
FLUVIUS SYSTEM OPER ZCP 010722	11,000,000	EUR	11,001,390	0.75
FLUXYS FINANCE SA ZCP 180722	1,500,000	EUR	1,502,830	0.10
REGION WALLONNE ZCP 010722	16,000,000	EUR	16,005,802	1.09
REGION WALLONNE ZCP 010822	11,000,000	EUR	11,003,149	0.75
SOWAER ZCP 060722	4,000,000	EUR	4,000,017	0.27
SPGE ZCP 040722	8,000,000	EUR	8,002,901	0.55
SPGE ZCP 040822	15,000,000	EUR	14,999,354	1.02
UCB ZCP 06-07-22	5,000,000	EUR	5,001,209	0.34
			97,238,481	6.64
France				
ASFFP 5.625 07-22 04/07A	7,300,000	EUR	7,302,847	0.50
COVIVIO SA ZCP 110722	14,000,000	EUR	14,004,424	0.96
COVIVIO SA ZCP 200722	9,000,000	EUR	9,006,134	0.62
DANONE SA ZCP 010822	14,000,000	EUR	14,004,392	0.96
DASSAULT SYSTEM 0.00 19-22 16/09A	25,500,000	EUR	25,482,405	1.74
ENGIE 3.50 10-22 18/10A	3,137,000	EUR	3,166,660	0.22
ENGIE SA ZCP 040722	20,000,000	EUR	20,006,536	1.37
ENGIE SA ZCP 250722	10,000,000	EUR	10,010,041	0.68
METROPOLE DE LYON ZCP 040722	10,000,000	EUR	10,003,424	0.68
METROPOLE DE LYON ZCP 250722	10,000,000	EUR	10,003,867	0.68
MICHELIN (CGDE) ZCP 070722	13,000,000	EUR	13,000,456	0.89
NORD PAS DE CALAIS ZCP 070722	22,000,000	EUR	22,001,047	1.50
PSA BQUE FCE ZCP 120722	21,000,000	EUR	21,017,053	1.44
SCHNEIDER ELEC.SE ZCP 040722	20,000,000	EUR	20,018,626	1.37
VEOLIA ENVIRONN SA ZCP 010822	16,000,000	EUR	16,004,394	1.09
VEOLIA ENVIRONN SA ZCP 150722	13,000,000	EUR	13,004,341	0.89
			228,036,647	15.57
Allemagne				
ADIDAS AG ZCP 290722	5,000,000	EUR	5,001,354	0.34
CONTINENTAL AG ZCP 270722	15,000,000	EUR	15,002,492	1.02
HEIDELBERGCEMENT AG ZCP 070922	8,000,000	EUR	8,005,255	0.55
HEIDELBERGCEMENT AG ZCP 120722	3,000,000	EUR	3,000,934	0.20
HEIDELBERGCEMENT AG ZCP 140722	9,000,000	EUR	9,004,445	0.61
HEIDELBERGCEMENT AG ZCP 180722	2,000,000	EUR	2,000,257	0.14
MERCEDES-BENZ FINE 0.00 19-22 21/08U	5,000,000	EUR	4,999,825	0.34
VOLKSWAGEN BANK 0.3750 19-22 05/07A	12,900,000	EUR	12,901,096	0.88
VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.25 19-22 01/08A	5,500,000	EUR	5,503,300	0.38
			65,418,958	4.47
Irlande				
JOHNSON CONTROLS INT ZCP 060722	14,000,000	EUR	14,003,339	0.96
JOHNSON CONTROLS INT ZCP 140922	15,000,000	EUR	15,009,080	1.02
			29,012,419	1.98
Italie				
UNIONE DI BANCHE ITAL 1.00 19-22 22/07A	4,700,000	EUR	4,702,092	0.32
			4,702,092	0.32
Luxembourg				
BHP BILLITON FINANCE 0.75 15-22 28/10A	15,594,000	EUR	15,599,302	1.07
BMW FINANCE NV 0.125 19-22 13/07A	16,587,000	EUR	16,584,429	1.13
DEUT TELEKOM INT FIN 4.25 10-22 13/07A	5,000,000	EUR	5,005,925	0.34
DH EUROPE FINANCE II ZCP 220722	16,000,000	EUR	16,001,560	1.09
DIGITAL DUTCH FINCO 0.125 20-22 15/10A	11,500,000	EUR	11,488,155	0.78
FIDELITY NATIONAL INF 0.125 19-22 03/12A	4,267,000	EUR	4,264,674	0.29
IBERDROLA INTL BV 2.50 14-22 24/10A	2,400,000	EUR	2,416,020	0.16

Les notes d'accompagnement font partie intégrante des états financiers.
Toute différence au niveau du pourcentage des actifs nets est le fruit d'arrondis.



Candriam Money Market Euro

Portefeuille-titres au 30 juin 2022

Dénomination	Quantité	Devise	Valeur d'évaluation (en EUR)	% des actifs nets
REPSOL EUROPE FINA ZCP 010722	10,000,000	EUR	10,003,223	0.68
SIMON INTL FINANCE 1.375 15-22 18/11A	7,860,000	EUR	7,872,065	0.54
SOCIETE GENERALE 4.25 12-22 13/07A	2,000,000	EUR	2,002,100	0.14
TOYOTA MOTOR CR 0.75 15-22 21/07A	12,170,000	EUR	12,173,347	0.83
WELLS FARGO 1.50 15-22 12/09A	27,900,000	EUR	27,972,540	1.91
			131,383,340	8.97
Pays-Bas				
ABB FINANCE BV ZCP 050722	8,000,000	EUR	8,000,092	0.55
ABB FINANCE BV ZCP 130722	10,000,000	EUR	10,002,770	0.68
AKZO NOBEL NV ZCP 010822	15,000,000	EUR	15,008,680	1.02
AKZO NOBEL NV ZCP 080822	5,500,000	EUR	5,503,200	0.38
AKZO NOBEL NV ZCP 250722	27,000,000	EUR	27,015,923	1.84
ENEL FINANCE INT NV ZCP 010722	20,000,000	EUR	20,004,996	1.37
ENEL FINANCE INT NV ZCP 040722	5,000,000	EUR	5,002,706	0.34
IBERDROLA INT. BV ZCP 110722	500,000	EUR	501,201	0.03
IBERDROLA INT. BV ZCP 150722	20,000,000	EUR	20,008,367	1.37
IBERDROLA INT. BV ZCP 200722	14,000,000	EUR	14,004,962	0.96
IBERDROLA INT. BV ZCP 250722	7,000,000	EUR	7,002,693	0.48
KONINKLIJKE AHOLD D. ZCP 080822	15,000,000	EUR	15,001,637	1.02
KONINKLIJKE AHOLD D. ZCP 220722	11,000,000	EUR	11,002,063	0.75
KONINKLIJKE DSM N.V. ZCP 060922	18,000,000	EUR	18,012,852	1.23
WOLTERS KLUWER NV ZCP 070722	5,000,000	EUR	5,001,228	0.34
			181,073,370	12.37
Espagne				
BCO BILBAO VIZCAYA 0.75 17-22 11/09A	2,200,000	EUR	2,203,113	0.15
FERROVIAL SA ZCP 070722	11,000,000	EUR	11,001,229	0.75
FERROVIAL SA ZCP 260722	8,000,000	EUR	8,001,807	0.55
SANTANDER CONS BK 0.75 17-22 17/10A	5,000,000	EUR	5,006,250	0.34
			26,212,399	1.79
Suède				
SCANIA CV AB 0 20-22 23/11A	12,956,000	EUR	12,932,355	0.88
SCANIA CV AB ZCP 210722	10,000,000	EUR	10,008,051	0.68
			22,940,406	1.57
Suisse				
UBS GROUP FUNDING 1.75 15-22 16/11A	12,601,000	EUR	12,663,501	0.86
			12,663,501	0.86
Royaume-Uni				
COCA-COLA EUROPACIFI ZCP 010722	12,500,000	EUR	12,501,830	0.85
COCA-COLA EUROPACIFI ZCP 150822	4,500,000	EUR	4,502,732	0.31
COCA-COLA EUROPACIFI ZCP 220722	8,000,000	EUR	8,005,509	0.55
COCA-COLA EUROPACIFI ZCP 290722	14,000,000	EUR	14,009,500	0.96
NOMURA BANK INTL ZCP 020822	8,000,000	EUR	8,001,715	0.55
RECKITT BENCKISER TS ZCP 240822	24,000,000	EUR	24,023,801	1.64
			71,045,087	4.85
États-Unis d'Amérique				
AMERICAN HONDA 0.35 19-22 26/02A	24,074,000	EUR	24,080,380	1.64
DANAHER CORP ZCP 060722	6,000,000	EUR	6,003,271	0.41
DANAHER CORP ZCP 290722	19,000,000	EUR	19,002,022	1.30
FIDELITY NATL INFORM ZCP 200722	10,000,000	EUR	10,002,133	0.68
FIDELITY NATL INFORM ZCP 250722	4,000,000	EUR	4,001,850	0.27
FISERV INC ZCP 070722	16,000,000	EUR	16,008,793	1.09
FISERV INC ZCP 210722	6,000,000	EUR	6,003,260	0.41
FISERV INC ZCP 280722	9,000,000	EUR	9,001,294	0.61
FISERV ZCP 11-08-22	12,500,000	EUR	12,506,814	0.85
GOLDMAN SACHS GROUP 1.375 15-22 26/07A	10,000,000	EUR	10,007,000	0.68
MANPOWER GROUP 1.875 15-22 11/09A	6,100,000	EUR	6,107,686	0.42
WELLS FARGO 2.625 12-22 16/08A	16,000,000	EUR	16,046,320	1.10
			138,770,823	9.48
Total des obligations			1,008,497,523	68.87

Les notes d'accompagnement font partie intégrante des états financiers.
Toute différence au niveau du pourcentage des actifs nets est le fruit d'arrondis.



Candriam Money Market Euro

Portefeuille-titres au 30 juin 2022

Dénomination	Quantité	Devise	Valeur d'évaluation (en EUR)	% des actifs nets
Obligations à taux variables				
Australie				
COMMONW BK AUSTRALIA FL.R 18-23 08/03Q	3,650,000	EUR	3,658,924	0.25
			3,658,924	0.25
Belgique				
KBC GROUPE SA FL.R 17-22 24/11Q	13,100,000	EUR	13,114,606	0.90
			13,114,606	0.90
Canada				
BANK OF NOVA SCOTIA FL.R 18-22 05/10Q	7,140,000	EUR	7,147,711	0.49
DAIMLER CANADA FINAN FL.R 20-22 11/09Q	13,000,000	EUR	13,011,050	0.89
			20,158,761	1.38
France				
SOCIETE GENERALE FL.R 18-23 06/03Q	5,100,000	EUR	5,107,828	0.35
			5,107,828	0.35
Allemagne				
VOLKSWAGEN LEASING FL.R 20-22 16/11Q	13,600,000	EUR	13,607,072	0.93
VONOVIA FINANCE BV FL.R 18-22 22/12Q	24,600,000	EUR	24,614,514	1.68
			38,221,586	2.61
Luxembourg				
AT&T INC FL.R 18-23 05/09Q	15,936,000	EUR	16,016,875	1.09
BNP PARIBAS FL.R 17-22 22/09Q	20,725,000	EUR	20,759,714	1.42
BNP PARIBAS FL.R 18-23 19/01Q	9,000,000	EUR	9,004,320	0.61
DEUTSCHE TELEKOM AG FL.R 18-22 01/12Q	2,000,000	EUR	2,000,390	0.14
GOLDMAN SACHS GROUP FL.R 15-22 26/07Q	4,225,000	EUR	4,227,049	0.29
ING GROUP NV FL.R 18-23 20/09Q	15,500,000	EUR	15,607,105	1.07
JOHN DEERE BANK FL.R 17-22 03/10Q	6,000,000	EUR	6,002,700	0.41
MITSUBISHI UFJ FIN FL.R 18-23 30/05Q	5,000,000	EUR	5,010,475	0.34
TAKEDA PHARMACEUTICAL FL.R 18-22 21/11Q	13,300,000	EUR	13,333,716	0.91
VOLKSWAGEN BANK GMBH FL.R 19-22 01/08Q	11,500,000	EUR	11,510,522	0.79
			103,472,866	7.07
Pays-Bas				
ABB FINANCE FL.R 22-24 31/03Q	1,873,000	EUR	1,888,892	0.13
DIGITAL DUTCH FINCO FL.R 20-22 23/09Q	18,224,000	EUR	18,232,474	1.25
THERMO FISHER SCIENTIF FL.R 21-23 18/11Q	4,500,000	EUR	4,484,745	0.31
			24,606,111	1.68
Norvège				
DNB BANK ASA FL.R 19-22 25/01Q	5,500,000	EUR	5,502,585	0.38
			5,502,585	0.38
Espagne				
BANCO BILBAO VIZCAYA FL.R 18-23 03/09Q	13,000,000	EUR	13,029,185	0.89
BANCO NTANDER F.LR 22-24 05/05Q	9,200,000	EUR	9,299,176	0.64
BBVA FL.R 21-23 03/12Q	10,000,000	EUR	10,098,550	0.69
			32,426,911	2.21
Royaume-Uni				
HSBC BANK PLC FL.R 20-22 14/09Q	20,000,000	EUR	20,057,100	1.37
HSBC HOLDINGS PLC FL.R 17-23 05/10Q	5,107,000	EUR	5,107,689	0.35
			25,164,789	1.72
États-Unis d'Amérique				
CITIGROUP INC FL.R 18-23 21/03Q	18,000,000	EUR	18,026,910	1.23
GOLDMAN SACHS GROUP FL.R 17-23 26/09Q	3,000,000	EUR	3,000,420	0.20
			21,027,330	1.44
Total des obligations à taux variables			292,462,297	19.97
Total des valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs ou traitées sur un autre marché réglementé			1,300,959,820	88.84
Marché des titres du Trésor				
Instruments du marché monétaire				
Belgique				
SOCIETE WALLONNE DU ZCP 141022	3,500,000	EUR	3,509,617	0.24
			3,509,617	0.24

Les notes d'accompagnement font partie intégrante des états financiers.
Toute différence au niveau du pourcentage des actifs nets est le fruit d'arrondis.



Candriam Money Market Euro

Portefeuille-titres au 30 juin 2022

Dénomination	Quantité	Devise	Valeur d'évaluation (en EUR)	% des actifs nets
Total des instruments du marché monétaire			3,509,617	0.24
Total du marché des titres du Trésor			3,509,617	0.24
Organismes de placement collectif				
Actions/Parts détenues dans des fonds d'investissement				
France				
CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV V EUR	608	EUR	60,154,205	4.11
			60,154,205	4.11
Luxembourg				
CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO V EUR C	64,600	EUR	65,480,654	4.47
			65,480,654	4.47
Total des actions/parts détenues dans des fonds d'investissement			125,634,859	8.58
Total Organismes de placement collectif			125,634,859	8.58
Total du portefeuille-titres			1,430,104,296	97.66
Coût d'acquisition			1,433,666,582	



Candriam Money Market Euro

Répartition géographique et économique du portefeuille-titres au 30 juin 2022

Répartition géographique (en % des actifs nets)

Luxembourg	20.51
France	20.03
Pays-Bas	14.05
États-Unis d'Amérique	10.91
Belgique	7.78
Allemagne	7.08
Royaume-Uni	6.57
Espagne	4.00
Irlande	1.98
Suède	1.57
Canada	1.38
Suisse	0.86
Norvège	0.38
Italie	0.32
Australie	0.25
	97.66

Répartition économique (en % des actifs nets)

Banques et autres institutions financières	42.70
Internet et services d'Internet	5.96
Fonds d'investissement	5.29
Énergie et eau	4.52
Chimie	4.48
Institutions non classifiables	3.90
Immobilier	3.79
Industrie agro-alimentaire	3.62
Obligations d'États, Provinces et communes	3.21
Électrotechnique	3.00
Biens de consommation divers	2.40
Services divers	2.05
Transport	1.80
Distribution, commerce de détail	1.78
Construction de machines et appareils	1.71
Industrie automobile	1.57
Matériaux de construction	1.50
Industrie pharmaceutique	1.25
Télécommunication	1.09
Pneus et caoutchouc	1.02
Art graphique, maison d'édition	0.34
Textile et habillement	0.34
Autre(s)	0.24
Pétrole	0.10
	97.66



Candriam Money Market Euro AAA

Portefeuille-titres au 30 juin 2022

Dénomination	Quantité	Devise	Valeur d'évaluation (en EUR)	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs ou traitées sur un autre marché réglementé				
Obligations				
Australie				
NATIONAL AUSTRALIA BK 2.75 12-22 08/08A	12,600,000	EUR	12,636,540	4.13
			12,636,540	4.13
Belgique				
LVMH FIN BELGIQUE SA ZCP 270722	9,000,000	EUR	9,005,281	2.94
LVMH FIN BELGIQUE SA ZCP 290722	5,000,000	EUR	5,002,994	1.63
SOCIETE WALLONNE DU ZCP 140722	3,000,000	EUR	3,006,690	0.98
			17,014,965	5.56
France				
AIR LIQUIDE FINANCE ZCP 010722	9,500,000	EUR	9,502,373	3.10
DASSAULT SYSTEM 0.00 19-22 16/09A	8,300,000	EUR	8,294,066	2.71
GIRONDE (DEPART) ZCP 200722	15,000,000	EUR	15,006,526	4.90
NORD PAS DE CALAIS ZCP 070722	8,000,000	EUR	8,002,989	2.61
NORD PAS DE CALAIS ZCP 260722	8,000,000	EUR	8,003,808	2.61
PARIS (VILLE DE) ZCP 220722	10,000,000	EUR	10,004,795	3.27
PARIS (VILLE DE) ZCP 270722	5,000,000	EUR	5,001,938	1.63
			63,816,495	20.84
Allemagne				
ADIDAS AG ZCP 080722	5,000,000	EUR	5,001,923	1.63
ADIDAS AG ZCP 290722	6,000,000	EUR	6,002,145	1.96
			11,004,068	3.59
Luxembourg				
BMW FINANCE NV 0.125 19-22 13/07A	8,484,000	EUR	8,482,261	2.77
COOP RABOBANK 0.50 17-22 06/12A	5,500,000	EUR	5,506,545	1.80
LLOYDS BK CORP MKTS 0.25 19-22 04/10A	6,000,000	EUR	6,002,130	1.96
PROCTER GAMB REGS 2.00 12-22 16/08A	8,580,000	EUR	8,602,351	2.81
TOYOTA MOTOR CR 0.75 15-22 21/07A	8,551,000	EUR	8,555,789	2.79
			37,149,076	12.13
Pays-Bas				
UNILEVER FINANCE NET ZCP 250722	10,000,000	EUR	10,004,727	3.27
			10,004,727	3.27
Espagne				
SANTAN CONS FIN S.A. ZCP 200722	5,000,000	EUR	5,005,833	1.63
			5,005,833	1.63
Suède				
NORDEA BANK AB 0.30 17-22 30/06A	10,000,000	EUR	10,001,550	3.27
SVENSKA HANDELSBANK ZCP 310822	8,000,000	EUR	8,006,071	2.61
			18,007,621	5.88
Suisse				
NESTLE SA ZCP 130722	3,000,000	EUR	3,001,625	0.98
			3,001,625	0.98
Total des obligations			177,640,950	58.01
Obligations à taux variables				
Pays-Bas				
DEUTSCHE BAHN FIN FL.R 14-22 09/09Q	802,000	EUR	802,196	0.26
			802,196	0.26
Norvège				
DNB BANK ASA FL.R 19-22 25/01Q	14,500,000	EUR	14,507,758	4.74
			14,507,758	4.74
Total des obligations à taux variables			15,309,954	5.00
Total des valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs ou traitées sur un autre marché réglementé			192,950,904	63.01

Les notes d'accompagnement font partie intégrante des états financiers.
Toute différence au niveau du pourcentage des actifs nets est le fruit d'arrondis.



Candriam Money Market Euro AAA

Portefeuille-titres au 30 juin 2022

Dénomination	Quantité	Devise	Valeur d'évaluation (en EUR)	% des actifs nets
Marché des titres du Trésor				
Instruments du marché monétaire				
Autriche				
AUSTRIAN T-BILL ZCP 280722	13,000,000	EUR	13,006,474	4.25
			13,006,474	4.25
Belgique				
BELGIUM TREAS BILL ZCP 140722	16,000,000	EUR	16,009,496	5.23
SOCIETE WALLONNE DU ZCP 141022	3,000,000	EUR	3,008,256	0.98
SOCIETE WALLONNE DU ZCP 200922	4,000,000	EUR	4,013,396	1.31
			23,031,148	7.52
France				
FRANCE TREASURY BILL ZCP 270722	10,000,000	EUR	10,008,282	3.27
			10,008,282	3.27
Allemagne				
GERM TREA BILL ZCP 20-07-22	16,000,000	EUR	16,012,109	5.23
			16,012,109	5.23
Espagne				
ROYAUME D SPAIN ZCP 08-07-22	13,000,000	EUR	13,004,847	4.25
			13,004,847	4.25
Total des instruments du marché monétaire			75,062,860	24.51
Total du marché des titres du Trésor			75,062,860	24.51
Organismes de placement collectif				
Actions/Parts détenues dans des fonds d'investissement				
Luxembourg				
BNP PARIBAS INSTICASH EUR 1D SHORT TERM VNAV I EUR	102,201	EUR	13,979,577	4.56
			13,979,577	4.56
Total des actions/parts détenues dans des fonds d'investissement			13,979,577	4.56
Total Organismes de placement collectif			13,979,577	4.56
Total du portefeuille-titres			281,993,341	92.08
Coût d'acquisition			282,336,481	



Candriam Money Market Euro AAA

Répartition géographique et économique du portefeuille-titres au 30 juin 2022

Répartition géographique (en % des actifs nets)

France	24.11
Luxembourg	16.70
Belgique	13.08
Allemagne	8.82
Espagne	5.88
Suède	5.88
Norvège	4.74
Autriche	4.25
Australie	4.13
Pays-Bas	3.53
Suisse	0.98
	92.08

Répartition économique (en % des actifs nets)

Banques et autres institutions financières	34.95
Obligations d'États, Provinces et communes	34.63
Divers biens d'équipement	4.57
Fonds d'investissement	4.56
Textile et habillement	3.59
Autre(s)	3.27
Biens de consommation divers	2.81
Internet et services d'Internet	2.71
Industrie agro-alimentaire	0.98
	92.08



Candriam Money Market USD Sustainable

Portefeuille-titres au 30 juin 2022

Dénomination	Quantité	Devise	Valeur d'évaluation (en USD)	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs ou traitées sur un autre marché réglementé				
Obligations				
Belgique				
ENI FINANCE INTERNA ZCP 130722	5,000,000	USD	4,994,760	4.44
REGION WALLONNE ZCP 150722	3,000,000	EUR	3,137,463	2.79
			8,132,223	7.23
Danemark				
JYSKE BANK DNK ZCP 130722	5,000,000	USD	4,998,015	4.44
			4,998,015	4.44
France				
METROPOLE DE LYON ZCP 180722	3,000,000	USD	2,996,098	2.66
			2,996,098	2.66
Allemagne				
ADIDAS AG ZCP 290722	5,000,000	EUR	5,228,665	4.65
			5,228,665	4.65
Italie				
INTESA SANPAOLO 3.125 17-22 14/07S	3,701,000	USD	3,701,981	3.29
			3,701,981	3.29
Pays-Bas				
AKZO NOBEL NV ZCP 080822	1,500,000	EUR	1,569,087	1.39
IBERDROLA INT. BV ZCP 150722	4,000,000	EUR	4,183,595	3.72
WOLTERS KLUWER NV ZCP 070722	1,000,000	EUR	1,045,707	0.93
			6,798,389	6.04
États-Unis d'Amérique				
AMERICAN EXPRESS 2.500 17-22 01/07S	571,000	USD	571,006	0.51
FISERV INC ZCP 070722	3,000,000	EUR	3,138,074	2.79
FISERV INC ZCP 140722	2,000,000	EUR	2,092,004	1.86
IBM 2.625 15-22 05/08S	1,100,000	GBP	1,336,515	1.19
			7,137,599	6.34
Total des obligations			38,992,970	34.65
Obligations à taux variables				
Australie				
NATIONAL AUSTRALIA B FL.R 20-22 13/01Q	5,000,000	USD	4,994,875	4.44
			4,994,875	4.44
Canada				
BANK OF MONTREAL FL.R 21-23 15/09S	3,157,000	USD	3,128,113	2.78
BANK OF NOVA SC FL.R 21-23 15/09Q	800,000	USD	791,242	0.70
BANK OF NOVA SCOTIA FL.R 20-23 16/09Q	4,500,000	USD	4,477,282	3.98
TORONTO DOMINION BANK FL.R 21-23 02/06Q	1,865,000	USD	1,856,212	1.65
TORONTO DOMINION BANK FL.R 21-23 06/01Q	3,274,000	USD	3,266,979	2.90
			13,519,828	12.01
France				
BPCE FL.R 18-23 12/09Q	4,200,000	USD	4,222,155	3.75
			4,222,155	3.75
Luxembourg				
ABN AMRO BANK FL.R 17-22 19/07Q	5,600,000	USD	5,600,056	4.98
			5,600,056	4.98
États-Unis d'Amérique				
AMEX SOFRIND F.LR 22-24 03/05Q	1,100,000	USD	1,093,697	0.97
BFCM FL.R 17-22 20/07Q	1,700,000	USD	1,699,890	1.51
BFCM FL.R 18-23 20/07Q	1,000,000	USD	1,004,405	0.89
CITIGROUP FL.R 17-23 24/07Q	4,629,000	USD	4,625,491	4.11
MIZUHO FINANCIAL GRP FL.R 17-22 11/09Q	5,500,000	USD	5,499,615	4.89
ROYAL BANK OF CANADA FL.R 20-23 17/01Q	5,000,000	USD	4,990,250	4.43
THERMO FISHER SCIENTIF FL.R 21-23 18/04Q	5,100,000	USD	5,074,589	4.51
TOYOTA MOTOR CREDIT FL.R 21-22 14/12M	4,500,000	USD	4,495,327	3.99
			28,483,264	25.31
Total des obligations à taux variables			56,820,178	50.49

Les notes d'accompagnement font partie intégrante des états financiers.
Toute différence au niveau du pourcentage des actifs nets est le fruit d'arrondis.



Candriam Money Market USD Sustainable

Portefeuille-titres au 30 juin 2022

Dénomination	Quantité	Devise	Valeur d'évaluation (en USD)	% des actifs nets
Total des valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs ou traitées sur un autre marché réglementé			95,813,148	85.15
Organismes de placement collectif				
Actions/Parts détenues dans des fonds d'investissement				
France				
CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV I EUR C	437	EUR	4,606,562	4.09
			4,606,562	4.09
Luxembourg				
CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO Z EUR C	4,000	EUR	4,389,175	3.90
			4,389,175	3.90
Total des actions/parts détenues dans des fonds d'investissement			8,995,737	7.99
Total Organismes de placement collectif			8,995,737	7.99
Total du portefeuille-titres			104,808,885	93.14
Coût d'acquisition			105,919,395	



Candriam Money Market USD Sustainable

Répartition géographique et économique du portefeuille-titres au 30 juin 2022

Répartition géographique (en % des actifs nets)

États-Unis d'Amérique	31.66
Canada	12.01
France	10.51
Luxembourg	8.88
Belgique	7.23
Pays-Bas	6.04
Allemagne	4.65
Australie	4.44
Danemark	4.44
Italie	3.29
	93.14

Répartition économique (en % des actifs nets)

Banques et autres institutions financières	62.76
Obligations d'États, Provinces et communes	5.45
Internet et services d'Internet	4.65
Textile et habillement	4.65
Électronique et semi-conducteurs	4.51
Fonds d'investissement	3.90
Électrotechnique	3.72
Chimie	1.39
Articles de bureaux et ordinateurs	1.19
Art graphique, maison d'édition	0.93
	93.14



Notes aux états financiers – Tableau des instruments dérivés

Contrats de change à terme

Au 30 juin 2022, les contrats de change à terme ouverts sont les suivants :

Candriam Money Market USD Sustainable

Devise achetée	Quantité achetée	Devise vendue	Quantité vendue	Date de maturité	Contrepartie	Non réalisé (en USD)
USD	3,173,297	EUR	3,001,800	07/07/2022	Nomura Financial Products Europe	34,467
USD	1,073,017	EUR	1,000,000	07/07/2022	Société Générale	27,364
USD	2,084,664	EUR	2,000,000	14/07/2022	UBS Europe SE	(7,571)
USD	3,149,703	EUR	3,000,000	15/07/2022	UBS Europe SE	11,125
USD	4,314,824	EUR	4,000,000	15/07/2022	BNP Paribas Paris	129,972
USD	1,610,806	EUR	1,500,000	08/08/2022	Société Générale	38,848
USD	8,992,456	EUR	8,610,000	13/07/2022	UBS Europe SE	(14,026)
USD	5,309,156	EUR	5,000,000	29/07/2022	Société Générale	73,180
USD	1,474,566	GBP	1,125,000	05/08/2022	UBS Europe SE	107,419
						400,778

Veuillez vous référer à la Note 8 concernant les garanties reçues/constituées pour les contrats de change à terme.



Autres notes aux états financiers

Note 1 - Généralité

Candriam Money Market (la « SICAV ») a été constituée pour une durée illimitée le 16 novembre 1987, sous la dénomination de « BIL GLOBAL FUND », en tant que société d'investissement à capital variable (SICAV) conformément à la législation du Grand-Duché de Luxembourg. Son capital minimum est de 1.250.000. EUR Ses statuts ont été publiés au « Mémorial, Recueil des Sociétés et Associations » (le « Mémorial ») le 11 décembre 1987. La SICAV est inscrite au Registre de Commerce et des Sociétés de Luxembourg sous le numéro B-26803.

Le 30 mai 1990, la dénomination de la SICAV a été changée en « BIL Money Market Fund », ses statuts ont été modifiés et le capital libellé en BEF. Le 1^{er} février 1999, la dénomination de la SICAV a été changée en « Dexia Money Market ». Le 16 mai 2014, la dénomination de la SICAV a été changée en « Candriam Money Market ».

Le 27 janvier 1999, les statuts ont été modifiés et le capital libellé en EUR. Les modifications ont été publiées au « Mémorial ». Une version coordonnée des statuts est déposée au Registre de Commerce et des Sociétés de Luxembourg. Ils ont été modifiés le 6 juillet 2020 pour la dernière fois. Les modifications correspondantes ont été publiées au « Recueil Électronique des Sociétés et Associations ».

La SICAV est inscrite au Registre de Commerce et des Sociétés de Luxembourg sous le numéro B-26803.

La SICAV et l'ensemble de ses compartiments se qualifient de Fonds Monétaires et ont été agréés par la CSSF conformément aux dispositions du Règlement MMF. À ce titre, ils sont inscrits sur la liste officielle des OPC en tant que Fonds Monétaires, conformément à la Loi de 2010.

Conformément au Règlement, les informations suivantes sont déjà mises à la disposition des investisseurs au moins une fois par semaine sur le site Internet de la Société de gestion, www.candriam.com :

- i) la ventilation par échéance du portefeuille-titres des compartiments ;
- ii) le profil de crédit des compartiments ;
- iii) l'échéance moyenne pondérée et la durée de vie moyenne pondérée des compartiments ;
- iv) le détail des 10 principales participations des compartiments ;
- v) la valeur totale des actifs des compartiments ;
- vi) le rendement net des compartiments.

La société de gestion surveille l'évolution de la situation de très près afin de gérer celle-ci dans le meilleur intérêt des actionnaires.

Les compartiments suivants sont actuellement disponibles aux investisseurs :

<u>Compartiments</u>	<u>Devise de référence</u>
Candriam Money Market Euro	EUR
Candriam Money Market USD Sustainable	USD
Candriam Money Market Euro AAA	EUR

Les classes qui sont émises sont les suivantes :

- La **classe Classique (classe C)** est accessible aux personnes physiques et morales.
- La **classe I** est exclusivement réservée aux investisseurs institutionnels.
- La **classe R** est réservée aux intermédiaires financiers (y compris les distributeurs et plateformes) qui :
 - ont des accords différents avec leurs clients aux fins de la fourniture de services d'investissement en rapport avec le compartiment, et
 - n'ont pas le droit d'accepter et conserver de la Société de Gestion, en raison de leurs lois et règlements applicables ou suite à des conventions avec leurs clients, des droits, commissions ou autres avantages monétaires en rapport avec la fourniture des services d'investissement susmentionnés.
- La **classe R2** est réservée :
 - aux distributeurs et/ou intermédiaires approuvés par la Société de Gestion qui ne percevront, pour les investissements dans cette Classe, aucune forme de rémunération d'une entité du groupe Candriam, lorsque les investissements finaux dans les actions ont lieu dans le cadre d'un mandat.
 - aux OPC approuvés par la Société de Gestion.
- La **classe S** est réservée aux investisseurs institutionnels spécialement approuvés par la Société de gestion, et le montant minimum de souscription initiale est de 100.000.000 EUR. Ce minimum peut être modifié à la discrétion du Conseil d'administration, pourvu que le traitement égalitaire des actionnaires soit assuré un même jour d'évaluation.
- La **classe V** est exclusivement réservée aux investisseurs institutionnels dont le montant minimum de souscription initiale est de 30.000.000 EUR. Ce minimum peut être modifié à la discrétion du Conseil d'administration, pourvu que le traitement égalitaire des actionnaires soit assuré un même jour d'évaluation.
- La **classe Z** est réservée :
 - aux investisseurs institutionnels/professionnels approuvés par la Société de Gestion. L'activité de gestion de portefeuille pour cette classe étant directement rémunérée via le contrat conclu avec l'investisseur, aucune commission de gestion de portefeuille ne sera prélevée sur les actifs de cette classe.
 - aux OPC approuvés par la Société de Gestion et gérés par une entité du groupe Candriam.



Autres notes aux états financiers

Note 1 - Généralité (suite)

En outre, un processus de couverture de change peut être appliqué aux classes d'actions.

- Classes d'actions couvertes en devises de référence :

Ces classes d'actions couvertes visent à réduire l'effet des fluctuations de taux de change entre la devise de référence du compartiment et la devise dans laquelle est libellée la classe d'actions couverte.

Ce type de couverture a pour but de garantir que la performance de la classe d'actions couverte est raisonnablement comparable (après ajustement pour tenir compte de la différence de taux d'intérêt entre les deux devises) à celle d'une classe d'actions libellée dans la devise de référence du compartiment. Ce type de couverture est identifié au moyen du suffixe H ajouté dans la dénomination de la classe d'actions.

- Classes d'actions couvertes contre les fluctuations des actifs :

Ces classes d'actions couvertes visent à réduire l'effet des fluctuations de taux de change entre les devises dans lesquelles sont détenus les actifs d'un compartiment et la devise de la classe d'actions couverte. Ce type de couverture est identifié au moyen du suffixe AH ajouté dans la dénomination de la classe d'actions.

Note 2 - Principales méthodes comptables

Les états financiers de la SICAV sont préparés conformément à la réglementation en vigueur au Luxembourg concernant les Organismes de Placement Collectif. Des petits écarts peuvent apparaître dans certains totaux ou sous-totaux des états financiers en raison des règles d'arrondi.

Les valeurs nettes d'inventaire utilisées aux fins des états financiers sont datées du 30 juin 2022 .

Compartiments Candriam Money Market Euro et Candriam Money Market USD Sustainable : la valeur nette d'inventaire de chaque compartiment a été calculée le 3 janvier 2022 sur la base des derniers cours connus au moment de la valorisation.

Compartiment Candriam Money Market Euro AAA : la valeur nette d'inventaire du compartiment a été calculée le 30 juin 2022 sur la base des derniers cours connus au moment de la valorisation.

a) Évaluation du portefeuille-titres de chaque compartiment

L'évaluation de toute valeur admise à une cote officielle ou sur tout autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public est basée sur le dernier cours connu à Luxembourg, le jour d'évaluation, ou, si cette valeur est traitée sur plusieurs marchés, sur le dernier cours connu du marché principal de cette valeur. Si le dernier cours connu n'est pas représentatif, l'évaluation se basera sur la valeur probable de réalisation que le Conseil d'Administration estimera avec prudence et bonne foi. Les valeurs mobilières qui ne sont ni cotées ni négociées sur un marché d'actions ou tout autre marché en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public seront évaluées sur la base de la valeur probable de réalisation estimée avec prudence et bonne foi. Tous les autres avoirs seront évalués par les administrateurs sur base de la valeur probable de réalisation, laquelle doit être estimée de bonne foi et selon des principes et procédures généralement admis.

b) Bénéfices ou pertes net(te)s réalisé(e)s sur ventes d'investissements

Les bénéfices ou pertes réalisées sur les ventes d'investissements de chaque compartiment sont calculées sur la base du coût moyen des investissements vendus.

c) Différence de change

Les valeurs exprimées dans une devise autre que la devise de référence de chaque compartiment sont converties dans cette devise au taux de change en vigueur à la date de clôture.

Les produits et charges dans une devise autre que la devise de référence de chaque compartiment sont convertis dans cette devise aux taux de change en vigueur à la date de transaction.

Le coût d'acquisition des titres de chaque compartiment exprimé dans une devise autre que la devise de référence du compartiment est converti dans cette devise aux taux de change en vigueur au jour de l'achat.

Taux de change utilisés au 30 juin 2022 :

Pour les compartiments Candriam Money Market Euro et Candriam Money Market USD Sustainable :

1 EUR =	1.348550 CAD	1 EUR =	7.436650 DKK	1 EUR =	142.029650 JPY	1 EUR =	1.045450 USD
1 EUR =	1.000900 CHF	1 EUR =	0.860800 GBP	1 EUR =	10.713150 SEK		

Pour le compartiment Candriam Money Market Euro AAA :

1 EUR =	0.998350 CHF	1 EUR =	7.439800 DKK	1 EUR =	0.864500 GBP	1 EUR =	1.047850 USD
---------	--------------	---------	--------------	---------	--------------	---------	--------------

d) Évaluation des contrats de change à terme

Les contrats de change à terme sont évalués aux cours de change à terme à la date de clôture applicables pour la période restante jusqu'à l'échéance. La plus-value / (moins-value) non réalisée sur contrats de change à terme est présentée dans l'état des actifs nets, au poste « Plus-value / (moins-value) nette non réalisée sur contrats de change à terme ».

Les bénéfices / (pertes) réalisés et la variation de plus-value / (moins-value) nette non réalisée en découlant figurent à l'état des variations des actifs nets respectivement, sous les postes « Bénéfice / (Perte) net(te) réalisé(e) sur contrats de change à terme » et « Variation de la plus-value / (moins-value) nette non réalisée sur contrats de change à terme ».

Pour les détails concernant les contrats de change à terme en cours, le cas échéant, veuillez vous référer à la section « Notes aux états financiers – Tableau des instruments dérivés ».



Autres notes aux états financiers

Note 2 - Principales méthodes comptables (suite)

e) Coûts de transaction

Pour la période clôturée au 30 juin 2022, la SICAV a encouru des frais de transaction et des frais de courtage liés à l'achat et à la vente de valeurs mobilières, instruments du marché monétaire, autres actifs éligibles et instruments dérivés. Ces charges sont présentées dans l'état des variations des actifs nets au poste « Coûts de transaction ».

f) Revenus

Les produits d'intérêts sont comptabilisés conformément aux conditions de l'investissement sous-jacent. Les produits sont enregistrés nets des retenues à la source respectives, le cas échéant. Les dividendes sont comptabilisés à l'ex-date.

g) Abréviations utilisées dans les portefeuilles-titres

FL.R : Floating Rate Notes
ZCP : Zéro coupon
Q : Trimestriel
A : Annuel
S : Semestriel

Note 3 - Commission sur émissions d'actions de la SICAV

Les actions de chacun des compartiments seront émises à un prix correspondant à la valeur nette d'inventaire par action du compartiment correspondant, majorée d'une commission d'entrée de 0,50 % maximum, revenant aux agents de la vente. Les actions de chacun des compartiments seront rachetées à la valeur nette d'inventaire par action. Les statuts prévoient que les actions de chaque classe ne peuvent être émises à un prix inférieur à leur valeur nette d'inventaire par action.

Note 4 - Commissions de gestion

Candriam Luxembourg (ci-après la « Société de gestion ») dont le siège social est sis SERENITY - Bloc B, 19-21, Route d'Arlon, L - 8009 Strassen, société en commandite par actions de droit luxembourgeois constituée à Luxembourg le 10 juillet 1991, a été désignée comme Société de gestion de la SICAV en vertu d'un contrat conclu entre la SICAV et Candriam Luxembourg.

Candriam Luxembourg, société en commandite par actions, a reçu l'agrément de Société de gestion au sens du chapitre 15 de la Loi de 2010. À ce titre, la Société est autorisée à exercer les activités de gestion collective de portefeuilles, de gestion de portefeuilles d'investissement et de conseil en investissements. Ses statuts ont été modifiés pour la dernière fois le 19 mai 2016 et les modifications correspondantes ont été publiées dans le « Mémorial C (Recueil des Sociétés et Associations) ». Une version coordonnée des statuts a été déposée au Registre des Sociétés de Luxembourg.

Candriam Luxembourg est une filiale du Groupe Candriam, une entité du Groupe New York Life Insurance Company. Elle est responsable des activités de gestion de portefeuille, d'administration (Agent administratif, Agent de transfert et Teneur de registre) et de commercialisation (distribution).

L'exécution des activités de Gestion de portefeuille pour l'ensemble des compartiments est déléguée à : Candriam Belgium, 58, Avenue des Arts , B - 1000 Bruxelles.

En rémunération de son activité de gestion de portefeuille, la Société de gestion percevra des commissions de gestion exprimées en pourcentage annuel de la valeur liquidative moyenne de chaque compartiment de la SICAV, conformément aux informations ci-dessous. Ces commissions sont payables mensuellement.

Si les prestations sont uniquement assurées durant une partie du mois, les commissions perçues par la Société de gestion sont déterminées prorata temporis.

Les taux en vigueur au 30 juin 2022 sont les suivants :

Compartiments	Classe d'actions	Type d'action	ISIN	Commission de gestion
Candriam Money Market Euro	C	Capitalisation	LU0093583077	0.50%
	C	Distribution	LU0093583234	0.50%
	I	Capitalisation	LU0206982331	0.10%
	R	Capitalisation	LU0936337848	0.10%
	R2	Distribution	LU1389877876	0.13%
	V	Capitalisation	LU0323048693	0.05%
	Z	Capitalisation	LU0391999124	0.00%
Candriam Money Market Euro AAA	C	Capitalisation	LU0354091653	0.05%
	C	Distribution	LU0354091737	0.05%
	I	Capitalisation	LU0354091901	0.04%
	I	Distribution	LU0354127358	0.04%
	R	Capitalisation	LU0936338655	0.04%
	V	Capitalisation	LU0354092115	0.03%
	V	Distribution	LU0354092206	0.03%
Candriam Money Market USD Sustainable	Z	Capitalisation	LU0391999470	0.00%
	C	Capitalisation	LU0049341216	0.30%
	C	Distribution	LU0094032728	0.30%
	I	Capitalisation	LU0206982414	0.15%
	I	Distribution	LU0355214700	0.15%
	V	Capitalisation	LU0323048347	0.06%
Z	Capitalisation	LU0391999553	0.00%	



Autres notes aux états financiers

Note 4 - Commissions de gestion (suite)

Le tableau ci-après présente les taux annuels de commission de gestion maximum appliqués aux OPC investis par les différents compartiments de Candriam Money Market au 30 juin 2022.

Fonds cible	Taux maximal
Candriam Monétaire SICAV V EUR C	0.15%
Candriam Sustainable Money Market Euro V EUR C	0.06%
BNP Paribas Instacash EUR 1D Short Term VNAV I EUR	0.00%
Candriam Monétaire SICAV I EUR C	0.20%
Candriam Sustainable Money Market Euro Z EUR C	0.00%

Note 5 - Charges opérationnelles et administratives

La SICAV supporte les charges opérationnelles et administratives courantes engagées pour couvrir tous les frais fixes et variables, charges, commissions et autres dépenses, telles que définies ci-après (les « Charges Opérationnelles et Administratives »).

Les Charges Opérationnelles et Administratives couvrent les frais suivants, sans que cette liste soit limitative :

a) les dépenses directement engagées par la SICAV, en ce compris, sans toutefois s'y limiter, les commissions et charges de la banque dépositaire, les commissions et frais des réviseurs d'entreprises agréés, les frais de couverture des actions, en ce compris ceux facturés par la Société de gestion, les honoraires versés aux Administrateurs, ainsi que les frais et débours raisonnables encourus par ou pour les Administrateurs ;

b) une « commission de service », versée à la Société de gestion et comprenant la somme restante des Charges opérationnelles et administratives déduction faite des dépenses détaillées à la section a) ci-dessus, à savoir, notamment, les commissions et frais de l'Agent domiciliataire, de l'Agent administratif, de l'Agent de transfert et Teneur de registre et de l'Agent payeur principal, les coûts liés à l'enregistrement et au maintien dudit enregistrement dans toutes les juridictions (tels que les commissions prélevées par les autorités de surveillance concernées, les frais de traduction et la rémunération des Représentants à l'étranger et des agents payeurs locaux), les coûts de publication du cours des actions, les frais postaux et les frais de télécommunication, les frais de préparation, d'impression, de traduction et de distribution des prospectus, des documents d'informations clés pour l'investisseur, des avis aux actionnaires, des rapports financiers ou de tout autre document destiné aux actionnaires, les honoraires et frais juridiques, les charges et frais liés à la souscription de tout abonnement/licence ou tout autre recours à des informations ou des données payantes, les frais engendrés par l'utilisation par la SICAV d'une marque déposée, les frais et commissions revenant à la Société de gestion et/ou à ses délégataires et/ou à tout autre agent nommé par la SICAV elle-même et/ou aux experts indépendants.

Les Charges opérationnelles et administratives sont exprimées en pourcentage annuel de la valeur nette d'inventaire moyenne de chaque classe d'actions.

À la fin d'une période donnée, si les charges et dépenses réelles devaient être supérieures au pourcentage de Charges Opérationnelles et Administratives fixé pour une classe d'actions, alors, la Société de Gestion prendrait la différence à sa charge. Inversement, si les charges et dépenses réelles s'avéraient inférieures au pourcentage de Charges Opérationnelles et Administratives fixé pour une classe d'Actions, alors la Société de Gestion conserverait la différence.

La Société de Gestion pourra donner instruction à la SICAV de procéder au règlement de tout ou partie des dépenses telles qu'énumérées ci-avant directement sur ses actifs.

Dans pareil cas, le montant des Charges Opérationnelles et Administratives serait réduit en conséquence.

Ces charges sont payables mensuellement.

Les taux maximaux en vigueur au 30 juin 2022 sont les suivants :

Compartiments	Classe d'actions	Type d'action	ISIN	Taux maximum
Candriam Money Market Euro	C	Capitalisation	LU0093583077	0.30%
	C	Distribution	LU0093583234	0.30%
	I	Capitalisation	LU0206982331	0.17%
	R	Capitalisation	LU0936337848	0.30%
	R2	Distribution	LU1389877876	0.30%
	V	Capitalisation	LU0323048693	0.17%
	Z	Capitalisation	LU0391999124	0.17%
Candriam Money Market Euro AAA	C	Capitalisation	LU0354091653	0.30%
	C	Distribution	LU0354091737	0.30%
	I	Capitalisation	LU0354091901	0.17%
	I	Distribution	LU0354127358	0.17%
	R	Capitalisation	LU0936338655	0.30%
	V	Capitalisation	LU0354092115	0.17%
	V	Distribution	LU0354092206	0.17%
Z	Capitalisation	LU0391999470	0.17%	
Candriam Money Market USD Sustainable	C	Capitalisation	LU0049341216	0.25%
	C	Distribution	LU0094032728	0.25%
	I	Capitalisation	LU0206982414	0.16%
	I	Distribution	LU0355214700	0.16%
	V	Capitalisation	LU0323048347	0.16%
	Z	Capitalisation	LU0391999553	0.16%



Autres notes aux états financiers

Note 6 - Taxe d'abonnement

La SICAV est régie par les lois fiscales luxembourgeoises. En vertu de la législation et de la réglementation actuellement en vigueur, la SICAV est soumise au Luxembourg à une taxe annuelle de 0,01%, payable trimestriellement et calculée sur la valeur nette d'inventaire de la SICAV à la fin de chaque trimestre. Ce taux est réduit à 0% pour les classes réservées aux investisseurs institutionnels.

En outre, aucune taxe d'abonnement n'est due sur les avoirs que la SICAV détient dans des parts d'autres OPCVM déjà soumis à la taxe d'abonnement à Luxembourg.

Le gouvernement belge a promulgué une loi visant à imposer une fois par an la valeur nette d'inventaire des fonds d'investissements étrangers enregistrés en Belgique. Cette taxe annuelle est calculée sur les montants nets placés en Belgique par des intermédiaires financiers belges. En l'absence de déclaration suffisante relative à ces chiffres, l'administration fiscale pourra calculer la taxe sur la totalité des actifs de ces compartiments. La loi belge du 17 juin 2013 portant des dispositions fiscales et financières et des dispositions relatives au développement durable porte le taux de la taxe annuelle pour les Organismes de Placement Collectif à 0,0925 % avec effet au 1 janvier 2014.

À titre conservatoire, la Sicav a introduit une réclamation en restitution de la taxe auprès de l'administration fiscale belge et auprès du tribunal de Première Instance de Bruxelles. À ce stade, il ne peut être préjugé de l'issue du litige ou d'un quelconque remboursement au bénéfice de la Sicav. Dans le cadre d'une affaire similaire, l'État belge s'est pourvu en Cassation contre les arrêts de la Cour d'Appel faisant droit au plaignant. La société de gestion a été informée que la Cour de cassation s'était prononcée contre le plaignant le 25 mars 2022. La Cour de cassation (chambre francophone) estime que la Cour d'appel de Bruxelles a qualifié à tort la taxe d'abonnement belge d'impôt sur la fortune couvert par la convention préventive de la double imposition conclue entre la Belgique et le Luxembourg (laquelle convention attribue le droit d'imposer des SICAV luxembourgeoises uniquement au Luxembourg et pas à la Belgique, ce qui justifie la réclamation en restitution de la taxe d'abonnement belge).

L'affaire a été renvoyée à la Cour d'appel de Liège, qui sera tenue par la conclusion de la Cour de cassation.

Un autre arrêt de la Cour de cassation (chambre néerlandophone) du 21 avril 2022 ne conteste pas le fait que la taxe d'abonnement belge constitue un impôt sur la fortune, mais considère que la convention préventive de la double imposition conclue entre la Belgique et le Luxembourg (contrairement à celle signée avec les Pays-Bas) ne couvre pas dans son champ d'application un impôt sur la fortune prélevé en Belgique.

La perspective d'un remboursement est donc limitée et celui-ci ne sera en tout état de cause pas possible à court terme.

Note 7 - Dépôts à terme

Candriam Money Market Euro AAA

Contrepartie	Maturité	Montant (en EUR)
KBC BANK NV BRUXELLES	30/06/2022	9,500,000

Note 8 - Garanties

En relation avec les instruments dérivés de gré à gré, des garanties en espèces ont été versées à BNP Paribas et UBS Europe SE :

Compartiments	Devise	Garantie en espèces versée	Garantie en espèces reçue
Candriam Money Market USD Sustainable	USD	0	140,000

Note 9 - Changement dans la composition du portefeuille-titres

Une liste reprenant les opérations (ventes et achats) des portefeuilles d'investissement est disponible gratuitement au siège social de la SICAV.

Note 10 - Événements postérieurs à la clôture

Avec effet au 1^{er} juillet 2022 (la « Date de prise d'effet »), Candriam Luxembourg a absorbé ses filiales Candriam Belgium et Candriam France par le biais d'une fusion luxembourgeoise par absorption conformément à l'article 1021-1 (et suivants) de la loi luxembourgeoise concernant les sociétés commerciales du 10 août 1915, telle que modifiée. À compter de la Date de prise d'effet, le nom de Candriam Luxembourg a été modifié en Candriam.



Informations supplémentaires

Gestion des risques – calcul du risque global

Comme l'exige la circulaire CSSF 11/512, le Conseil d'Administration de la Société doit déterminer le mode de gestion des risques de la Société, en utilisant soit l'approche par l'engagement soit l'approche VaR.

Le Conseil d'Administration de la Société a choisi d'adopter l'approche par l'engagement comme méthode de détermination du risque global pour tous les compartiments de la Société.

Vote par procuration

Politique d'engagement et de vote, utilisation des droits de vote

La Société de Gestion n'exerce pas de droit de vote pour les fonds considérés.

Pour toutes les questions de sensibilisation, nous vous invitons à consulter la politique de sensibilisation et les rapports associés, lesquels sont disponibles sur le site Internet de Candriam à l'adresse suivante :

www.candriam.com/en/professional/market-insights/sri-publications.