



Ungeprüfter Halbjahresbericht  
**Candriam L**

30. Juni 2026

01.01.2026 - 30.06.2026  
*SICAV luxemburgischen Rechts*  
*R.C.S. Luxemburg B-182856*



# Candriam L

SICAV luxemburgischen Rechts

Ungeprüfter Halbjahresbericht für die Periode  
vom 1. Januar 2026 bis zum 30. Juni 2026



## Inhalt

|                                                                                                           |    |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
| Verwaltung der SICAV                                                                                      | 4  |
| Angaben zur SICAV                                                                                         | 5  |
| Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2026                                                          | 6  |
| Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für die Periode vom 1. Januar 2026 bis zum 30. Juni 2026 | 9  |
| Statistiken                                                                                               | 12 |
| Anlageportfolio zum 30. Juni 2026                                                                         | 14 |
| Candriam L Alternative Multi-Strategies                                                                   | 14 |
| Candriam L Balanced Asset Allocation                                                                      | 18 |
| Candriam L Conservative Asset Allocation                                                                  | 21 |
| Candriam L Dynamic Asset Allocation                                                                       | 24 |
| Candriam L Multi-Asset Income                                                                             | 27 |
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth                                                                    | 33 |
| Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente                                            | 39 |
| Sonstige Erläuterungen zum Abschluss                                                                      | 58 |
| Zusätzliche ungeprüfte Angaben                                                                            | 67 |



## Verwaltung der SICAV

### Verwaltungsrat

#### Vorsitz

Tanguy DE VILLENFAGNE  
Advisor to the Group Strategic Committee  
Candriam

#### Mitglieder

Thierry BLONDEAU  
Independent Director

Catherine DELANGHE  
Independent Director

Nadège DUFOSSE  
Head of Asset Allocation  
Candriam

Renato GUERRIERO  
Deputy Chief Executive Officer - Global Development & Distribution  
Candriam

Aurore PELLE  
Senior Internal Auditor  
Candriam

### Gesellschaftssitz

5, Allée Scheffer  
L-2520 Luxembourg

### Depotbank und Hauptzahlstelle

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

### Verwaltungsgesellschaft

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

Die Funktionen der **Verwaltungsstelle**, der **Domizilstelle** und der **Transferstelle** (einschließlich der **Registerführungstätigkeit**) wurden übertragen auf:

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

Die Durchführung der **Portfoliomanagementaktivitäten** erfolgt direkt durch Candriam direkt und/oder eine oder mehrere Candriam-Niederlassungen:

Candriam – Succursale française  
40, Rue Washington  
F-75408 Paris Cedex 08

Candriam – Belgian Branch  
58, Avenue des Arts  
B-1000 Brüssel

Candriam – UK Establishment  
Aldersgate Street 200,  
London EC1A 4 HD

Die Umsetzung der **Wertpapierleihgeschäfte** erfolgt direkt durch Candriam und/oder eine oder mehrere der Candriam-Niederlassungen und ist zum Teil delegiert an:

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

### „Réviseur d'entreprises agréé“

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

### Finanzdienste

in Belgien:  
Belfius Banque S.A.  
11, Place Rogier  
B-1210 Brüssel

## Angaben zur SICAV

Candriam L (nachstehend die „SICAV“) ist eine offene Investmentgesellschaft nach luxemburgischem Recht. Sie wurde am 17. Dezember 2013 in Luxemburg gemäß der Gesetzgebung des Großherzogtums Luxemburg auf unbegrenzte Zeit gegründet. Die SICAV unterliegt den Bestimmungen des Gesetzes vom 10. August 1915 über Handelsgesellschaften (nachstehend das „Gesetz vom 10. August 1915“), sofern es nicht durch das Gesetz in seiner geänderten Fassung davon befreit ist. Ihr Mindestkapital beträgt 1.250.000 EUR.

Die Satzung wurde beim luxemburgischen Handels- und Gesellschaftsregister hinterlegt und im „Mémorial C, Recueil des Sociétés et Associations“ veröffentlicht. Sie wurde zuletzt am 5. Oktober 2020 geändert und die entsprechenden Änderungen wurden im „Recueil Électronique des Sociétés et Associations“ (RESA) veröffentlicht.

Die SICAV ist im Handels- und Gesellschaftsregister Luxemburg unter der Nummer B-182856 eingetragen.

Die SICAV veröffentlicht einen ausführlichen Jahresbericht über ihre Aktivitäten und das verwaltete Vermögen. Der Bericht enthält eine konsolidierte Aufstellung des Nettovermögens sowie eine konsolidierte Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens in EUR, das Anlageportfolio jedes Teilfonds und den Prüfungsbericht. Dieser Bericht ist am eingetragenen Sitz der SICAV und am Sitz der Banken erhältlich, die in den Ländern, in denen die SICAV-Anteile vertrieben werden, Finanzdienstleistungen erbringen.

Darüber hinaus veröffentlicht diese nach Ablauf eines jeden Halbjahres einen Bericht, der insbesondere die Aufstellung des Nettovermögens, die Entwicklung des Nettovermögens für den Berichtszeitraum, die Entwicklung der Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile für den Berichtszeitraum, die Zusammensetzung des Portfolios, die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile und den Nettoinventarwert je Anteil umfasst.

Die Jahreshauptversammlung der Anteilsinhaber der SICAV findet jedes Jahr am Sitz der SICAV oder an einem anderen in der Einberufung angegebenen Ort in Luxemburg statt. Sie findet innerhalb von 6 Monaten nach Ende des Geschäftsjahres statt.

Die Einladungen zu allen Hauptversammlungen werden allen eingetragenen Anteilsinhabern mindestens acht Tage vor der Hauptversammlung an die im Register der Anteilsinhaber angegebene Adresse zugesandt. Diese Einberufungsschreiben enthalten den Ort und die Uhrzeit der Hauptversammlung der Anteilsinhaber sowie die Teilnahmebedingungen, die Tagesordnung und die Erfordernisse des luxemburgischen Rechts in Bezug auf Beschlussfähigkeit und notwendige Mehrheiten.

Die Bekanntmachungen werden auch in der Presse der Länder veröffentlicht, in denen die SICAV-Anteile vertrieben werden, sofern die Gesetzgebung dieser Länder dies erfordert. Die Anforderungen an die Teilnahme, die Beschlussfähigkeit und die Mehrheit in jeder Generalversammlung sind in der Satzung der SICAV festgelegt.

Wenn es die lokale Gesetzgebung vorschreibt, werden die Bekanntmachungen auch in Luxemburg und in den Ländern, in denen die Anteile der SICAV zum öffentlichen Vertrieb zugelassen sind, in einer vom Verwaltungsrat ausgewählten Zeitung veröffentlicht.

Das Geschäftsjahr beginnt am 1. Januar und endet am 31. Dezember eines jeden Jahres.

Eine detaillierte Aufstellung der Portfoliobewegungen ist auf Anfrage kostenlos am Sitz der SICAV erhältlich.

Der Verkaufsprospekt, die Basisinformationsblätter für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte (PRIIP BiB), die Satzung der SICAV und die Finanzberichte werden am Sitz der SICAV zur kostenlosen öffentlichen Einsichtnahme bereitgehalten.



## Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2026

|                                                                  |    | Candriam L<br>Alternative Multi-<br>Strategies | Candriam L<br>Balanced Asset<br>Allocation | Candriam L<br>Conservative<br>Asset Allocation |
|------------------------------------------------------------------|----|------------------------------------------------|--------------------------------------------|------------------------------------------------|
|                                                                  |    | EUR                                            | EUR                                        | EUR                                            |
| <b>Aktiva</b>                                                    |    |                                                |                                            |                                                |
| Anlageportfolio zum Marktwert                                    | 2a | 50,153,495                                     | 199,048,190                                | 189,787,451                                    |
| Optionen zum Marktwert (Long-Position)                           | 2e | 0                                              | 47,588                                     | 46,312                                         |
| Guthaben bei Banken und Brokern                                  | 9  | 16,401,691                                     | 5,276,755                                  | 3,717,570                                      |
| Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren                     |    | 848,289                                        | 0                                          | 0                                              |
| Forderungen aus Zeichnungen                                      |    | 0                                              | 828                                        | 0                                              |
| Forderungen aus CFD                                              |    | 2,373,422                                      | 0                                          | 0                                              |
| Dividendenforderungen aus CFD                                    |    | 271,044                                        | 0                                          | 0                                              |
| Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto                     |    | 212,259                                        | 13,877                                     | 11,777                                         |
| Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures                       | 2e | 0                                              | 112,983                                    | 295,572                                        |
| Sonstige Vermögenswerte                                          |    | 0                                              | 0                                          | 0                                              |
| <b>Aktiva insgesamt</b>                                          |    | <b>70,260,200</b>                              | <b>204,500,221</b>                         | <b>193,858,682</b>                             |
| <b>Passiva</b>                                                   |    |                                                |                                            |                                                |
| Kontokorrentkredite                                              |    | 307,594                                        | 67                                         | 0                                              |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen                           |    | 882,189                                        | 0                                          | 0                                              |
| Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen                          |    | 0                                              | 0                                          | 0                                              |
| Verbindlichkeiten aus CFD                                        |    | 1,940,602                                      | 0                                          | 0                                              |
| Dividendenverbindlichkeiten aus CFD                              |    | 307,312                                        | 0                                          | 0                                              |
| Nicht realisierte Nettoabschreibungen auf Devisentermingeschäfte | 2f | 0                                              | 182,685                                    | 338,372                                        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures                           | 2e | 31,577                                         | 0                                          | 0                                              |
| Nicht realisierter Verlust aus CFD                               | 2g | 75,426                                         | 0                                          | 0                                              |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren                        | 3  | 6,994                                          | 79,755                                     | 64,663                                         |
| Verbindlichkeiten aus Betriebs- und Verwaltungskosten            | 4  | 12,992                                         | 4,640                                      | 3,918                                          |
| Verbindlichkeiten aus Performancegebühren                        | 5  | 761,820                                        | 0                                          | 0                                              |
| Verbindlichkeiten aus Zeichnungssteuer                           | 6  | 1,562                                          | 1,059                                      | 926                                            |
| Sonstige Verbindlichkeiten                                       |    | 0                                              | 0                                          | 0                                              |
| <b>Passiva insgesamt</b>                                         |    | <b>4,328,068</b>                               | <b>268,206</b>                             | <b>407,879</b>                                 |
| <b>Nettovermögen insgesamt</b>                                   |    | <b>65,932,132</b>                              | <b>204,232,015</b>                         | <b>193,450,803</b>                             |



## Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2026

|                                                                  |    | Candriam L<br>Dynamic Asset<br>Allocation | Candriam L Multi-<br>Asset Income | Candriam L Multi-<br>Asset Income &<br>Growth |
|------------------------------------------------------------------|----|-------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------|
|                                                                  |    | EUR                                       | EUR                               | EUR                                           |
| <b>Aktiva</b>                                                    |    |                                           |                                   |                                               |
| Anlageportfolio zum Marktwert                                    | 2a | 7,640,237                                 | 467,878,149                       | 135,329,343                                   |
| Optionen zum Marktwert (Long-Position)                           | 2e | 406                                       | 134,064                           | 33,908                                        |
| Guthaben bei Banken und Brokern                                  | 9  | 214,522                                   | 24,246,866                        | 7,361,483                                     |
| Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren                     |    | 237,477                                   | 0                                 | 0                                             |
| Forderungen aus Zeichnungen                                      |    | 16,247                                    | 1,029,904                         | 0                                             |
| Forderungen aus CFD                                              |    | 0                                         | 0                                 | 0                                             |
| Dividendenforderungen aus CFD                                    |    | 0                                         | 0                                 | 0                                             |
| Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto                     |    | 135                                       | 3,600,521                         | 665,011                                       |
| Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures                       | 2e | 9,043                                     | 622,694                           | 0                                             |
| Sonstige Vermögenswerte                                          |    | 0                                         | 41,301                            | 4,031                                         |
| <b>Aktiva insgesamt</b>                                          |    | <b>8,118,067</b>                          | <b>497,553,499</b>                | <b>143,393,776</b>                            |
| <b>Passiva</b>                                                   |    |                                           |                                   |                                               |
| Kontokorrentkredite                                              |    | 0                                         | 0                                 | 0                                             |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen                           |    | 79,244                                    | 3,168,288                         | 1,420,236                                     |
| Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen                          |    | 0                                         | 54,803                            | 4,756                                         |
| Verbindlichkeiten aus CFD                                        |    | 0                                         | 0                                 | 0                                             |
| Dividendenverbindlichkeiten aus CFD                              |    | 0                                         | 0                                 | 0                                             |
| Nicht realisierte Nettoabschreibungen auf Devisentermingeschäfte | 2f | 11,804                                    | 682,957                           | 282,980                                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures                           | 2e | 0                                         | 0                                 | 31,809                                        |
| Nicht realisierter Verlust aus CFD                               | 2g | 0                                         | 0                                 | 0                                             |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren                        | 3  | 5,168                                     | 58,733                            | 36,004                                        |
| Verbindlichkeiten aus Betriebs- und Verwaltungskosten            | 4  | 443                                       | 50,096                            | 14,606                                        |
| Verbindlichkeiten aus Performancegebühren                        | 5  | 0                                         | 10,162                            | 130,140                                       |
| Verbindlichkeiten aus Zeichnungssteuer                           | 6  | 104                                       | 19,971                            | 5,930                                         |
| Sonstige Verbindlichkeiten                                       |    | 0                                         | 4,367                             | 1,321                                         |
| <b>Passiva insgesamt</b>                                         |    | <b>96,763</b>                             | <b>4,049,377</b>                  | <b>1,927,782</b>                              |
| <b>Nettovermögen insgesamt</b>                                   |    | <b>8,021,304</b>                          | <b>493,504,122</b>                | <b>141,465,994</b>                            |



## Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2026

|                                                                  |    | Kombiniert           |
|------------------------------------------------------------------|----|----------------------|
|                                                                  |    | EUR                  |
| <b>Aktiva</b>                                                    |    |                      |
| Anlageportfolio zum Marktwert                                    | 2a | 1,049,836,865        |
| Optionen zum Marktwert (Long-Position)                           | 2e | 262,278              |
| Guthaben bei Banken und Brokern                                  | 9  | 57,218,887           |
| Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren                     |    | 1,085,766            |
| Forderungen aus Zeichnungen                                      |    | 1,046,979            |
| Forderungen aus CFD                                              |    | 2,373,422            |
| Dividendenforderungen aus CFD                                    |    | 271,044              |
| Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto                     |    | 4,503,580            |
| Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures                       | 2e | 1,040,292            |
| Sonstige Vermögenswerte                                          |    | 45,332               |
| <b>Aktiva insgesamt</b>                                          |    | <b>1,117,684,445</b> |
| <b>Passiva</b>                                                   |    |                      |
| Kontokorrentkredite                                              |    | 307,661              |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen                           |    | 5,549,957            |
| Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen                          |    | 59,559               |
| Verbindlichkeiten aus CFD                                        |    | 1,940,602            |
| Dividendenverbindlichkeiten aus CFD                              |    | 307,312              |
| Nicht realisierte Nettoabschreibungen auf Devisentermingeschäfte | 2f | 1,498,798            |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures                           | 2e | 63,386               |
| Nicht realisierter Verlust aus CFD                               | 2g | 75,426               |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren                        | 3  | 251,317              |
| Verbindlichkeiten aus Betriebs- und Verwaltungskosten            | 4  | 86,695               |
| Verbindlichkeiten aus Performancegebühren                        | 5  | 902,122              |
| Verbindlichkeiten aus Zeichnungssteuer                           | 6  | 29,552               |
| Sonstige Verbindlichkeiten                                       |    | 5,688                |
| <b>Passiva insgesamt</b>                                         |    | <b>11,078,075</b>    |
| <b>Nettovermögen insgesamt</b>                                   |    | <b>1,106,606,370</b> |



## Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für die Periode vom 1. Januar 2026 bis zum 30. Juni 2026

|                                                                                         |    | Candriam L<br>Alternative Multi-<br>Strategies | Candriam L<br>Balanced Asset<br>Allocation | Candriam L<br>Conservative<br>Asset Allocation |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|----|------------------------------------------------|--------------------------------------------|------------------------------------------------|
|                                                                                         |    | EUR                                            | EUR                                        | EUR                                            |
| <b>Nettovermögen zu Beginn der Periode</b>                                              |    | <b>42,233,527</b>                              | <b>202,457,733</b>                         | <b>190,359,336</b>                             |
| <b>Erträge</b>                                                                          |    |                                                |                                            |                                                |
| Dividenden, netto                                                                       | 2l | 80,914                                         | 241,245                                    | 202,095                                        |
| Zinsen auf Anleihen und Geldmarktinstrumente, netto                                     |    | 284,721                                        | 0                                          | 0                                              |
| Erhaltene Zinsen aus CFD                                                                |    | 135,524                                        | 0                                          | 0                                              |
| Bankzinsen                                                                              |    | 174,243                                        | 45,345                                     | 33,953                                         |
| Erhaltene Dividenden aus CFD                                                            |    | 661,421                                        | 0                                          | 0                                              |
| Sonstige Erträge                                                                        |    | 46                                             | 313                                        | 0                                              |
| <b>Erträge insgesamt</b>                                                                |    | <b>1,336,869</b>                               | <b>286,903</b>                             | <b>236,048</b>                                 |
| <b>Aufwendungen</b>                                                                     |    |                                                |                                            |                                                |
| Verwaltungsgebühren                                                                     | 3  | 32,489                                         | 465,048                                    | 393,955                                        |
| Performancegebühren                                                                     | 5  | 693,220                                        | 0                                          | 0                                              |
| Betriebs- und Verwaltungskosten                                                         | 4  | 65,722                                         | 27,226                                     | 23,863                                         |
| Zeichnungssteuer                                                                        | 6  | 2,792                                          | 3,486                                      | 2,598                                          |
| Transaktionskosten                                                                      | 2k | 61,105                                         | 57,312                                     | 52,658                                         |
| Gezahlte Zinsen auf CFD                                                                 |    | 807,789                                        | 0                                          | 0                                              |
| Bankzinsen                                                                              |    | 21,984                                         | 5,727                                      | 6,510                                          |
| Gezahlte Dividenden auf CFD, netto                                                      |    | 616,167                                        | 0                                          | 0                                              |
| Sonstige Aufwendungen                                                                   |    | 12,606                                         | 0                                          | 0                                              |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>                                                           |    | <b>2,313,874</b>                               | <b>558,799</b>                             | <b>479,584</b>                                 |
| <b>Nettoertrag/(-verlust) aus Wertpapieren</b>                                          |    | <b>(977,005)</b>                               | <b>(271,896)</b>                           | <b>(243,536)</b>                               |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Wertpapieren                    | 2b | 813,055                                        | 7,509,537                                  | 5,537,529                                      |
| Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Optionen                                      | 2e | 0                                              | (871,145)                                  | (829,922)                                      |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften                         | 2f | 0                                              | 253,488                                    | (138,195)                                      |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures                                         | 2e | 357,406                                        | 2,072,474                                  | 1,317,757                                      |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus CFD                                             | 2g | 2,908,571                                      | 0                                          | 0                                              |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen                                         |    | 68,804                                         | (80,359)                                   | 70,934                                         |
| <b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>                                              |    | <b>3,170,831</b>                               | <b>8,612,099</b>                           | <b>5,714,567</b>                               |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren            | 2a | 766,671                                        | 9,318,134                                  | 4,952,891                                      |
| Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Optionen          | 2e | 0                                              | (216,095)                                  | (165,307)                                      |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften | 2e | 0                                              | (399,749)                                  | (584,126)                                      |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Futures                 | 2e | (352,057)                                      | (46,372)                                   | 233,104                                        |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus CFD                     | 2g | (297,334)                                      | 0                                          | 0                                              |
| <b>Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>            |    | <b>3,288,111</b>                               | <b>17,268,017</b>                          | <b>10,151,129</b>                              |
| <b>Entwicklung des Kapitals</b>                                                         |    |                                                |                                            |                                                |
| Zeichnung von Anteilen                                                                  |    | 20,508,306                                     | 7,311,542                                  | 8,798,473                                      |
| Rücknahme von Anteilen                                                                  |    | (97,812)                                       | (22,797,620)                               | (15,853,135)                                   |
| Ausgeschüttete Dividenden                                                               | 7  | 0                                              | (7,657)                                    | (5,000)                                        |
| <b>Nettovermögen zum Ende der Periode</b>                                               |    | <b>65,932,132</b>                              | <b>204,232,015</b>                         | <b>193,450,803</b>                             |



## Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für die Periode vom 1. Januar 2026 bis zum 30. Juni 2026

|                                                                                         |    | Candriam L<br>Dynamic Asset<br>Allocation | Candriam L Multi-<br>Asset Income | Candriam L Multi-<br>Asset Income &<br>Growth |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|----|-------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------|
|                                                                                         |    | EUR                                       | EUR                               | EUR                                           |
| <b>Nettovermögen zu Beginn der Periode</b>                                              |    | <b>7,081,907</b>                          | <b>427,220,979</b>                | <b>123,245,208</b>                            |
| <b>Erträge</b>                                                                          |    |                                           |                                   |                                               |
| Dividenden, netto                                                                       | 2l | 6,048                                     | 510,112                           | 345,095                                       |
| Zinsen auf Anleihen und Geldmarktinstrumente, netto                                     |    | 0                                         | 4,093,469                         | 782,010                                       |
| Erhaltene Zinsen aus CFD                                                                |    | 0                                         | 0                                 | 0                                             |
| Bankzinsen                                                                              |    | 3,341                                     | 260,980                           | 54,637                                        |
| Erhaltene Dividenden aus CFD                                                            |    | 0                                         | 0                                 | 0                                             |
| Sonstige Erträge                                                                        |    | 23                                        | 5                                 | 12                                            |
| <b>Erträge insgesamt</b>                                                                |    | <b>9,412</b>                              | <b>4,864,566</b>                  | <b>1,181,754</b>                              |
| <b>Aufwendungen</b>                                                                     |    |                                           |                                   |                                               |
| Verwaltungsgebühren                                                                     | 3  | 29,371                                    | 338,068                           | 215,216                                       |
| Performancegebühren                                                                     | 5  | 0                                         | 10,246                            | 130,152                                       |
| Betriebs- und Verwaltungskosten                                                         | 4  | 2,509                                     | 287,322                           | 81,162                                        |
| Zeichnungssteuer                                                                        | 6  | 364                                       | 39,023                            | 11,647                                        |
| Transaktionskosten                                                                      | 2k | 1,766                                     | 145,152                           | 74,500                                        |
| Gezahlte Zinsen auf CFD                                                                 |    | 0                                         | 0                                 | 0                                             |
| Bankzinsen                                                                              |    | 1,383                                     | 15,126                            | 6,376                                         |
| Gezahlte Dividenden auf CFD, netto                                                      |    | 0                                         | 0                                 | 0                                             |
| Sonstige Aufwendungen                                                                   |    | 0                                         | 2,579                             | 2,796                                         |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>                                                           |    | <b>35,393</b>                             | <b>837,516</b>                    | <b>521,849</b>                                |
| <b>Nettoertrag/(-verlust) aus Wertpapieren</b>                                          |    | <b>(25,981)</b>                           | <b>4,027,050</b>                  | <b>659,905</b>                                |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Wertpapieren                    | 2b | 442,849                                   | 10,557,079                        | 5,122,919                                     |
| Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Optionen                                      | 2e | (31,457)                                  | (1,476,135)                       | (543,426)                                     |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften                         | 2f | 2,116                                     | 60,972                            | (187,478)                                     |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures                                         | 2e | 86,287                                    | 2,720,191                         | 2,391,080                                     |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus CFD                                             | 2g | 0                                         | 0                                 | 0                                             |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen                                         |    | (34,394)                                  | (754,083)                         | (491,057)                                     |
| <b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>                                              |    | <b>439,420</b>                            | <b>15,135,074</b>                 | <b>6,951,943</b>                              |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren            | 2a | 400,728                                   | (1,910,532)                       | 1,135,920                                     |
| Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Optionen          | 2e | (4,743)                                   | (558,184)                         | (76,807)                                      |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften | 2e | (20,751)                                  | (1,405,584)                       | (421,407)                                     |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Futures                 | 2e | (4,531)                                   | 613,087                           | (326,032)                                     |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus CFD                     | 2g | 0                                         | 0                                 | 0                                             |
| <b>Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>            |    | <b>810,123</b>                            | <b>11,873,861</b>                 | <b>7,263,617</b>                              |
| <b>Entwicklung des Kapitals</b>                                                         |    |                                           |                                   |                                               |
| Zeichnung von Anteilen                                                                  |    | 235,712                                   | 66,259,425                        | 13,756,428                                    |
| Rücknahme von Anteilen                                                                  |    | (106,438)                                 | (8,910,611)                       | (2,792,612)                                   |
| Ausgeschüttete Dividenden                                                               | 7  | 0                                         | (2,939,532)                       | (6,647)                                       |
| <b>Nettovermögen zum Ende der Periode</b>                                               |    | <b>8,021,304</b>                          | <b>493,504,122</b>                | <b>141,465,994</b>                            |



# Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für die Periode vom 1. Januar 2026 bis zum 30. Juni 2026

|                                                                                         |    | Kombiniert           |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|----|----------------------|
|                                                                                         |    | EUR                  |
| <b>Nettovermögen zu Beginn der Periode</b>                                              |    | <b>992,598,690</b>   |
| <b>Erträge</b>                                                                          |    |                      |
| Dividenden, netto                                                                       | 2l | 1,385,509            |
| Zinsen auf Anleihen und Geldmarktinstrumente, netto                                     |    | 5,160,200            |
| Erhaltene Zinsen aus CFD                                                                |    | 135,524              |
| Bankzinsen                                                                              |    | 572,499              |
| Erhaltene Dividenden aus CFD                                                            |    | 661,421              |
| Sonstige Erträge                                                                        |    | 399                  |
| <b>Erträge insgesamt</b>                                                                |    | <b>7,915,552</b>     |
| <b>Aufwendungen</b>                                                                     |    |                      |
| Verwaltungsgebühren                                                                     | 3  | 1,474,147            |
| Performancegebühren                                                                     | 5  | 833,618              |
| Betriebs- und Verwaltungskosten                                                         | 4  | 487,804              |
| Zeichnungssteuer                                                                        | 6  | 59,910               |
| Transaktionskosten                                                                      | 2k | 392,493              |
| Gezahlte Zinsen auf CFD                                                                 |    | 807,789              |
| Bankzinsen                                                                              |    | 57,106               |
| Gezahlte Dividenden auf CFD, netto                                                      |    | 616,167              |
| Sonstige Aufwendungen                                                                   |    | 17,981               |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>                                                           |    | <b>4,747,015</b>     |
| <b>Nettoertrag/(-verlust) aus Wertpapieren</b>                                          |    | <b>3,168,537</b>     |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Wertpapieren                    | 2b | 29,982,968           |
| Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Optionen                                      | 2e | (3,752,085)          |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften                         | 2f | (9,097)              |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures                                         | 2e | 8,945,195            |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus CFD                                             | 2g | 2,908,571            |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen                                         |    | (1,220,155)          |
| <b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>                                              |    | <b>40,023,934</b>    |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren            | 2a | 14,663,812           |
| Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Optionen          | 2e | (1,021,136)          |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften | 2e | (2,831,617)          |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Futures                 | 2e | 117,199              |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus CFD                     | 2g | (297,334)            |
| <b>Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>            |    | <b>50,654,858</b>    |
| <b>Entwicklung des Kapitals</b>                                                         |    |                      |
| Zeichnung von Anteilen                                                                  |    | 116,869,886          |
| Rücknahme von Anteilen                                                                  |    | (50,558,228)         |
| Ausgeschüttete Dividenden                                                               | 7  | (2,958,836)          |
| <b>Nettovermögen zum Ende der Periode</b>                                               |    | <b>1,106,606,370</b> |



## Statistiken

### Candriam L Alternative Multi-Strategies

| Name                           | ISIN         | Anteilsart     | Währung    | Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile | Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2026 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2025 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2024 |
|--------------------------------|--------------|----------------|------------|-------------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
| <b>Nettovermögen insgesamt</b> |              |                | <b>EUR</b> |                                           | <b>65,932,132</b>                          | <b>42,233,527</b>                          | <b>41,469,798</b>                          |
| C                              | LU1797471627 | Capitalisation | EUR        | 7.00                                      | 183.12                                     | 172.66                                     | 171.87                                     |
| I                              | LU1797471890 | Capitalisation | EUR        | 1,603.22                                  | 1,934.87                                   | 1,818.42                                   | 1,793.98                                   |
| PI                             | LU1797472195 | Capitalisation | EUR        | 8,827.74                                  | 1,878.74                                   | 1,762.84                                   | 1,734.32                                   |
| R                              | LU1797472278 | Capitalisation | EUR        | 7.00                                      | 192.72                                     | 181.18                                     | 178.93                                     |
| S                              | LU1797472351 | Capitalisation | EUR        | 0.33                                      | 2,156.18                                   | 1,991.21                                   | 1,946.76                                   |
| Z                              | LU1797472435 | Capitalisation | EUR        | 8,141.58                                  | 2,011.94                                   | 1,885.00                                   | 1,847.12                                   |
| ZB                             | LU3218668088 | Capitalisation | EUR        | 1,838.75                                  | 16,240.05                                  | 15,215.88                                  | -                                          |

### Candriam L Balanced Asset Allocation

| Name                           | ISIN         | Anteilsart     | Währung    | Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile | Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2026 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2025 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2024 |
|--------------------------------|--------------|----------------|------------|-------------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
| <b>Nettovermögen insgesamt</b> |              |                | <b>EUR</b> |                                           | <b>204,232,015</b>                         | <b>202,457,733</b>                         | <b>183,031,970</b>                         |
| C                              | LU0982874694 | Capitalisation | EUR        | 17,120.06                                 | 215.96                                     | 199.85                                     | 187.16                                     |
| C                              | LU0982874777 | Distribution   | EUR        | 455.00                                    | 212.27                                     | 200.54                                     | 192.66                                     |
| I                              | LU0982874850 | Capitalisation | EUR        | 68,150.03                                 | 2,936.68                                   | 2,705.34                                   | 2,510.51                                   |
| I                              | LU1207304871 | Distribution   | EUR        | 59.78                                     | 2,073.92                                   | 1,949.04                                   | 1,853.40                                   |
| R2                             | LU1427870321 | Capitalisation | EUR        | 7.00                                      | 241.58                                     | 222.53                                     | 206.36                                     |
| R2                             | LU1427870594 | Distribution   | EUR        | 831.02                                    | 208.25                                     | 195.68                                     | 186.02                                     |
| V                              | LU0982874934 | Capitalisation | EUR        | 1.00                                      | 2,432.93                                   | 2,239.50                                   | 2,075.13                                   |
| Z                              | LU0982875071 | Capitalisation | EUR        | 1.00                                      | 2,412.20                                   | 2,217.22                                   | 2,048.31                                   |

### Candriam L Conservative Asset Allocation

| Name                           | ISIN         | Anteilsart     | Währung    | Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile | Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2026 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2025 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2024 |
|--------------------------------|--------------|----------------|------------|-------------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
| <b>Nettovermögen insgesamt</b> |              |                | <b>EUR</b> |                                           | <b>193,450,803</b>                         | <b>190,359,336</b>                         | <b>184,026,109</b>                         |
| C                              | LU0982875154 | Capitalisation | EUR        | 7,333.63                                  | 197.60                                     | 188.23                                     | 177.82                                     |
| I                              | LU0982875311 | Capitalisation | EUR        | 79,115.81                                 | 2,423.98                                   | 2,298.81                                   | 2,152.09                                   |
| I                              | LU1207304798 | Distribution   | EUR        | 119.66                                    | 1,846.61                                   | 1,792.03                                   | 1,722.40                                   |
| R2                             | LU1427870164 | Capitalisation | EUR        | 7.00                                      | 206.67                                     | 195.90                                     | 183.24                                     |
| R2                             | LU1427870248 | Distribution   | EUR        | -                                         | -                                          | -                                          | 166.46                                     |
| V                              | LU0982875402 | Capitalisation | EUR        | 1.00                                      | 2,090.54                                   | 1,980.54                                   | 1,850.37                                   |
| Z                              | LU0982875584 | Capitalisation | EUR        | 1.00                                      | 2,133.98                                   | 2,019.53                                   | 1,882.74                                   |

### Candriam L Dynamic Asset Allocation

| Name                           | ISIN         | Anteilsart     | Währung    | Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile | Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2026 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2025 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2024 |
|--------------------------------|--------------|----------------|------------|-------------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
| <b>Nettovermögen insgesamt</b> |              |                | <b>EUR</b> |                                           | <b>8,021,304</b>                           | <b>7,081,907</b>                           | <b>9,097,680</b>                           |
| C                              | LU0982876806 | Capitalisation | EUR        | 9,051.18                                  | 326.96                                     | 294.22                                     | 269.34                                     |
| I                              | LU0982877101 | Capitalisation | EUR        | 1,370.08                                  | 3,689.27                                   | 3,304.50                                   | 2,996.87                                   |
| R                              | LU1427870677 | Capitalisation | EUR        | 10.00                                     | 220.05                                     | 197.33                                     | 179.36                                     |
| V                              | LU0982877283 | Capitalisation | EUR        | 1.00                                      | 2,229.55                                   | 1,995.34                                   | 1,806.93                                   |
| Z                              | LU0982877366 | Capitalisation | EUR        | 1.00                                      | 2,894.03                                   | 2,585.66                                   | 2,332.83                                   |

### Candriam L Multi-Asset Income

| Name                           | ISIN         | Anteilsart     | Währung    | Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile | Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2026 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2025 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2024 |
|--------------------------------|--------------|----------------|------------|-------------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
| <b>Nettovermögen insgesamt</b> |              |                | <b>EUR</b> |                                           | <b>493,504,122</b>                         | <b>427,220,979</b>                         | <b>403,543,842</b>                         |
| C                              | LU0982876392 | Capitalisation | EUR        | 18,627.39                                 | 167.11                                     | 163.54                                     | 156.86                                     |
| C                              | LU0982876475 | Distribution   | EUR        | 9,859.86                                  | 153.12                                     | 151.36                                     | 146.73                                     |
| C (q)                          | LU1236612575 | Distribution   | EUR        | 73.32                                     | 155.43                                     | 152.86                                     | 148.07                                     |
| I                              | LU0982876558 | Capitalisation | EUR        | 2,948.11                                  | 1,977.97                                   | 1,931.21                                   | 1,842.09                                   |
| R                              | LU1427871139 | Capitalisation | EUR        | 10.00                                     | 176.77                                     | 172.57                                     | 164.67                                     |
| R2                             | LU1427871303 | Capitalisation | EUR        | 2,545.00                                  | 182.32                                     | 177.71                                     | 169.05                                     |
| R2                             | LU1427871485 | Distribution   | EUR        | 501,063.92                                | 164.95                                     | 162.30                                     | 155.88                                     |
| V                              | LU0982876632 | Capitalisation | EUR        | 7.39                                      | 1,780.04                                   | 1,737.99                                   | 1,656.69                                   |
| V (q)                          | LU1207305092 | Distribution   | EUR        | 1.00                                      | 1,626.68                                   | 1,595.52                                   | 1,534.77                                   |
| VB                             | LU2895711245 | Distribution   | EUR        | 154,751.87                                | 1,607.70                                   | 1,580.24                                   | 1,500.26                                   |
| Z                              | LU0982876715 | Capitalisation | EUR        | 6,040.35                                  | 1,890.32                                   | 1,839.06                                   | 1,742.86                                   |



## Statistiken

### Candriam L Multi-Asset Income (Fortsetzung)

| Name  | ISIN         | Anteilsart     | Währung | Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile | Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2026 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2025 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2024 |
|-------|--------------|----------------|---------|-------------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
| Z (q) | LU1207305175 | Distribution   | EUR     | 1.00                                      | 1,717.74                                   | 1,679.91                                   | 1,607.77                                   |
| ZB    | LU3218667783 | Capitalisation | EUR     | 8,988.58                                  | 15,540.99                                  | 15,119.57                                  | -                                          |

### Candriam L Multi-Asset Income & Growth

| Name                           | ISIN         | Anteilsart     | Währung    | Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile | Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2026 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2025 | Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2024 |
|--------------------------------|--------------|----------------|------------|-------------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
| <b>Nettovermögen insgesamt</b> |              |                | <b>EUR</b> |                                           | <b>141,465,994</b>                         | <b>123,245,208</b>                         | <b>126,499,774</b>                         |
| C                              | LU1207305258 | Capitalisation | EUR        | 139,389.37                                | 207.36                                     | 196.85                                     | 183.95                                     |
| C                              | LU1236612658 | Distribution   | EUR        | 360.48                                    | 151.56                                     | 147.33                                     | 141.30                                     |
| C (q)                          | LU1207305332 | Distribution   | EUR        | 1,141.52                                  | 161.43                                     | 155.12                                     | 148.61                                     |
| I                              | LU1207305415 | Capitalisation | EUR        | 472.84                                    | 2,239.07                                   | 2,127.51                                   | 1,976.51                                   |
| I (q)                          | LU1207305506 | Distribution   | EUR        | 1.00                                      | 1,657.95                                   | 1,594.93                                   | 1,517.89                                   |
| R                              | LU1427871725 | Capitalisation | EUR        | 10.00                                     | 191.13                                     | 180.89                                     | 168.03                                     |
| R2                             | LU1427872293 | Distribution   | EUR        | 655.00                                    | 174.23                                     | 168.52                                     | 159.95                                     |
| V                              | LU1207305688 | Capitalisation | EUR        | 10,667.50                                 | 2,148.14                                   | 2,039.49                                   | 1,891.72                                   |
| Z                              | LU1207305845 | Capitalisation | EUR        | 3,579.28                                  | 2,320.70                                   | 2,188.39                                   | 2,017.53                                   |
| Z (q)                          | LU1207305928 | Distribution   | EUR        | 1.00                                      | 1,775.06                                   | 1,694.83                                   | 1,601.67                                   |
| ZB                             | LU3218667940 | Distribution   | EUR        | 4,975.08                                  | 16,064.80                                  | 15,148.94                                  | -                                          |



## Candriam L Alternative Multi-Strategies

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                                                                                                                                         | Anzahl | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV    |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------|--------------------|-------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden</b> |        |         |                    |             |
| <b>Anteile</b>                                                                                                                                      |        |         |                    |             |
| <b>Österreich</b>                                                                                                                                   |        |         |                    |             |
| KONTRON AG                                                                                                                                          | 40,891 | EUR     | 949,489            | 1.44        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>949,489</b>     | <b>1.44</b> |
| <b>Frankreich</b>                                                                                                                                   |        |         |                    |             |
| FNAC DARTY SA                                                                                                                                       | 34,953 | EUR     | 1,205,879          | 1.83        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>1,205,879</b>   | <b>1.83</b> |
| <b>Deutschland</b>                                                                                                                                  |        |         |                    |             |
| CECONOMY AG NEW                                                                                                                                     | 91,929 | EUR     | 380,586            | 0.58        |
| HUGO BOSS AG                                                                                                                                        | 24,928 | EUR     | 936,545            | 1.42        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>1,317,131</b>   | <b>2.00</b> |
| <b>Irland</b>                                                                                                                                       |        |         |                    |             |
| ACCENTURE - SHS CLASS A                                                                                                                             | 29     | USD     | 3,156              | 0.00        |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC                                                                                                                            | 33     | USD     | 6,955              | 0.01        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>10,111</b>      | <b>0.02</b> |
| <b>Luxemburg</b>                                                                                                                                    |        |         |                    |             |
| INPOST SA                                                                                                                                           | 62,331 | EUR     | 960,521            | 1.46        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>960,521</b>     | <b>1.46</b> |
| <b>Niederlande</b>                                                                                                                                  |        |         |                    |             |
| OCI REG.SHS                                                                                                                                         | 24,571 | EUR     | 99,021             | 0.15        |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP N.V.                                                                                                                          | 15,784 | EUR     | 289,321            | 0.44        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>388,342</b>     | <b>0.59</b> |
| <b>Singapur</b>                                                                                                                                     |        |         |                    |             |
| FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD                                                                                                                       | 131    | USD     | 18,570             | 0.03        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>18,570</b>      | <b>0.03</b> |
| <b>Spanien</b>                                                                                                                                      |        |         |                    |             |
| AEDAS HOMES SA                                                                                                                                      | 18,935 | EUR     | 437,399            | 0.66        |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI S.A.                                                                                                                       | 12,500 | EUR     | 191,750            | 0.29        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>629,149</b>     | <b>0.95</b> |
| <b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>                                                                                                               |        |         |                    |             |
| 10X GENOMICS - REGS- A                                                                                                                              | 4,058  | USD     | 136,083            | 0.21        |
| ABBOTT LABORATORIES                                                                                                                                 | 327    | USD     | 25,953             | 0.04        |
| ADVANCED MICRO DEVICES INC                                                                                                                          | 327    | USD     | 166,148            | 0.25        |
| AGILON HEALTH INC                                                                                                                                   | 1,309  | USD     | 122,714            | 0.19        |
| AGNC INVESTMENT CORP                                                                                                                                | 546    | USD     | 5,205              | 0.01        |
| ALPHABET INC -A-                                                                                                                                    | 56     | USD     | 17,504             | 0.03        |
| APPLIED MATERIALS INC                                                                                                                               | 217    | USD     | 137,226            | 0.21        |
| ASTERA LABS INC                                                                                                                                     | 36     | USD     | 15,209             | 0.02        |
| AT&T INC                                                                                                                                            | 2,414  | USD     | 43,707             | 0.07        |
| ATMOS ENERGY CORP                                                                                                                                   | 229    | USD     | 34,505             | 0.05        |
| AUTOZONE INC                                                                                                                                        | 13     | USD     | 36,340             | 0.06        |
| BOSTON SCIENTIF CORP                                                                                                                                | 462    | USD     | 17,247             | 0.03        |
| BRIGHTHOUSE - REGISTERED                                                                                                                            | 5,240  | USD     | 290,118            | 0.44        |
| CATALYST PHARMACEUTICALS INC                                                                                                                        | 16,416 | USD     | 451,286            | 0.68        |
| CIENA CORP                                                                                                                                          | 315    | USD     | 135,158            | 0.20        |
| CME GROUP -A-                                                                                                                                       | 258    | USD     | 49,833             | 0.08        |
| COMCAST CORP                                                                                                                                        | 1,071  | USD     | 22,998             | 0.03        |
| CORNING INC                                                                                                                                         | 590    | USD     | 131,815            | 0.20        |
| DELL TECHNOLOGIES PREFERENTIAL SHARE                                                                                                                | 364    | USD     | 137,367            | 0.21        |
| ELI LILLY & CO                                                                                                                                      | 155    | USD     | 162,610            | 0.25        |
| EXPAND ENERGY CORP                                                                                                                                  | 338    | USD     | 26,959             | 0.04        |
| EXXON MOBIL CORP                                                                                                                                    | 302    | USD     | 36,114             | 0.05        |
| GLOBALFOUNDRIES INC                                                                                                                                 | 1,861  | USD     | 134,142            | 0.20        |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC                                                                                                                             | 148    | USD     | 130,922            | 0.20        |
| GUARDANT HEALTH --- REGISTERED SHS                                                                                                                  | 981    | USD     | 128,732            | 0.20        |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE                                                                                                                        | 115    | USD     | 28,153             | 0.04        |
| INTEL CORP                                                                                                                                          | 1,256  | USD     | 153,394            | 0.23        |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



## Candriam L Alternative Multi-Strategies

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                                       | Anzahl    | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV     |
|---------------------------------------------------|-----------|---------|--------------------|--------------|
| JOHNSON & JOHNSON                                 | 229       | USD     | 50,870             | 0.08         |
| LAM RESEARCH CORP                                 | 367       | USD     | 139,099            | 0.21         |
| LAS VEGAS SANDS CORP                              | 417       | USD     | 16,847             | 0.03         |
| LATTICE SEMICONDUCTOR CORP                        | 1,027     | USD     | 137,400            | 0.21         |
| LUMENTUM HOLDINGS INC                             | 177       | USD     | 132,841            | 0.20         |
| MARAVAI LIFESCIENCES HOLDINGS INC -SH             | 23,595    | USD     | 128,779            | 0.20         |
| MARVELL TECH --- REGISTERED SHS                   | 543       | USD     | 141,480            | 0.21         |
| MCDONALD'S CORP                                   | 119       | USD     | 28,135             | 0.04         |
| META PLATFORMS INC A                              | 22        | USD     | 10,839             | 0.02         |
| MICRON TECHNOLOGY INC                             | 177       | USD     | 178,701            | 0.27         |
| MKS INC                                           | 362       | USD     | 140,836            | 0.21         |
| NETFLIX INC                                       | 122       | USD     | 7,619              | 0.01         |
| NUVALENT INC-A SHARES                             | 5,832     | USD     | 629,976            | 0.96         |
| OPENDOOR TECH --- REGISTERED SHS                  | 32,776    | USD     | 132,446            | 0.20         |
| PENUMBRA INC                                      | 203       | USD     | 56,063             | 0.09         |
| REGENERON PHARMACEUTICALS INC                     | 44        | USD     | 23,997             | 0.04         |
| ROLLINS                                           | 462       | USD     | 16,867             | 0.03         |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A                          | 346       | USD     | 16,969             | 0.03         |
| SANDISK CORP                                      | 13        | USD     | 25,854             | 0.04         |
| SPHERE ENTERTAINMENT CO                           | 875       | USD     | 132,425            | 0.20         |
| TERADYNE INC                                      | 325       | USD     | 137,539            | 0.21         |
| VERSANT MEDIA GROUP INC                           | 1,283     | USD     | 40,410             | 0.06         |
| VIASAT INC                                        | 1,966     | USD     | 154,436            | 0.23         |
| VICTORIA'S SECRET & CO                            | 1,744     | USD     | 127,341            | 0.19         |
| WARNER BROS DISCOVERY INC                         | 268       | USD     | 6,249              | 0.01         |
| WEBSTER FINANCIAL CORP                            | 457       | USD     | 30,547             | 0.05         |
| WESTERN DIGITAL CORP                              | 297       | USD     | 165,923            | 0.25         |
| ZOETIS INC -A-                                    | 432       | USD     | 27,153             | 0.04         |
|                                                   |           |         | <b>5,615,083</b>   | <b>8.52</b>  |
| <b>Aktien gesamt</b>                              |           |         | <b>11,094,275</b>  | <b>16.83</b> |
| <b>Anleihen</b>                                   |           |         |                    |              |
| <b>Belgien</b>                                    |           |         |                    |              |
| BELGIUM TREASURY BILL ZCP 10-12-26                | 2,000,000 | EUR     | 1,964,031          | 2.98         |
| BELGIUM TREASURY BILL ZCP 15-10-26                | 4,500,000 | EUR     | 4,465,403          | 6.77         |
| EUROPEAN UNION BILL ZCP 04-09-26                  | 2,100,000 | EUR     | 2,088,150          | 3.17         |
| EUROPEAN UNION BILL ZCP 07-08-26                  | 5,000,000 | EUR     | 4,952,976          | 7.51         |
|                                                   |           |         | <b>13,470,560</b>  | <b>20.43</b> |
| <b>Finnland</b>                                   |           |         |                    |              |
| FINLAND TBILL ZCP 13-08-26                        | 3,500,000 | EUR     | 3,467,807          | 5.26         |
| FINLAND TBILL ZCP 13-11-26                        | 5,000,000 | EUR     | 4,933,438          | 7.48         |
|                                                   |           |         | <b>8,401,245</b>   | <b>12.74</b> |
| <b>Frankreich</b>                                 |           |         |                    |              |
| FRANCE TREASURY BILL BTF ZCP 29-07-26             | 1,500,000 | EUR     | 1,485,111          | 2.25         |
|                                                   |           |         | <b>1,485,111</b>   | <b>2.25</b>  |
| <b>Italien</b>                                    |           |         |                    |              |
| ITALY BUONI ORDINARI DEL TESORO BOT ZCP 14-07-26  | 2,900,000 | EUR     | 2,892,147          | 4.39         |
|                                                   |           |         | <b>2,892,147</b>   | <b>4.39</b>  |
| <b>Luxemburg</b>                                  |           |         |                    |              |
| EUROPEAN STABILITY MECHANISM TREAS BILL ZCP 09-07 | 3,500,000 | EUR     | 3,487,457          | 5.29         |
| EUROPEAN STABILITY MECHANISM TREAS BILL ZCP 23-07 | 1,000,000 | EUR     | 989,811            | 1.50         |
|                                                   |           |         | <b>4,477,268</b>   | <b>6.79</b>  |
| <b>Portugal</b>                                   |           |         |                    |              |
| PORTUGAL TREASURY BILL ZCP 17-07-26               | 3,000,000 | EUR     | 2,987,863          | 4.53         |
|                                                   |           |         | <b>2,987,863</b>   | <b>4.53</b>  |
| <b>Anleihen gesamt</b>                            |           |         | <b>33,714,194</b>  | <b>51.13</b> |
| <b>Optionsscheine</b>                             |           |         |                    |              |
| <b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>             |           |         |                    |              |
| OPENDOOR TECHNOLOGIES (OPENDOOR TECHNOLOGIES INC) | 510       | USD     | 221                | 0.00         |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



## Candriam L Alternative Multi-Strategies

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                                                                                                                                                | Anzahl | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV     |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------|--------------------|--------------|
| OPENDOOR TECHNOLOGIES (OPENDOOR TECHNOLOGIES INC)                                                                                                          | 510    | USD     | 126                | 0.00         |
| OPENDOOR TECHNOLOGIES (OPENDOOR TECHNOLOGIES INC)                                                                                                          | 510    | USD     | 107                | 0.00         |
|                                                                                                                                                            |        |         | <b>454</b>         | <b>0.00</b>  |
| <b>Optionsscheine gesamt</b>                                                                                                                               |        |         | <b>454</b>         | <b>0.00</b>  |
| <b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt</b> |        |         | <b>44,808,923</b>  | <b>67.96</b> |
| <b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>                                                                                                                   |        |         |                    |              |
| <b>Anteile/Einheiten an Anlagefonds</b>                                                                                                                    |        |         |                    |              |
| <b>Frankreich</b>                                                                                                                                          |        |         |                    |              |
| CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV Z C                                                                                                                               | 1,100  | EUR     | 1,815,770          | 2.75         |
|                                                                                                                                                            |        |         | <b>1,815,770</b>   | <b>2.75</b>  |
| <b>Luxemburg</b>                                                                                                                                           |        |         |                    |              |
| CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQUITY MARKET NEUTRAL Z C                                                                                                         | 1,096  | EUR     | 2,389,960          | 3.62         |
| CANDRIAM BONDS EMERGING MARKETS CORPORATE Z C                                                                                                              | 1      | USD     | 1,573              | 0.00         |
| CANDRIAM EQUITIES L RISK ARBITRAGE OPPORTUNITIES Z C                                                                                                       | 700    | EUR     | 1,137,269          | 1.72         |
|                                                                                                                                                            |        |         | <b>3,528,802</b>   | <b>5.35</b>  |
| <b>Aktien/Anteile in Anlagefonds gesamt</b>                                                                                                                |        |         | <b>5,344,572</b>   | <b>8.11</b>  |
| <b>Organismen für gemeinsame Anlagen gesamt</b>                                                                                                            |        |         | <b>5,344,572</b>   | <b>8.11</b>  |
| <b>Anlageportfolio gesamt</b>                                                                                                                              |        |         | <b>50,153,495</b>  | <b>76.07</b> |
| Erwerbskosten                                                                                                                                              |        |         | 48,725,962         |              |



## Candriam L Alternative Multi-Strategies

### Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2026

#### Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

|                                |              |
|--------------------------------|--------------|
| Belgien                        | 20.43        |
| Luxemburg                      | 13.60        |
| Finnland                       | 12.74        |
| Vereinigte Staaten von Amerika | 8.52         |
| Frankreich                     | 6.84         |
| Portugal                       | 4.53         |
| Italien                        | 4.39         |
| Deutschland                    | 2.00         |
| Österreich                     | 1.44         |
| Spanien                        | 0.95         |
| Niederlande                    | 0.59         |
| Singapur                       | 0.03         |
| Irland                         | 0.02         |
|                                | <b>76.07</b> |

#### Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

|                                               |              |
|-----------------------------------------------|--------------|
| Anleihen von Staaten, Provinzen und Gemeinden | 33.66        |
| Supranationale Organisationen                 | 17.47        |
| Anlagefonds                                   | 8.11         |
| Elektronik und Halbleiter                     | 2.07         |
| Sonstige Dienstleistungen                     | 1.83         |
| Büroausstattung und Computer                  | 1.69         |
| Textilien und Bekleidung                      | 1.61         |
| Banken und andere Finanzinstitute             | 1.59         |
| Transport                                     | 1.46         |
| Pharmazeutika                                 | 1.43         |
| Biotechnologie                                | 1.39         |
| Kommunikation                                 | 0.71         |
| Baumaterialien                                | 0.66         |
| Einzelhandel und Warenhäuser                  | 0.63         |
| Versicherungen                                | 0.44         |
| Immobilien                                    | 0.30         |
| Hotels und Restaurants                        | 0.27         |
| Gesundheitswesen                              | 0.19         |
| Chemikalien                                   | 0.15         |
| Grafik und Verlage                            | 0.10         |
| Erdöl                                         | 0.10         |
| Internet und Internet-Dienste                 | 0.05         |
| Versorger                                     | 0.05         |
| Maschinen- und Apparatebau                    | 0.04         |
| Elektrotechnik                                | 0.03         |
| Umweltdienste und Recycling                   | 0.03         |
|                                               | <b>76.07</b> |



## Candriam L Balanced Asset Allocation

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                                                                                                                                         | Anzahl | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV    |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------|--------------------|-------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden</b> |        |         |                    |             |
| <b>Strukturierte Produkte</b>                                                                                                                       |        |         |                    |             |
| <b>Irland</b>                                                                                                                                       |        |         |                    |             |
| ISHARES PHYSICAL METALS PLC - GOLD                                                                                                                  | 61,285 | USD     | 4,190,998          | 2.05        |
| ISHS PHY MET (COMDTY SILVER)                                                                                                                        | 35,952 | USD     | 1,788,088          | 0.88        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>5,979,086</b>   | <b>2.93</b> |
| <b>Strukturierte Produkte, insgesamt</b>                                                                                                            |        |         | <b>5,979,086</b>   | <b>2.93</b> |
| <b>Anteile</b>                                                                                                                                      |        |         |                    |             |
| <b>Kaimaninseln</b>                                                                                                                                 |        |         |                    |             |
| VNET GROUP INC-ADR                                                                                                                                  | 50,934 | USD     | 358,182            | 0.18        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>358,182</b>     | <b>0.18</b> |
| <b>Frankreich</b>                                                                                                                                   |        |         |                    |             |
| CIE DE SAINT-GOBAIN                                                                                                                                 | 5,629  | EUR     | 445,592            | 0.22        |
| LEGRAND SA                                                                                                                                          | 3,526  | EUR     | 520,790            | 0.25        |
| SAFRAN SA                                                                                                                                           | 1,370  | EUR     | 472,650            | 0.23        |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE                                                                                                                               | 1,941  | EUR     | 553,961            | 0.27        |
| VINCI SA                                                                                                                                            | 4,224  | EUR     | 539,827            | 0.26        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>2,532,820</b>   | <b>1.24</b> |
| <b>Deutschland</b>                                                                                                                                  |        |         |                    |             |
| SIEMENS AG PREFERENTIAL SHARE                                                                                                                       | 2,231  | EUR     | 627,246            | 0.31        |
| SIEMENS ENERGY - REG SHS                                                                                                                            | 4,018  | EUR     | 666,184            | 0.33        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>1,293,430</b>   | <b>0.63</b> |
| <b>Hongkong</b>                                                                                                                                     |        |         |                    |             |
| HUA HONG GRACE SEMICONDUCTOR                                                                                                                        | 34,536 | HKD     | 828,944            | 0.41        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>828,944</b>     | <b>0.41</b> |
| <b>Italien</b>                                                                                                                                      |        |         |                    |             |
| LEONARDO SPA                                                                                                                                        | 4,411  | EUR     | 206,986            | 0.10        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>206,986</b>     | <b>0.10</b> |
| <b>Niederlande</b>                                                                                                                                  |        |         |                    |             |
| AIRBUS SE                                                                                                                                           | 2,340  | EUR     | 455,224            | 0.22        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>455,224</b>     | <b>0.22</b> |
| <b>Norwegen</b>                                                                                                                                     |        |         |                    |             |
| KONGSBERG GRUPPEN ASA                                                                                                                               | 16,214 | NOK     | 427,510            | 0.21        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>427,510</b>     | <b>0.21</b> |
| <b>Volksrepublik China</b>                                                                                                                          |        |         |                    |             |
| ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR                                                                                                                        | 1,744  | USD     | 146,409            | 0.07        |
| BYD COMPANY LTD -H-                                                                                                                                 | 36,439 | HKD     | 294,453            | 0.14        |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOL                                                                                                                        | 5,672  | HKD     | 444,104            | 0.22        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>884,966</b>     | <b>0.43</b> |
| <b>Schweden</b>                                                                                                                                     |        |         |                    |             |
| SAAB AB                                                                                                                                             | 9,943  | SEK     | 451,816            | 0.22        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>451,816</b>     | <b>0.22</b> |
| <b>Großbritannien</b>                                                                                                                               |        |         |                    |             |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC                                                                                                                            | 29,733 | GBP     | 498,634            | 0.24        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>498,634</b>     | <b>0.24</b> |
| <b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>                                                                                                               |        |         |                    |             |
| ALPHABET INC -A-                                                                                                                                    | 806    | USD     | 251,938            | 0.12        |
| AMAZON.COM INC                                                                                                                                      | 3,134  | USD     | 653,335            | 0.32        |
| BROADCOM INC - REGISTERED SHS                                                                                                                       | 733    | USD     | 242,186            | 0.12        |
| GE VERNOVA LLC                                                                                                                                      | 526    | USD     | 540,520            | 0.26        |
| GS ACQN HLDG - REGISTERED SHS -A-                                                                                                                   | 2,038  | USD     | 596,836            | 0.29        |
| MICROSOFT CORP                                                                                                                                      | 2,005  | USD     | 654,163            | 0.32        |
| NVIDIA CORP                                                                                                                                         | 3,325  | USD     | 581,911            | 0.28        |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR CO ADR (REPR 5 SHS)                                                                                                            | 720    | USD     | 300,753            | 0.15        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>3,821,642</b>   | <b>1.87</b> |
| <b>Aktien gesamt</b>                                                                                                                                |        |         | <b>11,760,154</b>  | <b>5.76</b> |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



## Candriam L Balanced Asset Allocation

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                                                                                                                                                | Anzahl  | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV     |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|---------|--------------------|--------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt</b> |         |         | <b>17,739,240</b>  | <b>8.69</b>  |
| <b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>                                                                                                                   |         |         |                    |              |
| <b>Anteile/Einheiten an Anlagefonds</b>                                                                                                                    |         |         |                    |              |
| <b>Frankreich</b>                                                                                                                                          |         |         |                    |              |
| CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z C                                                                                                                           | 1,451   | EUR     | 2,127,483          | 1.04         |
| Ofi Invest Energy Strategic Metals I                                                                                                                       | 18      | EUR     | 961,554            | 0.47         |
|                                                                                                                                                            |         |         | <b>3,089,037</b>   | <b>1.51</b>  |
| <b>Luxemburg</b>                                                                                                                                           |         |         |                    |              |
| CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQUITY MARKET NEUTRAL Z C                                                                                                         | 732     | EUR     | 1,595,758          | 0.78         |
| CANDRIAM BONDS CAPITAL SECURITIES Z C                                                                                                                      | 1,352   | EUR     | 2,781,345          | 1.36         |
| CANDRIAM BONDS CREDIT ALPHA Z C                                                                                                                            | 449     | EUR     | 850,139            | 0.42         |
| CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z C                                                                                                          | 5,302   | USD     | 6,574,161          | 3.22         |
| CANDRIAM BONDS EURO GOVERNMENT Z C                                                                                                                         | 3,737   | EUR     | 9,660,876          | 4.73         |
| CANDRIAM BONDS EURO HIGH YIELD Z C                                                                                                                         | 5,607   | EUR     | 1,687,709          | 0.83         |
| CANDRIAM BONDS EURO SHORT TERM Z C                                                                                                                         | 4,196   | EUR     | 10,170,661         | 4.98         |
| CANDRIAM BONDS GLOBAL HIGH YIELD Z C                                                                                                                       | 1,630   | EUR     | 562,757            | 0.28         |
| CANDRIAM EQUITIES L BIOTECHNOLOGY Z C                                                                                                                      | 722     | USD     | 2,501,136          | 1.22         |
| CANDRIAM EQUITIES L EMERGING MARKETS Z C                                                                                                                   | 6,409   | EUR     | 15,325,882         | 7.50         |
| CANDRIAM EQUITIES L RISK ARBITRAGE OPPORTUNITIES Z C                                                                                                       | 499     | EUR     | 810,257            | 0.40         |
| CANDRIAM EQUITIES L ROBOTICS & INNOVATIVE TECHNOLOGY Z C                                                                                                   | 749     | USD     | 5,654,221          | 2.77         |
| CANDRIAM EQUITIES L US EDGE Z USD C                                                                                                                        | 10,743  | USD     | 18,845,602         | 9.23         |
| CANDRIAM L ALTERNATIVE MULTI-STRATEGIES Z C                                                                                                                | 362     | EUR     | 728,503            | 0.36         |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME & GROWTH Z C                                                                                                                 | 1,411   | EUR     | 3,273,466          | 1.60         |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME Z C                                                                                                                          | 2,329   | EUR     | 4,402,313          | 2.16         |
| CANDRIAM MONEY MARKET USD SUSTAINABLE Z C                                                                                                                  | 1,726   | USD     | 2,026,544          | 0.99         |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EMERGING MARKETS Z C                                                                                                             | 1,497   | USD     | 1,761,440          | 0.86         |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO CORPORATE Z C                                                                                                               | 13,150  | EUR     | 15,022,179         | 7.36         |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO Z C                                                                                                                         | 24,196  | EUR     | 24,739,131         | 12.11        |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY EMERGING MARKETS Z C                                                                                                           | 928     | EUR     | 3,688,464          | 1.81         |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY QUANT EUROPE Z C                                                                                                               | 68      | EUR     | 440,963            | 0.22         |
| CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO Z C                                                                                                                 | 3,559   | EUR     | 4,171,189          | 2.04         |
| CLEOME INDEX EUROPE EQUITIES Z C                                                                                                                           | 860     | EUR     | 2,929,260          | 1.43         |
| CLEOME INDEX USA EQUITIES Z C                                                                                                                              | 4,975   | USD     | 26,353,828         | 12.90        |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE CORPORATE EURO BOND UCITS ETF D                                                                                                | 205,840 | EUR     | 4,923,693          | 2.41         |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE EUROPE EQUITY UCITS ETF C                                                                                                      | 8,470   | EUR     | 423,839            | 0.21         |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE JAPAN EQUITY UCITS ETF C                                                                                                       | 138,478 | EUR     | 6,314,597          | 3.09         |
|                                                                                                                                                            |         |         | <b>178,219,913</b> | <b>87.26</b> |
| <b>Aktien/Anteile in Anlagefonds gesamt</b>                                                                                                                |         |         | <b>181,308,950</b> | <b>88.78</b> |
| <b>Organismen für gemeinsame Anlagen gesamt</b>                                                                                                            |         |         | <b>181,308,950</b> | <b>88.78</b> |
| <b>Anlageportfolio gesamt</b>                                                                                                                              |         |         | <b>199,048,190</b> | <b>97.46</b> |
| Erwerbskosten                                                                                                                                              |         |         | 166,658,476        |              |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.  
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



## Candriam L Balanced Asset Allocation

### Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2026

#### Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

|                                |              |
|--------------------------------|--------------|
| Luxemburg                      | 87.26        |
| Irland                         | 2.93         |
| Frankreich                     | 2.75         |
| Vereinigte Staaten von Amerika | 1.87         |
| Deutschland                    | 0.63         |
| Volksrepublik China            | 0.43         |
| Hongkong                       | 0.41         |
| Großbritannien                 | 0.24         |
| Niederlande                    | 0.22         |
| Schweden                       | 0.22         |
| Norwegen                       | 0.21         |
| Kaimaninseln                   | 0.18         |
| Italien                        | 0.10         |
|                                | <b>97.46</b> |

#### Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

|                                      |              |
|--------------------------------------|--------------|
| Anlagefonds                          | 89.18        |
| Nicht klassifizierbare Institutionen | 2.52         |
| Elektrotechnik                       | 1.10         |
| Elektronik und Halbleiter            | 0.98         |
| Luft- und Raumfahrt                  | 0.90         |
| Internet und Internet-Dienste        | 0.69         |
| Maschinen- und Apparatebau           | 0.54         |
| Büroausstattung und Computer         | 0.51         |
| Baumaterialien                       | 0.48         |
| Einzelhandel und Warenhäuser         | 0.32         |
| Banken und andere Finanzinstitute    | 0.23         |
|                                      | <b>97.46</b> |



## Candriam L Conservative Asset Allocation

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                                                                                                                                         | Anzahl | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV    |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------|--------------------|-------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden</b> |        |         |                    |             |
| <b>Strukturierte Produkte</b>                                                                                                                       |        |         |                    |             |
| <b>Irland</b>                                                                                                                                       |        |         |                    |             |
| ISHARES PHYSICAL METALS PLC - GOLD                                                                                                                  | 59,355 | USD     | 4,059,014          | 2.10        |
| ISHS PHY MET (COMDTY SILVER)                                                                                                                        | 31,623 | USD     | 1,572,783          | 0.81        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>5,631,797</b>   | <b>2.91</b> |
| <b>Strukturierte Produkte, insgesamt</b>                                                                                                            |        |         | <b>5,631,797</b>   | <b>2.91</b> |
| <b>Anteile</b>                                                                                                                                      |        |         |                    |             |
| <b>Kaimaninseln</b>                                                                                                                                 |        |         |                    |             |
| VNET GROUP INC-ADR                                                                                                                                  | 47,694 | USD     | 335,397            | 0.17        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>335,397</b>     | <b>0.17</b> |
| <b>Frankreich</b>                                                                                                                                   |        |         |                    |             |
| CIE DE SAINT-GOBAIN                                                                                                                                 | 5,944  | EUR     | 470,527            | 0.24        |
| LEGRAND SA                                                                                                                                          | 3,684  | EUR     | 544,127            | 0.28        |
| SAFRAN SA                                                                                                                                           | 1,423  | EUR     | 490,935            | 0.25        |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE                                                                                                                               | 2,090  | EUR     | 596,486            | 0.31        |
| VINCI SA                                                                                                                                            | 4,088  | EUR     | 522,446            | 0.27        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>2,624,521</b>   | <b>1.36</b> |
| <b>Deutschland</b>                                                                                                                                  |        |         |                    |             |
| SIEMENS AG PREFERENTIAL SHARE                                                                                                                       | 2,159  | EUR     | 607,003            | 0.31        |
| SIEMENS ENERGY - REG SHS                                                                                                                            | 4,260  | EUR     | 706,308            | 0.37        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>1,313,311</b>   | <b>0.68</b> |
| <b>Hongkong</b>                                                                                                                                     |        |         |                    |             |
| HUA HONG GRACE SEMICONDUCTOR                                                                                                                        | 37,660 | HKD     | 903,927            | 0.47        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>903,927</b>     | <b>0.47</b> |
| <b>Italien</b>                                                                                                                                      |        |         |                    |             |
| LEONARDO SPA                                                                                                                                        | 4,181  | EUR     | 196,193            | 0.10        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>196,193</b>     | <b>0.10</b> |
| <b>Niederlande</b>                                                                                                                                  |        |         |                    |             |
| AIRBUS SE                                                                                                                                           | 2,212  | EUR     | 430,322            | 0.22        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>430,322</b>     | <b>0.22</b> |
| <b>Norwegen</b>                                                                                                                                     |        |         |                    |             |
| KONGSBERG GRUPPEN ASA                                                                                                                               | 14,309 | NOK     | 377,282            | 0.20        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>377,282</b>     | <b>0.20</b> |
| <b>Volksrepublik China</b>                                                                                                                          |        |         |                    |             |
| ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR                                                                                                                        | 1,663  | USD     | 139,609            | 0.07        |
| BYD COMPANY LTD -H-                                                                                                                                 | 34,121 | HKD     | 275,722            | 0.14        |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOL                                                                                                                        | 5,311  | HKD     | 415,838            | 0.21        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>831,169</b>     | <b>0.43</b> |
| <b>Schweden</b>                                                                                                                                     |        |         |                    |             |
| SAAB AB                                                                                                                                             | 8,775  | SEK     | 398,741            | 0.21        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>398,741</b>     | <b>0.21</b> |
| <b>Großbritannien</b>                                                                                                                               |        |         |                    |             |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC                                                                                                                            | 29,532 | GBP     | 495,263            | 0.26        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>495,263</b>     | <b>0.26</b> |
| <b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>                                                                                                               |        |         |                    |             |
| ALPHABET INC -A-                                                                                                                                    | 763    | USD     | 238,497            | 0.12        |
| AMAZON.COM INC                                                                                                                                      | 2,757  | USD     | 574,743            | 0.30        |
| BROADCOM INC - REGISTERED SHS                                                                                                                       | 713    | USD     | 235,577            | 0.12        |
| GE VERNOVA LLC                                                                                                                                      | 470    | USD     | 482,974            | 0.25        |
| GS ACQN HLDG - REGISTERED SHS -A-                                                                                                                   | 1,914  | USD     | 560,523            | 0.29        |
| MICROSOFT CORP                                                                                                                                      | 1,745  | USD     | 569,334            | 0.29        |
| NVIDIA CORP                                                                                                                                         | 3,013  | USD     | 527,308            | 0.27        |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR CO ADR (REPR 5 SHS)                                                                                                            | 675    | USD     | 281,956            | 0.15        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>3,470,912</b>   | <b>1.79</b> |
| <b>Aktien gesamt</b>                                                                                                                                |        |         | <b>11,377,038</b>  | <b>5.88</b> |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.  
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



## Candriam L Conservative Asset Allocation

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                                                                                                                                                | Anzahl  | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV     |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|---------|--------------------|--------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt</b> |         |         | <b>17,008,835</b>  | <b>8.79</b>  |
| <b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>                                                                                                                   |         |         |                    |              |
| <b>Anteile/Einheiten an Anlagefonds</b>                                                                                                                    |         |         |                    |              |
| <b>Frankreich</b>                                                                                                                                          |         |         |                    |              |
| CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z C                                                                                                                           | 2,323   | EUR     | 3,405,982          | 1.76         |
| Ofi Invest Energy Strategic Metals I                                                                                                                       | 17      | EUR     | 899,239            | 0.46         |
|                                                                                                                                                            |         |         | <b>4,305,221</b>   | <b>2.23</b>  |
| <b>Luxemburg</b>                                                                                                                                           |         |         |                    |              |
| CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQUITY MARKET NEUTRAL Z C                                                                                                         | 1,255   | EUR     | 2,735,703          | 1.41         |
| CANDRIAM BONDS CAPITAL SECURITIES Z C                                                                                                                      | 1,392   | EUR     | 2,863,054          | 1.48         |
| CANDRIAM BONDS CREDIT ALPHA Z C                                                                                                                            | 742     | EUR     | 1,403,854          | 0.73         |
| CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z C                                                                                                          | 6,753   | USD     | 8,372,907          | 4.33         |
| CANDRIAM BONDS EURO GOVERNMENT Z C                                                                                                                         | 2,723   | EUR     | 7,039,855          | 3.64         |
| CANDRIAM BONDS EURO HIGH YIELD Z C                                                                                                                         | 9,450   | EUR     | 2,844,486          | 1.47         |
| CANDRIAM BONDS EURO SHORT TERM Z C                                                                                                                         | 1,437   | EUR     | 3,483,084          | 1.80         |
| CANDRIAM BONDS GLOBAL HIGH YIELD Z C                                                                                                                       | 293     | EUR     | 101,081            | 0.05         |
| CANDRIAM EQUITIES L BIOTECHNOLOGY Z C                                                                                                                      | 787     | USD     | 2,726,061          | 1.41         |
| CANDRIAM EQUITIES L EMERGING MARKETS Z C                                                                                                                   | 2,060   | EUR     | 4,926,063          | 2.55         |
| CANDRIAM EQUITIES L RISK ARBITRAGE OPPORTUNITIES Z C                                                                                                       | 823     | EUR     | 1,337,181          | 0.69         |
| CANDRIAM EQUITIES L ROBOTICS & INNOVATIVE TECHNOLOGY Z C                                                                                                   | 447     | USD     | 3,373,163          | 1.74         |
| CANDRIAM EQUITIES L US EDGE Z USD C                                                                                                                        | 7,367   | USD     | 12,923,671         | 6.68         |
| CANDRIAM L ALTERNATIVE MULTI-STRATEGIES Z C                                                                                                                | 665     | EUR     | 1,337,055          | 0.69         |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME & GROWTH Z C                                                                                                                 | 2,143   | EUR     | 4,974,302          | 2.57         |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME Z C                                                                                                                          | 3,674   | EUR     | 6,944,627          | 3.59         |
| CANDRIAM MONEY MARKET USD SUSTAINABLE Z C                                                                                                                  | 2,321   | USD     | 2,725,947          | 1.41         |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EMERGING MARKETS Z C                                                                                                             | 2,163   | USD     | 2,545,316          | 1.32         |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO CORPORATE Z C                                                                                                               | 26,275  | EUR     | 30,016,842         | 15.52        |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO Z C                                                                                                                         | 31,398  | EUR     | 32,103,211         | 16.60        |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY EMERGING MARKETS Z C                                                                                                           | 154     | EUR     | 612,036            | 0.32         |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY QUANT EUROPE Z C                                                                                                               | 244     | EUR     | 1,591,039          | 0.82         |
| CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO Z C                                                                                                                 | 3,345   | EUR     | 3,920,124          | 2.03         |
| CLEOME INDEX EUROPE EQUITIES Z C                                                                                                                           | 702     | EUR     | 2,393,343          | 1.24         |
| CLEOME INDEX USA EQUITIES Z C                                                                                                                              | 3,216   | USD     | 17,038,071         | 8.81         |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE CORPORATE EURO BOND UCITS ETF D                                                                                                | 168,177 | EUR     | 4,022,794          | 2.08         |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE EUROPE EQUITY UCITS ETF C                                                                                                      | 8,047   | EUR     | 402,672            | 0.21         |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE JAPAN EQUITY UCITS ETF C                                                                                                       | 81,488  | EUR     | 3,715,853          | 1.92         |
|                                                                                                                                                            |         |         | <b>168,473,395</b> | <b>87.09</b> |
| <b>Aktien/Anteile in Anlagefonds gesamt</b>                                                                                                                |         |         | <b>172,778,616</b> | <b>89.31</b> |
| <b>Organismen für gemeinsame Anlagen gesamt</b>                                                                                                            |         |         | <b>172,778,616</b> | <b>89.31</b> |
| <b>Anlageportfolio gesamt</b>                                                                                                                              |         |         | <b>189,787,451</b> | <b>98.11</b> |
| Erwerbskosten                                                                                                                                              |         |         | 165,694,072        |              |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.  
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



## Candriam L Conservative Asset Allocation

### Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2026

#### Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

|                                |              |
|--------------------------------|--------------|
| Luxemburg                      | 87.09        |
| Frankreich                     | 3.58         |
| Irland                         | 2.91         |
| Vereinigte Staaten von Amerika | 1.79         |
| Deutschland                    | 0.68         |
| Hongkong                       | 0.47         |
| Volksrepublik China            | 0.43         |
| Großbritannien                 | 0.26         |
| Niederlande                    | 0.22         |
| Schweden                       | 0.21         |
| Norwegen                       | 0.20         |
| Kaimaninseln                   | 0.17         |
| Italien                        | 0.10         |
|                                | <b>98.11</b> |

#### Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

|                                      |              |
|--------------------------------------|--------------|
| Anlagefonds                          | 89.66        |
| Nicht klassifizierbare Institutionen | 2.56         |
| Elektrotechnik                       | 1.15         |
| Elektronik und Halbleiter            | 1.03         |
| Luft- und Raumfahrt                  | 0.88         |
| Internet und Internet-Dienste        | 0.66         |
| Maschinen- und Apparatebau           | 0.58         |
| Baumaterialien                       | 0.51         |
| Büroausstattung und Computer         | 0.51         |
| Einzelhandel und Warenhäuser         | 0.30         |
| Banken und andere Finanzinstitute    | 0.25         |
|                                      | <b>98.11</b> |



## Candriam L Dynamic Asset Allocation

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                                                                                                                                         | Anzahl | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV    |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------|--------------------|-------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden</b> |        |         |                    |             |
| <b>Strukturierte Produkte</b>                                                                                                                       |        |         |                    |             |
| <b>Irland</b>                                                                                                                                       |        |         |                    |             |
| ISHARES PHYSICAL METALS PLC - GOLD                                                                                                                  | 2,264  | USD     | 154,824            | 1.93        |
| ISHS PHY MET (COMDTY SILVER)                                                                                                                        | 1,280  | USD     | 63,661             | 0.79        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>218,485</b>     | <b>2.72</b> |
| <b>Strukturierte Produkte, insgesamt</b>                                                                                                            |        |         | <b>218,485</b>     | <b>2.72</b> |
| <b>Anteile</b>                                                                                                                                      |        |         |                    |             |
| <b>Kaimaninseln</b>                                                                                                                                 |        |         |                    |             |
| VNET GROUP INC-ADR                                                                                                                                  | 1,763  | USD     | 12,398             | 0.15        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>12,398</b>      | <b>0.15</b> |
| <b>Frankreich</b>                                                                                                                                   |        |         |                    |             |
| CIE DE SAINT-GOBAIN                                                                                                                                 | 213    | EUR     | 16,861             | 0.21        |
| LEGRAND SA                                                                                                                                          | 132    | EUR     | 19,496             | 0.24        |
| SAFRAN SA                                                                                                                                           | 59     | EUR     | 20,355             | 0.25        |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE                                                                                                                               | 75     | EUR     | 21,405             | 0.27        |
| VINCI SA                                                                                                                                            | 146    | EUR     | 18,659             | 0.23        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>96,776</b>      | <b>1.21</b> |
| <b>Deutschland</b>                                                                                                                                  |        |         |                    |             |
| SIEMENS AG PREFERENTIAL SHARE                                                                                                                       | 77     | EUR     | 21,649             | 0.27        |
| SIEMENS ENERGY - REG SHS                                                                                                                            | 152    | EUR     | 25,202             | 0.31        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>46,851</b>      | <b>0.58</b> |
| <b>Hongkong</b>                                                                                                                                     |        |         |                    |             |
| HUA HONG GRACE SEMICONDUCTOR                                                                                                                        | 1,392  | HKD     | 33,411             | 0.42        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>33,411</b>      | <b>0.42</b> |
| <b>Italien</b>                                                                                                                                      |        |         |                    |             |
| LEONARDO SPA                                                                                                                                        | 173    | EUR     | 8,118              | 0.10        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>8,118</b>       | <b>0.10</b> |
| <b>Niederlande</b>                                                                                                                                  |        |         |                    |             |
| AIRBUS SE                                                                                                                                           | 82     | EUR     | 15,952             | 0.20        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>15,952</b>      | <b>0.20</b> |
| <b>Norwegen</b>                                                                                                                                     |        |         |                    |             |
| KONGSBERG GRUPPEN ASA                                                                                                                               | 578    | NOK     | 15,240             | 0.19        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>15,240</b>      | <b>0.19</b> |
| <b>Volksrepublik China</b>                                                                                                                          |        |         |                    |             |
| ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR                                                                                                                        | 61     | USD     | 5,121              | 0.06        |
| BYD COMPANY LTD -H-                                                                                                                                 | 1,261  | HKD     | 10,190             | 0.13        |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOL                                                                                                                        | 196    | HKD     | 15,346             | 0.19        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>30,657</b>      | <b>0.38</b> |
| <b>Schweden</b>                                                                                                                                     |        |         |                    |             |
| SAAB AB                                                                                                                                             | 354    | SEK     | 16,086             | 0.20        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>16,086</b>      | <b>0.20</b> |
| <b>Großbritannien</b>                                                                                                                               |        |         |                    |             |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC                                                                                                                            | 1,194  | GBP     | 20,024             | 0.25        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>20,024</b>      | <b>0.25</b> |
| <b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>                                                                                                               |        |         |                    |             |
| ALPHABET INC -A-                                                                                                                                    | 28     | USD     | 8,752              | 0.11        |
| AMAZON.COM INC                                                                                                                                      | 111    | USD     | 23,140             | 0.29        |
| BROADCOM INC - REGISTERED SHS                                                                                                                       | 23     | USD     | 7,599              | 0.09        |
| GE VERNOVA LLC                                                                                                                                      | 18     | USD     | 18,497             | 0.23        |
| GS ACQN HLDG - REGISTERED SHS -A-                                                                                                                   | 71     | USD     | 20,793             | 0.26        |
| MICROSOFT CORP                                                                                                                                      | 69     | USD     | 22,512             | 0.28        |
| NVIDIA CORP                                                                                                                                         | 110    | USD     | 19,251             | 0.24        |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR CO ADR (REPR 5 SHS)                                                                                                            | 25     | USD     | 10,443             | 0.13        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>130,987</b>     | <b>1.63</b> |
| <b>Aktien gesamt</b>                                                                                                                                |        |         | <b>426,500</b>     | <b>5.32</b> |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



## Candriam L Dynamic Asset Allocation

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                                                                                                                                                | Anzahl | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV     |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------|--------------------|--------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt</b> |        |         | <b>644,985</b>     | <b>8.04</b>  |
| <b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>                                                                                                                   |        |         |                    |              |
| <b>Anteile/Einheiten an Anlagefonds</b>                                                                                                                    |        |         |                    |              |
| <b>Frankreich</b>                                                                                                                                          |        |         |                    |              |
| CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z C                                                                                                                           | 26     | EUR     | 37,711             | 0.47         |
| Ofi Invest Energy Strategic Metals I                                                                                                                       | 1      | EUR     | 33,112             | 0.41         |
|                                                                                                                                                            |        |         | <b>70,823</b>      | <b>0.88</b>  |
| <b>Luxemburg</b>                                                                                                                                           |        |         |                    |              |
| CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQUITY MARKET NEUTRAL Z C                                                                                                         | 17     | EUR     | 37,160             | 0.46         |
| CANDRIAM BONDS CAPITAL SECURITIES Z C                                                                                                                      | 52     | EUR     | 107,885            | 1.34         |
| CANDRIAM BONDS CREDIT ALPHA Z C                                                                                                                            | 10     | EUR     | 19,417             | 0.24         |
| CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z C                                                                                                          | 127    | USD     | 157,843            | 1.97         |
| CANDRIAM BONDS EURO GOVERNMENT Z C                                                                                                                         | 29     | EUR     | 74,835             | 0.93         |
| CANDRIAM BONDS EURO HIGH YIELD Z C                                                                                                                         | 164    | EUR     | 49,340             | 0.62         |
| CANDRIAM BONDS EURO SHORT TERM Z C                                                                                                                         | 31     | EUR     | 74,019             | 0.92         |
| CANDRIAM BONDS GLOBAL HIGH YIELD Z C                                                                                                                       | 11     | EUR     | 3,737              | 0.05         |
| CANDRIAM EQUITIES L BIOTECHNOLOGY Z C                                                                                                                      | 27     | USD     | 93,474             | 1.17         |
| CANDRIAM EQUITIES L EMERGING MARKETS Z C                                                                                                                   | 288    | EUR     | 688,442            | 8.58         |
| CANDRIAM EQUITIES L GLOBAL DEMOGRAPHY Z C                                                                                                                  | 70     | EUR     | 337,732            | 4.21         |
| CANDRIAM EQUITIES L RISK ARBITRAGE OPPORTUNITIES Z C                                                                                                       | 11     | EUR     | 17,139             | 0.21         |
| CANDRIAM EQUITIES L ROBOTICS & INNOVATIVE TECHNOLOGY Z C                                                                                                   | 26     | USD     | 198,478            | 2.47         |
| CANDRIAM EQUITIES L US EDGE Z USD C                                                                                                                        | 797    | USD     | 1,398,721          | 17.44        |
| CANDRIAM L ALTERNATIVE MULTI-STRATEGIES Z C                                                                                                                | 9      | EUR     | 17,975             | 0.22         |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME & GROWTH Z C                                                                                                                 | 24     | EUR     | 56,351             | 0.70         |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME Z C                                                                                                                          | 37     | EUR     | 69,358             | 0.86         |
| CANDRIAM MONEY MARKET USD SUSTAINABLE Z C                                                                                                                  | 262    | USD     | 307,473            | 3.83         |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EMERGING MARKETS Z C                                                                                                             | 52     | USD     | 60,776             | 0.76         |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO CORPORATE Z C                                                                                                               | 300    | EUR     | 343,049            | 4.28         |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO Z C                                                                                                                         | 284    | EUR     | 289,866            | 3.61         |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY EMERGING MARKETS Z C                                                                                                           | 42     | EUR     | 166,613            | 2.08         |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY QUANT EUROPE Z C                                                                                                               | 6      | EUR     | 37,271             | 0.46         |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY US Z C                                                                                                                         | 96     | USD     | 145,977            | 1.82         |
| CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO Z C                                                                                                                 | 10     | EUR     | 11,989             | 0.15         |
| CLEOME INDEX EUROPE EQUITIES Z C                                                                                                                           | 85     | EUR     | 289,237            | 3.61         |
| CLEOME INDEX USA EQUITIES Z C                                                                                                                              | 243    | USD     | 1,284,708          | 16.02        |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE CORPORATE EURO BOND UCITS ETF D                                                                                                | 4,141  | EUR     | 99,053             | 1.23         |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE EUROPE EQUITY UCITS ETF C                                                                                                      | 1,059  | EUR     | 52,992             | 0.66         |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE JAPAN EQUITY UCITS ETF C                                                                                                       | 9,507  | EUR     | 433,519            | 5.40         |
|                                                                                                                                                            |        |         | <b>6,924,429</b>   | <b>86.33</b> |
| <b>Aktien/Anteile in Anlagefonds gesamt</b>                                                                                                                |        |         | <b>6,995,252</b>   | <b>87.21</b> |
| <b>Organismen für gemeinsame Anlagen gesamt</b>                                                                                                            |        |         | <b>6,995,252</b>   | <b>87.21</b> |
| <b>Anlageportfolio gesamt</b>                                                                                                                              |        |         | <b>7,640,237</b>   | <b>95.25</b> |
| Erwerbskosten                                                                                                                                              |        |         | 6,409,764          |              |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.  
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



## Candriam L Dynamic Asset Allocation

### Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2026

#### Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

|                                |              |
|--------------------------------|--------------|
| Luxemburg                      | 86.33        |
| Irland                         | 2.72         |
| Frankreich                     | 2.09         |
| Vereinigte Staaten von Amerika | 1.63         |
| Deutschland                    | 0.58         |
| Hongkong                       | 0.42         |
| Volksrepublik China            | 0.38         |
| Großbritannien                 | 0.25         |
| Niederlande                    | 0.20         |
| Schweden                       | 0.20         |
| Norwegen                       | 0.19         |
| Kaimaninseln                   | 0.15         |
| Italien                        | 0.10         |
|                                | <b>95.25</b> |

#### Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

|                                      |              |
|--------------------------------------|--------------|
| Anlagefonds                          | 87.59        |
| Nicht klassifizierbare Institutionen | 2.34         |
| Elektrotechnik                       | 1.01         |
| Elektronik und Halbleiter            | 0.91         |
| Luft- und Raumfahrt                  | 0.84         |
| Internet und Internet-Dienste        | 0.61         |
| Maschinen- und Apparatebau           | 0.51         |
| Büroausstattung und Computer         | 0.46         |
| Baumaterialien                       | 0.44         |
| Einzelhandel und Warenhäuser         | 0.29         |
| Banken und andere Finanzinstitute    | 0.25         |
|                                      | <b>95.25</b> |



## Candriam L Multi-Asset Income

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                                                                                                                                         | Anzahl  | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV    |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|---------|--------------------|-------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden</b> |         |         |                    |             |
| <b>Strukturierte Produkte</b>                                                                                                                       |         |         |                    |             |
| <b>Irland</b>                                                                                                                                       |         |         |                    |             |
| ISHARES PHYSICAL METALS PLC - GOLD                                                                                                                  | 177,303 | USD     | 12,124,932         | 2.46        |
| ISHS PHY MET (COMDTY SILVER)                                                                                                                        | 99,678  | USD     | 4,957,527          | 1.00        |
|                                                                                                                                                     |         |         | <b>17,082,459</b>  | <b>3.46</b> |
| <b>Strukturierte Produkte, insgesamt</b>                                                                                                            |         |         | <b>17,082,459</b>  | <b>3.46</b> |
| <b>Anteile</b>                                                                                                                                      |         |         |                    |             |
| <b>Kanada</b>                                                                                                                                       |         |         |                    |             |
| AGNICO EAGLE MINES LTD                                                                                                                              | 7,789   | CAD     | 1,056,860          | 0.21        |
| ROYAL BANK OF CANADA                                                                                                                                | 3,740   | CAD     | 677,145            | 0.14        |
|                                                                                                                                                     |         |         | <b>1,734,005</b>   | <b>0.35</b> |
| <b>Kaimaninseln</b>                                                                                                                                 |         |         |                    |             |
| VNET GROUP INC-ADR                                                                                                                                  | 68,000  | USD     | 478,195            | 0.10        |
|                                                                                                                                                     |         |         | <b>478,195</b>     | <b>0.10</b> |
| <b>Frankreich</b>                                                                                                                                   |         |         |                    |             |
| AIR LIQUIDE SA                                                                                                                                      | 4,364   | EUR     | 756,194            | 0.15        |
| BNP PARIBAS SA                                                                                                                                      | 9,871   | EUR     | 1,008,224          | 0.20        |
| CIE DE SAINT-GOBAIN                                                                                                                                 | 7,093   | EUR     | 561,482            | 0.11        |
| LEGRAND SA                                                                                                                                          | 6,988   | EUR     | 1,032,128          | 0.21        |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE                                                                                                                 | 1,351   | EUR     | 654,019            | 0.13        |
| SAFRAN SA                                                                                                                                           | 1,472   | EUR     | 507,840            | 0.10        |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE                                                                                                                               | 3,627   | EUR     | 1,035,146          | 0.21        |
| SOCIETE GENERALE SA                                                                                                                                 | 18,337  | EUR     | 1,418,734          | 0.29        |
| THALES                                                                                                                                              | 2,507   | EUR     | 563,574            | 0.11        |
| VINCI SA                                                                                                                                            | 7,864   | EUR     | 1,005,019          | 0.20        |
|                                                                                                                                                     |         |         | <b>8,542,360</b>   | <b>1.73</b> |
| <b>Deutschland</b>                                                                                                                                  |         |         |                    |             |
| ALLIANZ SE-REG                                                                                                                                      | 1,862   | EUR     | 771,054            | 0.16        |
| SAP AG                                                                                                                                              | 2,584   | EUR     | 346,256            | 0.07        |
| SIEMENS AG PREFERENTIAL SHARE                                                                                                                       | 7,084   | EUR     | 1,991,667          | 0.40        |
| SIEMENS ENERGY - REG SHS                                                                                                                            | 6,595   | EUR     | 1,093,451          | 0.22        |
|                                                                                                                                                     |         |         | <b>4,202,428</b>   | <b>0.85</b> |
| <b>Hongkong</b>                                                                                                                                     |         |         |                    |             |
| HUA HONG GRACE SEMICONDUCTOR                                                                                                                        | 26,880  | HKD     | 645,182            | 0.13        |
|                                                                                                                                                     |         |         | <b>645,182</b>     | <b>0.13</b> |
| <b>Irland</b>                                                                                                                                       |         |         |                    |             |
| CRH PLC                                                                                                                                             | 7,816   | USD     | 731,490            | 0.15        |
| LINDE PLC                                                                                                                                           | 2,746   | USD     | 1,246,400          | 0.25        |
|                                                                                                                                                     |         |         | <b>1,977,890</b>   | <b>0.40</b> |
| <b>Italien</b>                                                                                                                                      |         |         |                    |             |
| LEONARDO SPA                                                                                                                                        | 4,800   | EUR     | 225,240            | 0.05        |
|                                                                                                                                                     |         |         | <b>225,240</b>     | <b>0.05</b> |
| <b>Japan</b>                                                                                                                                        |         |         |                    |             |
| HITACHI LTD                                                                                                                                         | 33,800  | JPY     | 813,282            | 0.16        |
| MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC                                                                                                                  | 38,600  | JPY     | 666,202            | 0.13        |
| SHISEIDO                                                                                                                                            | 34,300  | JPY     | 483,263            | 0.10        |
|                                                                                                                                                     |         |         | <b>1,962,747</b>   | <b>0.40</b> |
| <b>Niederlande</b>                                                                                                                                  |         |         |                    |             |
| AIRBUS SE                                                                                                                                           | 3,027   | EUR     | 588,873            | 0.12        |
| ASML HOLDING NV                                                                                                                                     | 1,035   | EUR     | 1,781,649          | 0.36        |
| PROSUS NV                                                                                                                                           | 22,859  | EUR     | 868,413            | 0.18        |
|                                                                                                                                                     |         |         | <b>3,238,935</b>   | <b>0.66</b> |
| <b>Volksrepublik China</b>                                                                                                                          |         |         |                    |             |
| BYD COMPANY LTD -H-                                                                                                                                 | 52,882  | HKD     | 427,324            | 0.09        |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOL                                                                                                                        | 11,938  | HKD     | 934,716            | 0.19        |
|                                                                                                                                                     |         |         | <b>1,362,040</b>   | <b>0.28</b> |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



## Candriam L Multi-Asset Income

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                              | Anzahl | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV    |
|------------------------------------------|--------|---------|--------------------|-------------|
| <b>Spanien</b>                           |        |         |                    |             |
| BANCO SANTANDER SA - REG SHS             | 87,105 | EUR     | 1,052,577          | 0.21        |
| IBERDROLA SA                             | 70,192 | EUR     | 1,532,993          | 0.31        |
| INDRA SISTEMAS SA                        | 12,991 | EUR     | 622,529            | 0.13        |
|                                          |        |         | <b>3,208,099</b>   | <b>0.65</b> |
| <b>Schweiz</b>                           |        |         |                    |             |
| CHUBB - REG SHS                          | 981    | USD     | 292,369            | 0.06        |
| NESTLE SA PREFERENTIAL SHARE             | 8,681  | CHF     | 782,020            | 0.16        |
| NOVARTIS AG PREFERENTIAL SHARE           | 4,908  | CHF     | 673,629            | 0.14        |
| ROCHE HOLDING AG                         | 3,604  | CHF     | 1,300,527          | 0.26        |
|                                          |        |         | <b>3,048,545</b>   | <b>0.62</b> |
| <b>Großbritannien</b>                    |        |         |                    |             |
| ASTRAZENECA PLC                          | 3,066  | GBP     | 501,864            | 0.10        |
| HSBC HOLDINGS PLC                        | 75,521 | GBP     | 1,254,417          | 0.25        |
|                                          |        |         | <b>1,756,281</b>   | <b>0.36</b> |
| <b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>    |        |         |                    |             |
| ABBVIE INC                               | 2,138  | USD     | 470,573            | 0.10        |
| ADVANCED MICRO DEVICES INC               | 922    | USD     | 468,468            | 0.09        |
| ALPHABET INC -A-                         | 11,170 | USD     | 3,491,492          | 0.71        |
| AMAZON.COM INC                           | 12,324 | USD     | 2,569,144          | 0.52        |
| APPLE INC                                | 11,925 | USD     | 3,018,121          | 0.61        |
| APPLIED MATERIALS INC                    | 853    | USD     | 539,420            | 0.11        |
| BANK OF AMERICA CORP                     | 18,589 | USD     | 926,442            | 0.19        |
| BROADCOM INC - REGISTERED SHS            | 4,200  | USD     | 1,387,694          | 0.28        |
| CATERPILLAR - REG SHS                    | 1,065  | USD     | 991,969            | 0.20        |
| CISCO SYSTEMS INC                        | 5,192  | USD     | 533,414            | 0.11        |
| COCA-COLA CO                             | 4,656  | USD     | 330,966            | 0.07        |
| COINBASE GLOBAL - REG SHS -A-            | 6,037  | USD     | 771,931            | 0.16        |
| COSTCO WHOLESALE CORP                    | 1,400  | USD     | 1,145,507          | 0.23        |
| CURTISS-WRIGHT CORP                      | 2,421  | USD     | 1,604,598          | 0.33        |
| ELI LILLY & CO                           | 1,300  | USD     | 1,363,823          | 0.28        |
| ENTEGRIS INC                             | 1,682  | USD     | 264,606            | 0.05        |
| GE VERNOVA LLC                           | 805    | USD     | 827,221            | 0.17        |
| GENERAL ELECTRI                          | 3,258  | USD     | 1,064,998          | 0.22        |
| GS ACQN HLDG - REGISTERED SHS -A-        | 2,291  | USD     | 670,929            | 0.14        |
| JOHNSON & JOHNSON                        | 5,623  | USD     | 1,249,080          | 0.25        |
| JPMORGAN CHASE CO                        | 4,170  | USD     | 1,193,883          | 0.24        |
| LAM RESEARCH CORP                        | 1,308  | USD     | 495,754            | 0.10        |
| MASTERCARD INC -A-                       | 684    | USD     | 307,271            | 0.06        |
| MERCK & CO INC                           | 5,510  | USD     | 619,291            | 0.13        |
| META PLATFORMS INC A                     | 1,770  | USD     | 872,057            | 0.18        |
| MICRON TECHNOLOGY INC                    | 664    | USD     | 670,383            | 0.14        |
| MICROSOFT CORP                           | 9,462  | USD     | 3,087,130          | 0.63        |
| MORGAN STANLEY                           | 4,700  | USD     | 859,344            | 0.17        |
| NEXTERA ENERGY                           | 6,955  | USD     | 533,928            | 0.11        |
| NVIDIA CORP                              | 22,267 | USD     | 3,896,968          | 0.79        |
| PALO ALTO NETWORKS                       | 3,123  | USD     | 931,519            | 0.19        |
| PARKER-HANNIFIN CORP                     | 1,419  | USD     | 1,213,988          | 0.25        |
| PEPSICO INC                              | 2,275  | USD     | 269,426            | 0.05        |
| SALESFORCE INC                           | 4,428  | USD     | 606,744            | 0.12        |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS              | 968    | USD     | 817,038            | 0.17        |
| SERVICENOW INC                           | 4,301  | USD     | 373,483            | 0.08        |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR CO ADR (REPR 5 SHS) | 815    | USD     | 340,435            | 0.07        |
| TESLA MOTORS INC                         | 1,499  | USD     | 551,456            | 0.11        |
| THERMO FISHER SCIENT SHS                 | 1,054  | USD     | 462,200            | 0.09        |
| TJX COS INC                              | 9,596  | USD     | 1,271,577          | 0.26        |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC               | 15,175 | USD     | 561,978            | 0.11        |
| VISA INC -A-                             | 1,262  | USD     | 378,710            | 0.08        |
| WALMART INC                              | 7,265  | USD     | 719,701            | 0.15        |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



## Candriam L Multi-Asset Income

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                                      | Anzahl     | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV     |
|--------------------------------------------------|------------|---------|--------------------|--------------|
|                                                  |            |         | <b>44,724,660</b>  | <b>9.06</b>  |
| <b>Aktien gesamt</b>                             |            |         | <b>77,106,607</b>  | <b>15.62</b> |
| <b>Anleihen</b>                                  |            |         |                    |              |
| <b>Österreich</b>                                |            |         |                    |              |
| AUSTRIA 0.5 19-29 20/02A                         | 2,107,000  | EUR     | 1,994,596          | 0.40         |
| AUSTRIA 2.40 13-34 23/05A                        | 1,334,000  | EUR     | 1,280,258          | 0.26         |
|                                                  |            |         | <b>3,274,854</b>   | <b>0.66</b>  |
| <b>Belgien</b>                                   |            |         |                    |              |
| BELGIUM 1.25 18-33 22/04A                        | 1,800,000  | EUR     | 1,606,282          | 0.33         |
| BELGIUM 3.75 13-45 22/06A                        | 1,606,346  | EUR     | 1,549,056          | 0.31         |
| KBC GROUPE 3.75 24-32 27/03A                     | 4,200,000  | EUR     | 4,270,650          | 0.87         |
|                                                  |            |         | <b>7,425,988</b>   | <b>1.50</b>  |
| <b>Frankreich</b>                                |            |         |                    |              |
| BFCM 1.25 20-30 03/06A 1.25 20-30 03/06A         | 3,200,000  | EUR     | 2,952,167          | 0.60         |
| BNP PAR 3.494% 17-09-33 EMTN                     | 2,100,000  | EUR     | 2,076,300          | 0.42         |
| BNP PAR 4.1986% 16-07-35 EMTN                    | 2,400,000  | EUR     | 2,433,171          | 0.49         |
| CAPGEMINI 3.5% 25-09-34                          | 3,200,000  | EUR     | 3,092,968          | 0.63         |
| COMPAGNIE DE SAINT G 3.375 24-30 08/04A          | 2,300,000  | EUR     | 2,314,536          | 0.47         |
| CREDIT AGRICOLE 1.75 19-29 05/03A                | 2,000,000  | EUR     | 1,928,149          | 0.39         |
| CREDIT AGRICOLE SA 4.375 23-33 27/11A            | 2,800,000  | EUR     | 2,931,988          | 0.59         |
| EDF 3.25% 07-05-32 EMTN                          | 2,900,000  | EUR     | 2,875,232          | 0.58         |
| ELIS EX HOLDELIS 3.75 24-30 21/03A               | 2,500,000  | EUR     | 2,529,947          | 0.51         |
| FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 3.0% 25-11-34         | 7,925,157  | EUR     | 7,681,264          | 1.56         |
| FRANCE TREASURY BILL BTF ZCP 30-12-26            | 19,780,630 | EUR     | 19,376,561         | 3.93         |
| NEXANS SA 4.1250 24-29 29/05A                    | 3,100,000  | EUR     | 3,158,128          | 0.64         |
| ORANGE 2.5% 13-11-28 EMTN                        | 2,000,000  | EUR     | 1,978,890          | 0.40         |
| RCI BANQUE 3.75% 04-10-27                        | 1,500,000  | EUR     | 1,510,288          | 0.31         |
| RTE EDF TRANSPORT 3.50 24-33 30/04A              | 1,800,000  | EUR     | 1,798,616          | 0.36         |
|                                                  |            |         | <b>58,638,205</b>  | <b>11.88</b> |
| <b>Deutschland</b>                               |            |         |                    |              |
| BUNDSOBLIGATION 2.1% 12-04-29                    | 5,245,907  | EUR     | 5,187,577          | 1.05         |
| COMMERZBANK AKTIENGESSELLSCHAFT 3.125% 06-06-30  | 2,400,000  | EUR     | 2,387,336          | 0.48         |
| GERMAN TREASURY BILL ZCP 16-09-26                | 19,622,774 | EUR     | 19,280,527         | 3.91         |
| GERMANY 0.00 21-36 15/05U                        | 10,681,549 | EUR     | 8,052,075          | 1.63         |
| GERMANY 2.50 12-44 04/07A                        | 7,915,031  | EUR     | 7,061,582          | 1.43         |
| VOLKSWAGEN BANK 2.50 19-26 31/07A                | 1,200,000  | EUR     | 1,199,805          | 0.24         |
|                                                  |            |         | <b>43,168,902</b>  | <b>8.75</b>  |
| <b>Italien</b>                                   |            |         |                    |              |
| BUONI POLIENNAL 3.5000 24-31 15/02S              | 3,143,000  | EUR     | 3,213,305          | 0.65         |
| BUONI POLIENNAL 3.8500 18-49 01/09S              | 1,635,000  | EUR     | 1,541,458          | 0.31         |
| INTESA SANPAOLO 4.75 22-27 06/09A                | 2,000,000  | EUR     | 2,044,503          | 0.41         |
| ITALY 3.85 22-29 15/12S                          | 3,121,000  | EUR     | 3,223,483          | 0.65         |
| ITALY 4.75 13-28 01/09S                          | 2,426,000  | EUR     | 2,530,301          | 0.51         |
| ITALY 5.00 09-40 01/09S                          | 1,164,000  | EUR     | 1,303,506          | 0.26         |
| ITALY BUONI ORDINARI DEL TESORO BOT ZCP 12-02-27 | 20,904,000 | EUR     | 20,429,276         | 4.14         |
| ITALY BUONI ORDINARI DEL TESORO BOT ZCP 14-01-27 | 19,641,000 | EUR     | 19,240,708         | 3.90         |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.7% 15-10-27  | 3,883,000  | EUR     | 3,885,125          | 0.79         |
| PRYSMIAN 3.875% 28-11-31 EMTN                    | 3,550,000  | EUR     | 3,626,818          | 0.73         |
|                                                  |            |         | <b>61,038,483</b>  | <b>12.37</b> |
| <b>Luxemburg</b>                                 |            |         |                    |              |
| TRATON FINANCE LUXEM 4.5 23-26 23/11A            | 1,100,000  | EUR     | 1,105,941          | 0.22         |
|                                                  |            |         | <b>1,105,941</b>   | <b>0.22</b>  |
| <b>Niederlande</b>                               |            |         |                    |              |
| DARLING GLOBAL FINANCE BV 4.5% 15-06-32          | 2,950,000  | EUR     | 2,978,554          | 0.60         |
| ENEL FINANCE INTERNA 0 21-27 17/06U              | 1,698,000  | EUR     | 1,657,023          | 0.34         |
| ING GROEP NV 4.125% 20-05-36                     | 4,000,000  | EUR     | 4,052,739          | 0.82         |
| NETHERLANDS 0.5 22-32 15/07A                     | 3,039,550  | EUR     | 2,665,231          | 0.54         |
| SIKA CAPITAL BV 3.75 23-26 03/11A                | 1,200,000  | EUR     | 1,203,241          | 0.24         |
| TENNET HOLDING BV 3.875 22-28 28/10A             | 1,200,000  | EUR     | 1,225,171          | 0.25         |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



## Candriam L Multi-Asset Income

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                                 | Anzahl     | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV     |
|---------------------------------------------|------------|---------|--------------------|--------------|
| VONOVIA FINANCE BV 2.125 18-30 22/03A       | 3,200,000  | EUR     | 3,067,872          | 0.62         |
|                                             |            |         | <b>16,849,831</b>  | <b>3.41</b>  |
| <b>Portugal</b>                             |            |         |                    |              |
| ENERGIAS DE PORTUGAL 1.625 20-27 15/04A     | 1,600,000  | EUR     | 1,586,322          | 0.32         |
| PORTUGAL 3.875 14-30 15/02A                 | 1,522,585  | EUR     | 1,587,347          | 0.32         |
|                                             |            |         | <b>3,173,669</b>   | <b>0.64</b>  |
| <b>Spanien</b>                              |            |         |                    |              |
| CAIXABANK 3.375% 26-06-35 EMTN              | 2,000,000  | EUR     | 1,976,254          | 0.40         |
| CELLNEX FINANCE CO 1.25 21-29 15/01A        | 2,000,000  | EUR     | 1,908,218          | 0.39         |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI 3.25% 22-01-30 | 2,400,000  | EUR     | 2,385,245          | 0.48         |
| SPAIN 1.25 20-30 31/10A                     | 2,460,000  | EUR     | 2,312,324          | 0.47         |
| SPAIN 1.45 17-27 31/10A                     | 2,991,000  | EUR     | 2,948,252          | 0.60         |
| SPAIN 1.85 19-35 30/07A                     | 2,983,000  | EUR     | 2,667,476          | 0.54         |
| SPAIN 5.15 13-44 31/10A                     | 2,166,000  | EUR     | 2,554,255          | 0.52         |
| SPAIN LETRAS DEL TESORO ZCP 04-09-26        | 17,160,000 | EUR     | 16,816,507         | 3.41         |
| SPAIN LETRAS DEL TESORO ZCP 15-01-27        | 19,646,000 | EUR     | 19,240,777         | 3.90         |
| TELEFONICA EMISIONES 1.447 18-27 22/01A     | 1,600,000  | EUR     | 1,589,331          | 0.32         |
|                                             |            |         | <b>54,398,639</b>  | <b>11.02</b> |
| <b>Schweden</b>                             |            |         |                    |              |
| SVENSKA HANDELSBANKEN AB 3.25% 27-08-31     | 2,500,000  | EUR     | 2,498,016          | 0.51         |
|                                             |            |         | <b>2,498,016</b>   | <b>0.51</b>  |
| <b>Großbritannien</b>                       |            |         |                    |              |
| ANZ NEW ZEALAND INTLLDN 2.993% 27-03-28     | 2,000,000  | EUR     | 2,001,662          | 0.41         |
| BELRON FINANCE 5.75% 15-10-29               | 3,000,000  | USD     | 2,637,817          | 0.53         |
| NATIONWIDE BUILDING SO 0.25 21-28 14/09A    | 1,800,000  | EUR     | 1,696,988          | 0.34         |
| NATWEST GROUP 3.24% 13-05-30                | 1,600,000  | EUR     | 1,598,375          | 0.32         |
|                                             |            |         | <b>7,934,842</b>   | <b>1.61</b>  |
| <b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>       |            |         |                    |              |
| ABBOTT LABORATORIES 1.4000 20-30 30/06S     | 2,100,000  | USD     | 1,632,811          | 0.33         |
| AT&T INC 2.60 14-29 17/12A                  | 3,400,000  | EUR     | 3,335,108          | 0.68         |
| AVANTOR FUNDING INC 3.8750 21-29 01/11S     | 3,300,000  | USD     | 2,757,446          | 0.56         |
| BK AMERICA 2.299% 21-07-32                  | 2,000,000  | USD     | 1,545,508          | 0.31         |
| ELI LILLY & CO 3.3750 19-29 15/03S          | 1,800,000  | USD     | 1,536,037          | 0.31         |
| IQVIA 6.25% 01-06-32                        | 3,000,000  | USD     | 2,671,027          | 0.54         |
| MERCK AND 2.35% 24-06-40                    | 2,375,000  | USD     | 1,481,148          | 0.30         |
| MICROSOFT CORP 4.25 17-47 06/02S            | 300,000    | USD     | 222,424            | 0.05         |
| MORGAN STANLEY 1.928% 28-04-32              | 2,000,000  | USD     | 1,521,455          | 0.31         |
| NETFLIX INC 3.6250 19-30 15/06S             | 2,950,000  | EUR     | 2,997,229          | 0.61         |
| NOVELIS CORP 3.875 21-31 15/08S             | 3,999,000  | USD     | 3,188,001          | 0.65         |
| PEPSICO INC 2.75 20-30 19/03S               | 1,200,000  | USD     | 989,060            | 0.20         |
| PROLOGIS EURO FINANCE 4.625 23-33 23/05A    | 4,300,000  | EUR     | 4,550,752          | 0.92         |
| STRYKER CORP 2.125 18-27 30/11A             | 1,200,000  | EUR     | 1,188,105          | 0.24         |
| TOYOTA MOTOR CR 5.5500 23-30 20/11S         | 1,200,000  | USD     | 1,086,669          | 0.22         |
|                                             |            |         | <b>30,702,780</b>  | <b>6.22</b>  |
| <b>Anleihen gesamt</b>                      |            |         | <b>290,210,150</b> | <b>58.81</b> |
| <b>Wandelanleihen</b>                       |            |         |                    |              |
| <b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>       |            |         |                    |              |
| ZSCALER ZCP 15-07-28 CV                     | 1,250,000  | USD     | 1,009,372          | 0.20         |
|                                             |            |         | <b>1,009,372</b>   | <b>0.20</b>  |
| <b>Wandelanleihen gesamt</b>                |            |         | <b>1,009,372</b>   | <b>0.20</b>  |
| <b>Variabel verzinsliche Anleihen</b>       |            |         |                    |              |
| <b>Frankreich</b>                           |            |         |                    |              |
| BPCE ISSUER FL.R 24-33 08/03A               | 2,800,000  | EUR     | 2,854,780          | 0.58         |
| BQ POSTALE 3.5% 01-04-31 EMTN               | 1,500,000  | EUR     | 1,500,584          | 0.30         |
| DANONE E3R+0.27% 08-09-27 EMTN              | 1,600,000  | EUR     | 1,600,370          | 0.32         |
| EDF FL.R 20-XX 15/03A                       | 2,800,000  | EUR     | 2,787,894          | 0.56         |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE E3R+0.25% 02-09-27    | 1,600,000  | EUR     | 1,600,003          | 0.32         |
| SOCIETE GENERALE SA FL.R 20-28 22/09A       | 1,500,000  | EUR     | 1,462,826          | 0.30         |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



## Candriam L Multi-Asset Income

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                                                                                                                                                | Anzahl    | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV     |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|---------|--------------------|--------------|
|                                                                                                                                                            |           |         | <b>11,806,457</b>  | <b>2.39</b>  |
| <b>Deutschland</b>                                                                                                                                         |           |         |                    |              |
| ALLIANZ SE FL.R 17-47 06/07A                                                                                                                               | 3,000,000 | EUR     | 2,991,848          | 0.61         |
|                                                                                                                                                            |           |         | <b>2,991,848</b>   | <b>0.61</b>  |
| <b>Italien</b>                                                                                                                                             |           |         |                    |              |
| TERNA RETE ELETTRICAS FL.R 22-49 31/12                                                                                                                     | 1,660,000 | EUR     | 1,635,401          | 0.33         |
|                                                                                                                                                            |           |         | <b>1,635,401</b>   | <b>0.33</b>  |
| <b>Niederlande</b>                                                                                                                                         |           |         |                    |              |
| ING GROEP NV FL.R 23-34 23/05A                                                                                                                             | 2,500,000 | EUR     | 2,665,402          | 0.54         |
| TELEFONICA EUROPE BV FL.R 19-XX 24/09A                                                                                                                     | 2,100,000 | EUR     | 2,085,091          | 0.42         |
|                                                                                                                                                            |           |         | <b>4,750,493</b>   | <b>0.96</b>  |
| <b>Portugal</b>                                                                                                                                            |           |         |                    |              |
| ENERGIAS DE PORTUGA FL.R 21-82 14/03A                                                                                                                      | 1,600,000 | EUR     | 1,580,556          | 0.32         |
|                                                                                                                                                            |           |         | <b>1,580,556</b>   | <b>0.32</b>  |
| <b>Spanien</b>                                                                                                                                             |           |         |                    |              |
| ABERTIS FINANCE BV 4.87% PERP                                                                                                                              | 2,000,000 | EUR     | 2,039,557          | 0.41         |
| IBERDROLA FINANZAS FL.R 21-99 16/11A12A                                                                                                                    | 1,500,000 | EUR     | 1,464,699          | 0.30         |
|                                                                                                                                                            |           |         | <b>3,504,256</b>   | <b>0.71</b>  |
| <b>Großbritannien</b>                                                                                                                                      |           |         |                    |              |
| NGG FINANCE 2.125% 05-09-82                                                                                                                                | 1,650,000 | EUR     | 1,629,073          | 0.33         |
|                                                                                                                                                            |           |         | <b>1,629,073</b>   | <b>0.33</b>  |
| <b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>                                                                                                                      |           |         |                    |              |
| CITIGROUP 3.75% 14-05-32 EMTN                                                                                                                              | 3,300,000 | EUR     | 3,346,553          | 0.68         |
| JPM CHASE 3.674% 06-06-28 EMTN                                                                                                                             | 1,500,000 | EUR     | 1,510,889          | 0.31         |
| MORGAN STANLEY FL.R 23-29 02/03A                                                                                                                           | 2,000,000 | EUR     | 2,049,732          | 0.42         |
|                                                                                                                                                            |           |         | <b>6,907,174</b>   | <b>1.40</b>  |
| <b>Variabel verzinsliche Anleihen gesamt</b>                                                                                                               |           |         | <b>34,805,258</b>  | <b>7.05</b>  |
| <b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt</b> |           |         | <b>420,213,846</b> | <b>85.15</b> |
| <b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>                                                                                                                   |           |         |                    |              |
| <b>Anteile/Einheiten an Anlagefonds</b>                                                                                                                    |           |         |                    |              |
| <b>Frankreich</b>                                                                                                                                          |           |         |                    |              |
| Ofi Invest Energy Strategic Metals I                                                                                                                       | 90        | EUR     | 4,890,694          | 0.99         |
|                                                                                                                                                            |           |         | <b>4,890,694</b>   | <b>0.99</b>  |
| <b>Luxemburg</b>                                                                                                                                           |           |         |                    |              |
| CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z C                                                                                                          | 10,014    | USD     | 12,485,685         | 2.53         |
| CANDRIAM EQUITIES L BIOTECHNOLOGY Z C                                                                                                                      | 1,974     | USD     | 6,835,470          | 1.39         |
| CANDRIAM MONEY MARKET USD SUSTAINABLE Z C                                                                                                                  | 1,063     | USD     | 1,248,143          | 0.25         |
| CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO Z C                                                                                                                 | 18,946    | EUR     | 22,204,311         | 4.50         |
|                                                                                                                                                            |           |         | <b>42,773,609</b>  | <b>8.67</b>  |
| <b>Aktien/Anteile in Anlagefonds gesamt</b>                                                                                                                |           |         | <b>47,664,303</b>  | <b>9.66</b>  |
| <b>Organismen für gemeinsame Anlagen gesamt</b>                                                                                                            |           |         | <b>47,664,303</b>  | <b>9.66</b>  |
| <b>Anlageportfolio gesamt</b>                                                                                                                              |           |         | <b>467,878,149</b> | <b>94.81</b> |
| Erwerbskosten                                                                                                                                              |           |         | 462,898,982        |              |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.  
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



## Candriam L Multi-Asset Income

### Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2026

#### Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

|                                |              |
|--------------------------------|--------------|
| Frankreich                     | 17.00        |
| Vereinigte Staaten von Amerika | 16.89        |
| Italien                        | 12.75        |
| Spanien                        | 12.38        |
| Deutschland                    | 10.21        |
| Luxemburg                      | 8.89         |
| Niederlande                    | 5.03         |
| Irland                         | 3.86         |
| Großbritannien                 | 2.29         |
| Belgien                        | 1.50         |
| Portugal                       | 0.96         |
| Österreich                     | 0.66         |
| Schweiz                        | 0.62         |
| Schweden                       | 0.51         |
| Japan                          | 0.40         |
| Kanada                         | 0.35         |
| Volksrepublik China            | 0.28         |
| Hongkong                       | 0.13         |
| Kaimaninseln                   | 0.10         |
|                                | <b>94.81</b> |

#### Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

|                                               |              |
|-----------------------------------------------|--------------|
| Anleihen von Staaten, Provinzen und Gemeinden | 36.68        |
| Banken und andere Finanzinstitute             | 19.94        |
| Anlagefonds                                   | 9.67         |
| Internet und Internet-Dienste                 | 4.01         |
| Nicht klassifizierbare Institutionen          | 3.45         |
| Immobilien                                    | 2.37         |
| Pharmazeutika                                 | 2.23         |
| Elektronik und Halbleiter                     | 2.19         |
| Elektrotechnik                                | 2.17         |
| Versorger                                     | 1.96         |
| Kommunikation                                 | 1.94         |
| Büroausstattung und Computer                  | 1.75         |
| Einzelhandel und Warenhäuser                  | 1.16         |
| Maschinen- und Apparatebau                    | 0.86         |
| Lebensmittel und alkoholfreie Getränke        | 0.80         |
| Versicherungen                                | 0.76         |
| Kohlebergbau und Stahlindustrie & Chemie      | 0.65         |
| Sonstige Dienstleistungen                     | 0.59         |
| Luft- und Raumfahrt                           | 0.56         |
| Baumaterialien                                | 0.47         |
| Edelmetalle und Edelsteine                    | 0.21         |
| Chemikalien                                   | 0.15         |
| Textilien und Bekleidung                      | 0.13         |
| Kraftfahrzeuge                                | 0.11         |
|                                               | <b>94.81</b> |



## Candriam L Multi-Asset Income & Growth

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                                                                                                                                         | Anzahl | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV    |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------|--------------------|-------------|
| <b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden</b> |        |         |                    |             |
| <b>Strukturierte Produkte</b>                                                                                                                       |        |         |                    |             |
| <b>Irland</b>                                                                                                                                       |        |         |                    |             |
| ISHARES PHYSICAL METALS PLC - GOLD                                                                                                                  | 50,731 | USD     | 3,469,260          | 2.45        |
| ISHS PHY MET (COMDTY SILVER)                                                                                                                        | 28,520 | USD     | 1,418,454          | 1.00        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>4,887,714</b>   | <b>3.46</b> |
| <b>Strukturierte Produkte, insgesamt</b>                                                                                                            |        |         | <b>4,887,714</b>   | <b>3.46</b> |
| <b>Anteile</b>                                                                                                                                      |        |         |                    |             |
| <b>Kanada</b>                                                                                                                                       |        |         |                    |             |
| AGNICO EAGLE MINES LTD                                                                                                                              | 4,650  | CAD     | 630,941            | 0.45        |
| ROYAL BANK OF CANADA                                                                                                                                | 2,844  | CAD     | 514,920            | 0.36        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>1,145,861</b>   | <b>0.81</b> |
| <b>Kaimaninseln</b>                                                                                                                                 |        |         |                    |             |
| VNET GROUP INC-ADR                                                                                                                                  | 37,000 | USD     | 260,194            | 0.18        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>260,194</b>     | <b>0.18</b> |
| <b>Frankreich</b>                                                                                                                                   |        |         |                    |             |
| AIR LIQUIDE SA                                                                                                                                      | 2,877  | EUR     | 498,527            | 0.35        |
| BNP PARIBAS SA                                                                                                                                      | 7,637  | EUR     | 780,043            | 0.55        |
| CIE DE SAINT-GOBAIN                                                                                                                                 | 5,954  | EUR     | 471,319            | 0.33        |
| LEGRAND SA                                                                                                                                          | 4,051  | EUR     | 598,333            | 0.42        |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE                                                                                                                 | 1,036  | EUR     | 501,528            | 0.35        |
| SAFRAN SA                                                                                                                                           | 889    | EUR     | 306,705            | 0.22        |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE                                                                                                                               | 2,105  | EUR     | 600,767            | 0.42        |
| SOCIETE GENERALE SA                                                                                                                                 | 14,071 | EUR     | 1,088,673          | 0.77        |
| THALES                                                                                                                                              | 1,433  | EUR     | 322,138            | 0.23        |
| VINCI SA                                                                                                                                            | 4,466  | EUR     | 570,755            | 0.40        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>5,738,788</b>   | <b>4.06</b> |
| <b>Deutschland</b>                                                                                                                                  |        |         |                    |             |
| ALLIANZ SE-REG                                                                                                                                      | 1,200  | EUR     | 496,920            | 0.35        |
| SAP AG                                                                                                                                              | 1,542  | EUR     | 206,628            | 0.15        |
| SIEMENS AG PREFERENTIAL SHARE                                                                                                                       | 4,763  | EUR     | 1,339,117          | 0.95        |
| SIEMENS ENERGY - REG SHS                                                                                                                            | 3,689  | EUR     | 611,636            | 0.43        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>2,654,301</b>   | <b>1.88</b> |
| <b>Hongkong</b>                                                                                                                                     |        |         |                    |             |
| HUA HONG GRACE SEMICONDUCTOR                                                                                                                        | 16,489 | HKD     | 395,774            | 0.28        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>395,774</b>     | <b>0.28</b> |
| <b>Irland</b>                                                                                                                                       |        |         |                    |             |
| CRH PLC                                                                                                                                             | 6,233  | USD     | 583,339            | 0.41        |
| LINDE PLC                                                                                                                                           | 2,139  | USD     | 970,885            | 0.69        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>1,554,224</b>   | <b>1.10</b> |
| <b>Italien</b>                                                                                                                                      |        |         |                    |             |
| LEONARDO SPA                                                                                                                                        | 3,058  | EUR     | 143,497            | 0.10        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>143,497</b>     | <b>0.10</b> |
| <b>Japan</b>                                                                                                                                        |        |         |                    |             |
| HITACHI LTD                                                                                                                                         | 29,300 | JPY     | 705,005            | 0.50        |
| MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC                                                                                                                  | 27,200 | JPY     | 469,448            | 0.33        |
| SHISEIDO                                                                                                                                            | 20,300 | JPY     | 286,013            | 0.20        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>1,460,466</b>   | <b>1.03</b> |
| <b>Niederlande</b>                                                                                                                                  |        |         |                    |             |
| AIRBUS SE                                                                                                                                           | 1,731  | EUR     | 336,749            | 0.24        |
| ASML HOLDING NV                                                                                                                                     | 729    | EUR     | 1,254,901          | 0.89        |
| PROSUS NV                                                                                                                                           | 14,167 | EUR     | 538,204            | 0.38        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>2,129,854</b>   | <b>1.51</b> |
| <b>Volksrepublik China</b>                                                                                                                          |        |         |                    |             |
| BYD COMPANY LTD -H-                                                                                                                                 | 28,581 | HKD     | 230,955            | 0.16        |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOL                                                                                                                        | 7,013  | HKD     | 549,101            | 0.39        |
|                                                                                                                                                     |        |         | <b>780,056</b>     | <b>0.55</b> |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



## Candriam L Multi-Asset Income & Growth

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                              | Anzahl | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV    |
|------------------------------------------|--------|---------|--------------------|-------------|
| <b>Spanien</b>                           |        |         |                    |             |
| BANCO SANTANDER SA - REG SHS             | 65,707 | EUR     | 794,003            | 0.56        |
| IBERDROLA SA                             | 50,862 | EUR     | 1,110,826          | 0.79        |
| INDRA SISTEMAS SA                        | 7,229  | EUR     | 346,414            | 0.24        |
|                                          |        |         | <b>2,251,243</b>   | <b>1.59</b> |
| <b>Schweiz</b>                           |        |         |                    |             |
| CHUBB - REG SHS                          | 870    | USD     | 259,288            | 0.18        |
| NESTLE SA PREFERENTIAL SHARE             | 5,770  | CHF     | 519,785            | 0.37        |
| NOVARTIS AG PREFERENTIAL SHARE           | 3,762  | CHF     | 516,339            | 0.36        |
| ROCHE HOLDING AG                         | 2,358  | CHF     | 850,900            | 0.60        |
|                                          |        |         | <b>2,146,312</b>   | <b>1.52</b> |
| <b>Großbritannien</b>                    |        |         |                    |             |
| ASTRAZENECA PLC                          | 2,296  | GBP     | 375,825            | 0.27        |
| HSBC HOLDINGS PLC                        | 59,038 | GBP     | 980,631            | 0.69        |
|                                          |        |         | <b>1,356,456</b>   | <b>0.96</b> |
| <b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>    |        |         |                    |             |
| ABBVIE INC                               | 1,942  | USD     | 427,434            | 0.30        |
| ADVANCED MICRO DEVICES INC               | 720    | USD     | 365,832            | 0.26        |
| ALPHABET INC -A-                         | 8,428  | USD     | 2,634,405          | 1.86        |
| AMAZON.COM INC                           | 9,536  | USD     | 1,987,939          | 1.41        |
| APPLE INC                                | 9,110  | USD     | 2,305,667          | 1.63        |
| APPLIED MATERIALS INC                    | 597    | USD     | 377,531            | 0.27        |
| BANK OF AMERICA CORP                     | 13,331 | USD     | 664,393            | 0.47        |
| BROADCOM INC - REGISTERED SHS            | 3,528  | USD     | 1,165,663          | 0.82        |
| CATERPILLAR - REG SHS                    | 779    | USD     | 725,581            | 0.51        |
| CISCO SYSTEMS INC                        | 4,179  | USD     | 429,341            | 0.30        |
| COCA-COLA CO                             | 3,619  | USD     | 257,252            | 0.18        |
| COINBASE GLOBAL - REG SHS -A-            | 3,748  | USD     | 479,244            | 0.34        |
| COSTCO WHOLESALE CORP                    | 1,026  | USD     | 839,493            | 0.59        |
| CURTISS-WRIGHT CORP                      | 1,350  | USD     | 894,757            | 0.63        |
| ELI LILLY & CO                           | 880    | USD     | 923,203            | 0.65        |
| ENTEGRIS INC                             | 933    | USD     | 146,776            | 0.10        |
| GE VERNOVA LLC                           | 649    | USD     | 666,915            | 0.47        |
| GENERAL ELECTRI                          | 2,108  | USD     | 689,078            | 0.49        |
| GS ACQN HLDG - REGISTERED SHS -A-        | 1,616  | USD     | 473,252            | 0.33        |
| JOHNSON & JOHNSON                        | 4,189  | USD     | 930,535            | 0.66        |
| JPMORGAN CHASE CO                        | 3,201  | USD     | 916,455            | 0.65        |
| LAM RESEARCH CORP                        | 963    | USD     | 364,993            | 0.26        |
| MASTERCARD INC -A-                       | 623    | USD     | 279,868            | 0.20        |
| MERCK & CO INC                           | 4,857  | USD     | 545,897            | 0.39        |
| META PLATFORMS INC A                     | 1,243  | USD     | 612,411            | 0.43        |
| MICRON TECHNOLOGY INC                    | 479    | USD     | 483,604            | 0.34        |
| MICROSOFT CORP                           | 7,151  | USD     | 2,333,130          | 1.65        |
| MORGAN STANLEY                           | 3,035  | USD     | 554,917            | 0.39        |
| NEXTERA ENERGY                           | 5,698  | USD     | 437,430            | 0.31        |
| NVIDIA CORP                              | 17,041 | USD     | 2,982,362          | 2.11        |
| PALO ALTO NETWORKS                       | 2,019  | USD     | 602,221            | 0.43        |
| PARKER-HANNIFIN CORP                     | 1,104  | USD     | 944,498            | 0.67        |
| PEPSICO INC                              | 2,178  | USD     | 257,939            | 0.18        |
| SALESFORCE INC                           | 3,626  | USD     | 496,850            | 0.35        |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS              | 736    | USD     | 621,219            | 0.44        |
| SERVICENOW INC                           | 2,566  | USD     | 222,822            | 0.16        |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR CO ADR (REPR 5 SHS) | 572    | USD     | 238,931            | 0.17        |
| TESLA MOTORS INC                         | 1,262  | USD     | 464,268            | 0.33        |
| THERMO FISHER SCIENT SHS                 | 853    | USD     | 374,058            | 0.26        |
| TJX COS INC                              | 6,897  | USD     | 913,929            | 0.65        |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC               | 11,832 | USD     | 438,176            | 0.31        |
| VISA INC -A-                             | 1,223  | USD     | 367,007            | 0.26        |
| WALMART INC                              | 5,354  | USD     | 530,389            | 0.37        |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



## Candriam L Multi-Asset Income & Growth

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                                      | Anzahl    | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV     |
|--------------------------------------------------|-----------|---------|--------------------|--------------|
|                                                  |           |         | <b>33,367,665</b>  | <b>23.59</b> |
| <b>Aktien gesamt</b>                             |           |         | <b>55,384,691</b>  | <b>39.15</b> |
| <b>Anleihen</b>                                  |           |         |                    |              |
| <b>Österreich</b>                                |           |         |                    |              |
| AUSTRIA 0.5 19-29 20/02A                         | 522,000   | EUR     | 494,152            | 0.35         |
| AUSTRIA 2.40 13-34 23/05A                        | 344,000   | EUR     | 330,141            | 0.23         |
|                                                  |           |         | <b>824,293</b>     | <b>0.58</b>  |
| <b>Belgien</b>                                   |           |         |                    |              |
| BELGIUM 1.25 18-33 22/04A                        | 465,599   | EUR     | 415,491            | 0.29         |
| BELGIUM 3.75 13-45 22/06A                        | 383,235   | EUR     | 369,567            | 0.26         |
| KBC GROUPE 3.75 24-32 27/03A                     | 900,000   | EUR     | 915,139            | 0.65         |
|                                                  |           |         | <b>1,700,197</b>   | <b>1.20</b>  |
| <b>Frankreich</b>                                |           |         |                    |              |
| BFCM 1.25 20-30 03/06A1.25 20-30 03/06A          | 700,000   | EUR     | 645,787            | 0.46         |
| BNP PAR 3.494% 17-09-33 EMTN                     | 400,000   | EUR     | 395,486            | 0.28         |
| BNP PAR 4.1986% 16-07-35 EMTN                    | 500,000   | EUR     | 506,911            | 0.36         |
| CAPGEMINI 3.5% 25-09-34                          | 800,000   | EUR     | 773,242            | 0.55         |
| COMPAGNIE DE SAINT G 3.375 24-30 08/04A          | 500,000   | EUR     | 503,160            | 0.36         |
| CREDIT AGRICOLE 1.75 19-29 05/03A                | 300,000   | EUR     | 289,222            | 0.20         |
| CREDIT AGRICOLE SA 4.375 23-33 27/11A            | 600,000   | EUR     | 628,283            | 0.44         |
| EDF 3.25% 07-05-32 EMTN                          | 600,000   | EUR     | 594,876            | 0.42         |
| ELIS EX HOLDELIS 3.75 24-30 21/03A               | 500,000   | EUR     | 505,989            | 0.36         |
| FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 3.0% 25-11-34         | 2,032,352 | EUR     | 1,969,807          | 1.39         |
| FRANCE TREASURY BILL BTF ZCP 30-12-26            | 1,424,788 | EUR     | 1,395,986          | 0.99         |
| NEXANS SA 4.1250 24-29 29/05A                    | 700,000   | EUR     | 713,126            | 0.50         |
| ORANGE 2.5% 13-11-28 EMTN                        | 400,000   | EUR     | 395,778            | 0.28         |
| RCI BANQUE 3.75% 04-10-27                        | 250,000   | EUR     | 251,715            | 0.18         |
| RTE EDF TRANSPORT 3.50 24-33 30/04A              | 500,000   | EUR     | 499,616            | 0.35         |
|                                                  |           |         | <b>10,068,984</b>  | <b>7.12</b>  |
| <b>Deutschland</b>                               |           |         |                    |              |
| BUNDSOBLIGATION 2.1% 12-04-29                    | 1,338,251 | EUR     | 1,323,371          | 0.94         |
| COMMERZBANK AKTIENGESSELLSCHAFT 3.125% 06-06-30  | 500,000   | EUR     | 497,362            | 0.35         |
| GERMAN TREASURY BILL ZCP 16-09-26                | 1,413,418 | EUR     | 1,388,879          | 0.98         |
| GERMANY 0.00 21-36 15/05U                        | 2,716,818 | EUR     | 2,048,020          | 1.45         |
| GERMANY 2.50 12-44 04/07A                        | 2,023,341 | EUR     | 1,805,171          | 1.28         |
| VOLKSWAGEN BANK 2.50 19-26 31/07A                | 300,000   | EUR     | 299,951            | 0.21         |
|                                                  |           |         | <b>7,362,754</b>   | <b>5.20</b>  |
| <b>Italien</b>                                   |           |         |                    |              |
| BUONI POLIENNAL 3.5000 24-31 15/02S              | 800,000   | EUR     | 817,895            | 0.58         |
| BUONI POLIENNAL 3.8500 18-49 01/09S              | 427,000   | EUR     | 402,570            | 0.28         |
| INTESA SANPAOLO 4.75 22-27 06/09A                | 500,000   | EUR     | 511,126            | 0.36         |
| ITALY 3.85 22-29 15/12S                          | 795,000   | EUR     | 821,105            | 0.58         |
| ITALY 4.75 13-28 01/09S                          | 638,000   | EUR     | 665,430            | 0.47         |
| ITALY 5.00 09-40 01/09S                          | 293,000   | EUR     | 328,116            | 0.23         |
| ITALY BUONI ORDINARI DEL TESORO BOT ZCP 12-02-27 | 2,115,000 | EUR     | 2,072,108          | 1.46         |
| ITALY BUONI ORDINARI DEL TESORO BOT ZCP 14-01-27 | 2,115,000 | EUR     | 2,073,588          | 1.47         |
| ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.7% 15-10-27  | 990,000   | EUR     | 990,542            | 0.70         |
| PRYSMIAN 3.875% 28-11-31 EMTN                    | 750,000   | EUR     | 766,229            | 0.54         |
|                                                  |           |         | <b>9,448,709</b>   | <b>6.68</b>  |
| <b>Luxemburg</b>                                 |           |         |                    |              |
| TRATON FINANCE LUXEM 4.5 23-26 23/11A            | 300,000   | EUR     | 301,620            | 0.21         |
|                                                  |           |         | <b>301,620</b>     | <b>0.21</b>  |
| <b>Niederlande</b>                               |           |         |                    |              |
| DARLING GLOBAL FINANCE BV 4.5% 15-06-32          | 360,000   | EUR     | 363,485            | 0.26         |
| ENEL FINANCE INTERNA 0 21-27 17/06U              | 327,000   | EUR     | 319,109            | 0.23         |
| ING GROEP NV 4.125% 20-05-36                     | 900,000   | EUR     | 911,866            | 0.64         |
| NETHERLANDS 0.5 22-32 15/07A                     | 775,927   | EUR     | 680,372            | 0.48         |
| SIKA CAPITAL BV 3.75 23-26 03/11A                | 300,000   | EUR     | 300,810            | 0.21         |
| TENNET HOLDING BV 3.875 22-28 28/10A             | 300,000   | EUR     | 306,293            | 0.22         |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



## Candriam L Multi-Asset Income & Growth

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                                 | Anzahl    | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV     |
|---------------------------------------------|-----------|---------|--------------------|--------------|
| VONOVIA FINANCE BV 2.125 18-30 22/03A       | 700,000   | EUR     | 671,097            | 0.47         |
|                                             |           |         | <b>3,553,032</b>   | <b>2.51</b>  |
| <b>Portugal</b>                             |           |         |                    |              |
| ENERGIAS DE PORTUGAL 1.625 20-27 15/04A     | 300,000   | EUR     | 297,435            | 0.21         |
| PORTUGAL 3.875 14-30 15/02A                 | 388,252   | EUR     | 404,766            | 0.29         |
|                                             |           |         | <b>702,201</b>     | <b>0.50</b>  |
| <b>Spanien</b>                              |           |         |                    |              |
| CAIXABANK 3.375% 26-06-35 EMTN              | 400,000   | EUR     | 395,251            | 0.28         |
| CELLNEX FINANCE CO 1.25 21-29 15/01A        | 500,000   | EUR     | 477,055            | 0.34         |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI 3.25% 22-01-30 | 500,000   | EUR     | 496,926            | 0.35         |
| SPAIN 1.25 20-30 31/10A                     | 596,000   | EUR     | 560,221            | 0.40         |
| SPAIN 1.45 17-27 31/10A                     | 758,000   | EUR     | 747,166            | 0.53         |
| SPAIN 1.85 19-35 30/07A                     | 763,000   | EUR     | 682,294            | 0.48         |
| SPAIN 5.15 13-44 31/10A                     | 555,000   | EUR     | 654,484            | 0.46         |
| SPAIN LETRAS DEL TESORO ZCP 04-09-26        | 2,091,000 | EUR     | 2,061,251          | 1.46         |
| SPAIN LETRAS DEL TESORO ZCP 15-01-27        | 2,116,000 | EUR     | 2,075,217          | 1.47         |
| TELEFONICA EMISIONES 1.447 18-27 22/01A     | 400,000   | EUR     | 397,333            | 0.28         |
|                                             |           |         | <b>8,547,198</b>   | <b>6.04</b>  |
| <b>Schweden</b>                             |           |         |                    |              |
| SVENSKA HANDELSBANKEN AB 3.25% 27-08-31     | 400,000   | EUR     | 399,683            | 0.28         |
|                                             |           |         | <b>399,683</b>     | <b>0.28</b>  |
| <b>Großbritannien</b>                       |           |         |                    |              |
| ANZ NEW ZEALAND INTLLDN 2.993% 27-03-28     | 350,000   | EUR     | 350,291            | 0.25         |
| BELRON FINANCE 5.75% 15-10-29               | 600,000   | USD     | 527,563            | 0.37         |
| NATIONWIDE BUILDING SO 0.25 21-28 14/09A    | 350,000   | EUR     | 329,970            | 0.23         |
| NATWEST GROUP 3.24% 13-05-30                | 370,000   | EUR     | 369,624            | 0.26         |
|                                             |           |         | <b>1,577,448</b>   | <b>1.12</b>  |
| <b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>       |           |         |                    |              |
| ABBOTT LABORATORIES 1.4000 20-30 30/06S     | 832,000   | USD     | 646,904            | 0.46         |
| AT&T INC 2.60 14-29 17/12A                  | 800,000   | EUR     | 784,731            | 0.55         |
| AVANTOR FUNDING INC 3.8750 21-29 01/11S     | 650,000   | USD     | 543,133            | 0.38         |
| BK AMERICA 2.299% 21-07-32                  | 950,000   | USD     | 734,116            | 0.52         |
| ELI LILLY & CO 3.3750 19-29 15/03S          | 845,000   | USD     | 721,084            | 0.51         |
| IQVIA 6.25% 01-06-32                        | 424,000   | USD     | 377,505            | 0.27         |
| MERCK AND 2.35% 24-06-40                    | 1,100,000 | USD     | 686,005            | 0.48         |
| MICROSOFT CORP 4.25 17-47 06/02S            | 178,000   | USD     | 131,972            | 0.09         |
| MORGAN STANLEY 1.928% 28-04-32              | 960,000   | USD     | 730,299            | 0.52         |
| NETFLIX INC 3.6250 19-30 15/06S             | 660,000   | EUR     | 670,567            | 0.47         |
| NOVELIS CORP 3.875 21-31 15/08S             | 639,000   | USD     | 509,411            | 0.36         |
| PEPSICO INC 2.75 20-30 19/03S               | 547,000   | USD     | 450,846            | 0.32         |
| PROLOGIS EURO FINANCE 4.625 23-33 23/05A    | 1,000,000 | EUR     | 1,058,314          | 0.75         |
| STRYKER CORP 2.125 18-27 30/11A             | 300,000   | EUR     | 297,026            | 0.21         |
| TOYOTA MOTOR CR 5.5500 23-30 20/11S         | 400,000   | USD     | 362,223            | 0.26         |
|                                             |           |         | <b>8,704,136</b>   | <b>6.15</b>  |
| <b>Anleihen gesamt</b>                      |           |         | <b>53,190,255</b>  | <b>37.60</b> |
| <b>Wandelanleihen</b>                       |           |         |                    |              |
| <b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>       |           |         |                    |              |
| ZSCALER ZCP 15-07-28 CV                     | 745,000   | USD     | 601,586            | 0.43         |
|                                             |           |         | <b>601,586</b>     | <b>0.43</b>  |
| <b>Wandelanleihen gesamt</b>                |           |         | <b>601,586</b>     | <b>0.43</b>  |
| <b>Variabel verzinsliche Anleihen</b>       |           |         |                    |              |
| <b>Frankreich</b>                           |           |         |                    |              |
| BPCE ISSUER FL.R 24-33 08/03A               | 600,000   | EUR     | 611,738            | 0.43         |
| BQ POSTALE 3.5% 01-04-31 EMTN               | 300,000   | EUR     | 300,117            | 0.21         |
| DANONE E3R+0.27% 08-09-27 EMTN              | 400,000   | EUR     | 400,092            | 0.28         |
| EDF FL.R 20-XX 15/03A                       | 400,000   | EUR     | 398,271            | 0.28         |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE E3R+0.25% 02-09-27    | 400,000   | EUR     | 400,001            | 0.28         |
| SOCIETE GENERALE SA FL.R 20-28 22/09A       | 400,000   | EUR     | 390,087            | 0.28         |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



## Candriam L Multi-Asset Income & Growth

### Anlageportfolio zum 30. Juni 2026

| Bezeichnung                                                                                                                                                | Anzahl  | Währung | Marktwert (in EUR) | % des NV     |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|---------|--------------------|--------------|
|                                                                                                                                                            |         |         | <b>2,500,306</b>   | <b>1.77</b>  |
| <b>Deutschland</b>                                                                                                                                         |         |         |                    |              |
| ALLIANZ SE FL.R 17-47 06/07A                                                                                                                               | 700,000 | EUR     | 698,098            | 0.49         |
|                                                                                                                                                            |         |         | <b>698,098</b>     | <b>0.49</b>  |
| <b>Italien</b>                                                                                                                                             |         |         |                    |              |
| TERNA RETE ELETTRICAS FL.R 22-49 31/12                                                                                                                     | 355,000 | EUR     | 349,739            | 0.25         |
|                                                                                                                                                            |         |         | <b>349,739</b>     | <b>0.25</b>  |
| <b>Niederlande</b>                                                                                                                                         |         |         |                    |              |
| ING GROEP NV FL.R 23-34 23/05A                                                                                                                             | 500,000 | EUR     | 533,080            | 0.38         |
| TELEFONICA EUROPE BV FL.R 19-XX 24/09A                                                                                                                     | 400,000 | EUR     | 397,160            | 0.28         |
|                                                                                                                                                            |         |         | <b>930,240</b>     | <b>0.66</b>  |
| <b>Portugal</b>                                                                                                                                            |         |         |                    |              |
| ENERGIAS DE PORTUGA FL.R 21-82 14/03A                                                                                                                      | 300,000 | EUR     | 296,354            | 0.21         |
|                                                                                                                                                            |         |         | <b>296,354</b>     | <b>0.21</b>  |
| <b>Spanien</b>                                                                                                                                             |         |         |                    |              |
| ABERTIS FINANCE BV 4.87% PERP                                                                                                                              | 700,000 | EUR     | 713,845            | 0.50         |
| IBERDROLA FINANZAS FL.R 21-99 16/11A12A                                                                                                                    | 400,000 | EUR     | 390,586            | 0.28         |
|                                                                                                                                                            |         |         | <b>1,104,431</b>   | <b>0.78</b>  |
| <b>Großbritannien</b>                                                                                                                                      |         |         |                    |              |
| NGG FINANCE 2.125% 05-09-82                                                                                                                                | 350,000 | EUR     | 345,561            | 0.24         |
|                                                                                                                                                            |         |         | <b>345,561</b>     | <b>0.24</b>  |
| <b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>                                                                                                                      |         |         |                    |              |
| CITIGROUP 3.75% 14-05-32 EMTN                                                                                                                              | 750,000 | EUR     | 760,580            | 0.54         |
| JPM CHASE 3.674% 06-06-28 EMTN                                                                                                                             | 400,000 | EUR     | 402,904            | 0.28         |
| MORGAN STANLEY FL.R 23-29 02/03A                                                                                                                           | 350,000 | EUR     | 358,703            | 0.25         |
|                                                                                                                                                            |         |         | <b>1,522,187</b>   | <b>1.08</b>  |
| <b>Variabel verzinsliche Anleihen gesamt</b>                                                                                                               |         |         | <b>7,746,916</b>   | <b>5.48</b>  |
| <b>Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt</b> |         |         | <b>121,811,162</b> | <b>86.11</b> |
| <b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>                                                                                                                   |         |         |                    |              |
| <b>Anteile/Einheiten an Anlagefonds</b>                                                                                                                    |         |         |                    |              |
| <b>Frankreich</b>                                                                                                                                          |         |         |                    |              |
| Ofi Invest Energy Strategic Metals I                                                                                                                       | 26      | EUR     | 1,399,361          | 0.99         |
|                                                                                                                                                            |         |         | <b>1,399,361</b>   | <b>0.99</b>  |
| <b>Luxemburg</b>                                                                                                                                           |         |         |                    |              |
| CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQUITY MARKET NEUTRAL Z C                                                                                                         | 861     | EUR     | 1,875,379          | 1.33         |
| CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z C                                                                                                          | 4,042   | USD     | 5,039,727          | 3.56         |
| CANDRIAM EQUITIES L BIOTECHNOLOGY Z C                                                                                                                      | 584     | USD     | 2,023,365          | 1.43         |
| CANDRIAM MONEY MARKET USD SUSTAINABLE Z C                                                                                                                  | 306     | USD     | 359,474            | 0.25         |
| CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO Z C                                                                                                                 | 2,407   | EUR     | 2,820,875          | 1.99         |
|                                                                                                                                                            |         |         | <b>12,118,820</b>  | <b>8.57</b>  |
| <b>Aktien/Anteile in Anlagefonds gesamt</b>                                                                                                                |         |         | <b>13,518,181</b>  | <b>9.56</b>  |
| <b>Organismen für gemeinsame Anlagen gesamt</b>                                                                                                            |         |         | <b>13,518,181</b>  | <b>9.56</b>  |
| <b>Anlageportfolio gesamt</b>                                                                                                                              |         |         | <b>135,329,343</b> | <b>95.66</b> |
| Erwerbskosten                                                                                                                                              |         |         | 127,894,462        |              |

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.  
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.



## Candriam L Multi-Asset Income & Growth

### Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2026

#### Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

|                                |              |
|--------------------------------|--------------|
| Vereinigte Staaten von Amerika | 31.24        |
| Frankreich                     | 13.93        |
| Luxemburg                      | 8.78         |
| Spanien                        | 8.41         |
| Deutschland                    | 7.57         |
| Italien                        | 7.03         |
| Niederlande                    | 4.67         |
| Irland                         | 4.55         |
| Großbritannien                 | 2.32         |
| Schweiz                        | 1.52         |
| Belgien                        | 1.20         |
| Japan                          | 1.03         |
| Kanada                         | 0.81         |
| Portugal                       | 0.71         |
| Österreich                     | 0.58         |
| Volksrepublik China            | 0.55         |
| Hongkong                       | 0.28         |
| Schweden                       | 0.28         |
| Kaimaninseln                   | 0.18         |
|                                | <b>95.66</b> |

#### Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

|                                               |              |
|-----------------------------------------------|--------------|
| Banken und andere Finanzinstitute             | 19.97        |
| Anleihen von Staaten, Provinzen und Gemeinden | 19.85        |
| Anlagefonds                                   | 9.57         |
| Internet und Internet-Dienste                 | 7.71         |
| Elektronik und Halbleiter                     | 5.60         |
| Pharmazeutika                                 | 4.61         |
| Büroausstattung und Computer                  | 3.91         |
| Elektrotechnik                                | 3.54         |
| Nicht klassifizierbare Institutionen          | 3.44         |
| Einzelhandel und Warenhäuser                  | 3.02         |
| Versorger                                     | 2.04         |
| Maschinen- und Apparatebau                    | 2.00         |
| Immobilien                                    | 1.81         |
| Kommunikation                                 | 1.71         |
| Lebensmittel und alkoholfreie Getränke        | 1.33         |
| Baumaterialien                                | 1.15         |
| Luft- und Raumfahrt                           | 1.10         |
| Versicherungen                                | 0.84         |
| Sonstige Dienstleistungen                     | 0.62         |
| Edelmetalle und Edelsteine                    | 0.45         |
| Kohlebergbau und Stahlindustrie & Chemie      | 0.36         |
| Chemikalien                                   | 0.35         |
| Textilien und Bekleidung                      | 0.35         |
| Kraftfahrzeuge                                | 0.33         |
|                                               | <b>95.66</b> |



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Optionen

Zum 30. Juni 2026 waren die offenen Optionen und Swaptions wie folgt:

#### Candriam L Balanced Asset Allocation

| Anzahl                   | Bezeichnung                      | Währung | Verpflichtung<br>(in EUR)<br>(in absolutem<br>Wert) | Marktwert<br>(in EUR) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|--------------------------|----------------------------------|---------|-----------------------------------------------------|-----------------------|------------------------------|
| <b>Gekaufte Optionen</b> |                                  |         |                                                     |                       |                              |
| 370                      | EURO STOXX 50 20260717 P5700     | EUR     |                                                     | 10,730                | (440,670)                    |
| 4                        | NASDAQ 100 INDEX 20260717 P28000 | USD     |                                                     | 36,858                | (174,637)                    |
|                          |                                  |         |                                                     | <b>47,588</b>         | <b>(615,307)</b>             |

#### Candriam L Dynamic Asset Allocation

| Anzahl                   | Bezeichnung                  | Währung | Verpflichtung<br>(in EUR)<br>(in absolutem<br>Wert) | Marktwert<br>(in EUR) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|--------------------------|------------------------------|---------|-----------------------------------------------------|-----------------------|------------------------------|
| <b>Gekaufte Optionen</b> |                              |         |                                                     |                       |                              |
| 14                       | EURO STOXX 50 20260717 P5700 | EUR     |                                                     | 406                   | (16,674)                     |
|                          |                              |         |                                                     | <b>406</b>            | <b>(16,674)</b>              |

#### Candriam L Multi-Asset Income

| Anzahl                   | Bezeichnung                      | Währung | Verpflichtung<br>(in EUR)<br>(in absolutem<br>Wert) | Marktwert<br>(in EUR) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|--------------------------|----------------------------------|---------|-----------------------------------------------------|-----------------------|------------------------------|
| <b>Gekaufte Optionen</b> |                                  |         |                                                     |                       |                              |
| 810                      | EURO STOXX 50 20260717 P5700     | EUR     |                                                     | 23,490                | (964,710)                    |
| 12                       | NASDAQ 100 INDEX 20260717 P28000 | USD     |                                                     | 110,574               | (438,009)                    |
|                          |                                  |         |                                                     | <b>134,064</b>        | <b>(1,402,719)</b>           |

#### Candriam L Conservative Asset Allocation

| Anzahl                   | Bezeichnung                      | Währung | Verpflichtung<br>(in EUR)<br>(in absolutem<br>Wert) | Marktwert<br>(in EUR) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|--------------------------|----------------------------------|---------|-----------------------------------------------------|-----------------------|------------------------------|
| <b>Gekaufte Optionen</b> |                                  |         |                                                     |                       |                              |
| 326                      | EURO STOXX 50 20260717 P5700     | EUR     |                                                     | 9,454                 | (388,266)                    |
| 4                        | NASDAQ 100 INDEX 20260717 P28000 | USD     |                                                     | 36,858                | (174,637)                    |
|                          |                                  |         |                                                     | <b>46,312</b>         | <b>(562,903)</b>             |

#### Candriam L Multi-Asset Income & Growth

| Anzahl                   | Bezeichnung                      | Währung | Verpflichtung<br>(in EUR)<br>(in absolutem<br>Wert) | Marktwert<br>(in EUR) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|--------------------------|----------------------------------|---------|-----------------------------------------------------|-----------------------|------------------------------|
| <b>Gekaufte Optionen</b> |                                  |         |                                                     |                       |                              |
| 216                      | EURO STOXX 50 20260717 P5700     | EUR     |                                                     | 6,264                 | (257,256)                    |
| 3                        | NASDAQ 100 INDEX 20260717 P28000 | USD     |                                                     | 27,644                | (109,502)                    |
|                          |                                  |         |                                                     | <b>33,908</b>         | <b>(366,758)</b>             |

Alle Optionsverträge wurden mit der Gegenpartei J.P. Morgan SE abgeschlossen. Siehe Anhangangabe 9 über Barmittel beim Broker im Zusammenhang mit börsennotierten Optionen und Anhangangabe 10 über erhaltene/gebuchte Sicherheiten im Zusammenhang mit OTC-Optionen. Die Verpflichtung für die gekauften Optionen wird nicht bekannt gegeben.



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Devisenterminkontrakte

Zum 30. Juni 2026 waren die folgenden Devisenterminkontrakte ausstehend:

#### Candriam L Balanced Asset Allocation

| Gekaufte<br>Devisen | Gekaufte<br>Anzahl | Verkaufte<br>Devisen | Verkaufte<br>Anzahl | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei               | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|---------------------|--------------------|----------------------|---------------------|-----------------------|---------------------------|------------------------------|
| AUD                 | 2,395,152          | EUR                  | 1,442,810           | 18/12/2026            | Société Générale          | (5,863)                      |
| CAD                 | 4,923,645          | EUR                  | 3,033,002           | 18/12/2026            | Natixis                   | 4,173                        |
| CHF                 | 1,215,830          | EUR                  | 1,333,506           | 18/12/2026            | J.P. Morgan SE            | 374                          |
| EUR                 | 5,777,438          | USD                  | 6,751,162           | 18/12/2026            | Natixis                   | (85,706)                     |
| EUR                 | 4,331,294          | CAD                  | 7,019,706           | 18/12/2026            | Barclays Bank Ireland Plc | 1,149                        |
| GBP                 | 918,475            | EUR                  | 1,053,982           | 18/12/2026            | J.P. Morgan SE            | 4,795                        |
| HUF                 | 1,547,816,621      | EUR                  | 4,370,249           | 18/12/2026            | Société Générale          | (72,003)                     |
| JPY                 | 476,848,119        | EUR                  | 2,582,436           | 18/12/2026            | Société Générale          | 1,292                        |
| USD                 | 5,123,635          | EUR                  | 4,479,901           | 18/12/2026            | J.P. Morgan SE            | (30,896)                     |
|                     |                    |                      |                     |                       |                           | <b>(182,685)</b>             |

#### Candriam L Conservative Asset Allocation

| Gekaufte<br>Devisen | Gekaufte<br>Anzahl | Verkaufte<br>Devisen | Verkaufte<br>Anzahl | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei               | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|---------------------|--------------------|----------------------|---------------------|-----------------------|---------------------------|------------------------------|
| AUD                 | 1,224,872          | EUR                  | 737,848             | 18/12/2026            | Société Générale          | (2,998)                      |
| CAD                 | 2,612,657          | EUR                  | 1,609,416           | 18/12/2026            | Natixis                   | 2,215                        |
| CHF                 | 319,263            | EUR                  | 350,163             | 18/12/2026            | J.P. Morgan SE            | 98                           |
| EUR                 | 114,020            | GBP                  | 99,361              | 18/12/2026            | Société Générale          | (519)                        |
| EUR                 | 16,893,204         | USD                  | 19,740,368          | 18/12/2026            | Natixis                   | (250,607)                    |
| EUR                 | 3,826,931          | CAD                  | 6,202,288           | 18/12/2026            | Barclays Bank Ireland Plc | 1,015                        |
| HUF                 | 1,340,410,557      | EUR                  | 3,784,639           | 18/12/2026            | Société Générale          | (62,355)                     |
| JPY                 | 516,188,634        | EUR                  | 2,795,490           | 18/12/2026            | Société Générale          | 1,399                        |
| USD                 | 4,414,630          | EUR                  | 3,859,976           | 18/12/2026            | J.P. Morgan SE            | (26,620)                     |
|                     |                    |                      |                     |                       |                           | <b>(338,372)</b>             |

#### Candriam L Dynamic Asset Allocation

| Gekaufte<br>Devisen | Gekaufte<br>Anzahl | Verkaufte<br>Devisen | Verkaufte<br>Anzahl | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei               | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|---------------------|--------------------|----------------------|---------------------|-----------------------|---------------------------|------------------------------|
| AUD                 | 122,099            | EUR                  | 73,551              | 18/12/2026            | Société Générale          | (299)                        |
| CAD                 | 257,271            | EUR                  | 158,481             | 18/12/2026            | Natixis                   | 218                          |
| CHF                 | 55,078             | EUR                  | 60,409              | 18/12/2026            | J.P. Morgan SE            | 17                           |
| EUR                 | 563,550            | USD                  | 658,530             | 18/12/2026            | Natixis                   | (8,361)                      |
| EUR                 | 154,673            | CAD                  | 250,677             | 18/12/2026            | Barclays Bank Ireland Plc | 41                           |
| GBP                 | 51,367             | EUR                  | 58,945              | 18/12/2026            | J.P. Morgan SE            | 268                          |
| HUF                 | 55,379,962         | EUR                  | 156,365             | 18/12/2026            | Société Générale          | (2,576)                      |
| USD                 | 184,486            | EUR                  | 161,307             | 18/12/2026            | J.P. Morgan SE            | (1,112)                      |
|                     |                    |                      |                     |                       |                           | <b>(11,804)</b>              |

#### Candriam L Multi-Asset Income

| Gekaufte<br>Devisen | Gekaufte<br>Anzahl | Verkaufte<br>Devisen | Verkaufte<br>Anzahl | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                          | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|---------------------|--------------------|----------------------|---------------------|-----------------------|--------------------------------------|------------------------------|
| AUD                 | 15,983,939         | USD                  | 11,242,588          | 18/12/2026            | Nomura Financial Products & Services | (174,217)                    |
| EUR                 | 25,212,447         | USD                  | 29,450,639          | 18/12/2026            | Nomura Financial Products & Services | (364,321)                    |
| EUR                 | 10,016,691         | CAD                  | 16,234,001          | 18/12/2026            | Barclays Bank Ireland Plc            | 2,656                        |
| JPY                 | 1,297,124,447      | USD                  | 8,212,197           | 18/12/2026            | Société Générale                     | (102,298)                    |
| USD                 | 11,042,264         | AUD                  | 16,056,383          | 18/12/2026            | BNP Paribas Paris                    | (44,777)                     |
|                     |                    |                      |                     |                       |                                      | <b>(682,957)</b>             |

#### Candriam L Multi-Asset Income & Growth

| Gekaufte<br>Devisen | Gekaufte<br>Anzahl | Verkaufte<br>Devisen | Verkaufte<br>Anzahl | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                          | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|---------------------|--------------------|----------------------|---------------------|-----------------------|--------------------------------------|------------------------------|
| AUD                 | 4,598,343          | USD                  | 3,234,326           | 18/12/2026            | Nomura Financial Products & Services | (50,120)                     |
| EUR                 | 9,526,863          | USD                  | 11,128,321          | 18/12/2026            | Nomura Financial Products & Services | (137,662)                    |
| EUR                 | 2,812,033          | CAD                  | 4,557,448           | 18/12/2026            | Barclays Bank Ireland Plc            | 746                          |
| JPY                 | 707,723,964        | USD                  | 4,480,656           | 18/12/2026            | Société Générale                     | (55,815)                     |
| USD                 | 4,048,011          | EUR                  | 3,542,217           | 18/12/2026            | J.P. Morgan SE                       | (27,229)                     |
| USD                 | 3,181,114          | AUD                  | 4,625,608           | 18/12/2026            | BNP Paribas Paris                    | (12,900)                     |
|                     |                    |                      |                     |                       |                                      | <b>(282,980)</b>             |

Beachten Sie Anhangangabe 10 hinsichtlich erhaltener/verbuchter Sicherheiten in Verbindung mit den Devisenterminkontrakten. Diese Geschäfte mit Devisenterminkontrakten werden hauptsächlich den gegen Währungsrisiko abgesicherten Anteilsklassen zugewiesen.



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Futures

Zum 30. Juni 2026 waren die folgenden Futures-Kontrakte ausstehend:

#### Candriam L Alternative Multi-Strategies

| Anzahl<br>(Kauf/(Verkauf))   | Bezeichnung          | Währung | Gegenpartei    | Verpflichtung<br>(in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|------------------------------|----------------------|---------|----------------|--------------------------------------------------|------------------------------|
| <b>Futures auf Index</b>     |                      |         |                |                                                  |                              |
| (5)                          | SWISS MARKET /202609 | CHF     | J.P. Morgan SE | 769,527                                          | (24,722)                     |
| (2)                          | NIKKEI 225 ( /202609 | JPY     | J.P. Morgan SE | 754,109                                          | (62,746)                     |
| (2)                          | HANG SENG IN /202607 | HKD     | J.P. Morgan SE | 255,203                                          | 792                          |
| (1)                          | NASDAQ 100 E- 0926   | USD     | J.P. Morgan SE | 529,631                                          | 4,443                        |
| (1)                          | S&P/TSE CAN /202609  | CAD     | J.P. Morgan SE | 252,812                                          | (173)                        |
| 2                            | FTSE 100 IND /202609 | GBP     | J.P. Morgan SE | 243,722                                          | 1,056                        |
| 2                            | TOPIX (OSE) /202609  | JPY     | J.P. Morgan SE | 429,972                                          | (646)                        |
| 4                            | DJIA MINI FU /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 915,231                                          | 7,181                        |
| 4                            | NIKKEI 225 0926      | JPY     | J.P. Morgan SE | 754,109                                          | 53,750                       |
| 10                           | CAC40 10 EUR /202607 | EUR     | J.P. Morgan SE | 845,821                                          | (1,960)                      |
| 10                           | SPI 200 INDE /202609 | AUD     | J.P. Morgan SE | 1,329,901                                        | (12,816)                     |
| (62)                         | CBOE VIX FUT /202607 | USD     | J.P. Morgan SE | 892,067                                          | 39,715                       |
| (53)                         | EURO STOXX 50 0926   | EUR     | J.P. Morgan SE | 3,353,888                                        | (32,515)                     |
| (19)                         | SP 500 MINI 0926     | USD     | J.P. Morgan SE | 6,231,428                                        | (51,624)                     |
| (58)                         | EURO STOX BANK IDX   | EUR     | J.P. Morgan SE | 851,730                                          | (14,819)                     |
| 13                           | EM RUSS 2000 /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 1,719,442                                        | 5,235                        |
| 25                           | EUR HY /202609       | EUR     | J.P. Morgan SE | 1,571,486                                        | 3,560                        |
| <b>Futures auf Anleihen</b>  |                      |         |                |                                                  |                              |
| (29)                         | US ULTRA BD /202609  | USD     | J.P. Morgan SE | 2,175,266                                        | (47,437)                     |
| (10)                         | US TREASURY /202609  | USD     | J.P. Morgan SE | 861,602                                          | (1,777)                      |
| (9)                          | EUROBOND             | EUR     | J.P. Morgan SE | 882,567                                          | (16,890)                     |
| (9)                          | US 2 YEARS N /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 1,569,446                                        | 2,487                        |
| 2                            | JAP GOVT 10 0926     | JPY     | J.P. Morgan SE | 971,333                                          | (431)                        |
| 34                           | EURO-OAT-FUT /202609 | EUR     | J.P. Morgan SE | 3,321,222                                        | 5,170                        |
| 37                           | EURO BTP 0926        | EUR     | J.P. Morgan SE | 3,732,412                                        | 37,870                       |
| (13)                         | US 5 YEARS N /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 1,106,427                                        | (560)                        |
| (54)                         | US 10YR NOTE 0926    | USD     | J.P. Morgan SE | 4,707,111                                        | (22,919)                     |
| (27)                         | KOREA 3YR BO /202609 | KRW     | J.P. Morgan SE | 1,503,836                                        | (6,820)                      |
| <b>Futures auf Währungen</b> |                      |         |                |                                                  |                              |
| (23)                         | JPN YEN CURR /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 1,547,001                                        | 21,278                       |
| (20)                         | USD/CAD (CME)        | USD     | J.P. Morgan SE | 1,232,264                                        | 20,850                       |
| (15)                         | USD/GBP (CME /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 1,087,440                                        | (1,121)                      |
| (8)                          | CME CHF/USD 0926     | USD     | J.P. Morgan SE | 1,081,979                                        | 14,295                       |
| (2)                          | EUR/USD (CME /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 249,758                                          | (1,717)                      |
| 2                            | EUR/GBP (CME /202609 | GBP     | J.P. Morgan SE | 249,957                                          | (1,596)                      |
| 10                           | USD/AUD (CME)        | USD     | J.P. Morgan SE | 605,176                                          | (5,808)                      |
| 67                           | EUR/JPY (CM /202609  | JPY     | J.P. Morgan SE | 8,362,108                                        | 35,832                       |
| 38                           | BRAZIL REAL /202608  | USD     | J.P. Morgan SE | 643,918                                          | 678                          |
| (32)                         | INR/USD-SGX /202607  | USD     | J.P. Morgan SE | 591,331                                          | 1,539                        |
| 47                           | USD/ZAR (CME /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 1,254,167                                        | 9,938                        |
| (21)                         | USD/NZD (CME /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 1,042,859                                        | 17,484                       |
| 104                          | USD/MXN (CME /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 2,600,776                                        | (5,633)                      |
|                              |                      |         |                |                                                  | <b>(31,577)</b>              |

#### Candriam L Balanced Asset Allocation

| Anzahl<br>(Kauf/(Verkauf)) | Bezeichnung          | Währung | Gegenpartei    | Verpflichtung<br>(in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|----------------------------|----------------------|---------|----------------|--------------------------------------------------|------------------------------|
| <b>Futures auf Index</b>   |                      |         |                |                                                  |                              |
| (4)                        | NASDAQ 100 E- 0926   | USD     | J.P. Morgan SE | 2,118,524                                        | (66,463)                     |
| 9                          | EMINI ENERGY /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 881,824                                          | (35,345)                     |
| 10                         | TOPIX (OSE) /202609  | JPY     | J.P. Morgan SE | 2,149,861                                        | (4,844)                      |
| 39                         | EM RUSS 2000 /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 5,158,327                                        | 96,309                       |
| 38                         | DJ.STOXX600. /202609 | EUR     | J.P. Morgan SE | 928,511                                          | (29,450)                     |
| 395                        | EURO STOX BANK IDX   | EUR     | J.P. Morgan SE | 5,800,575                                        | 68,924                       |
| 33                         | EUREX MINI M /202609 | EUR     | J.P. Morgan SE | 1,049,700                                        | (27,588)                     |
| 31                         | SP 500 MINI 0926     | USD     | J.P. Morgan SE | 10,167,067                                       | (105,747)                    |



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Futures (Fortsetzung)

#### Candriam L Balanced Asset Allocation (Fortsetzung)

| Anzahl<br>(Kauf/(Verkauf))   | Bezeichnung          | Währung | Gegenpartei    | Verpflichtung<br>(in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|------------------------------|----------------------|---------|----------------|--------------------------------------------------|------------------------------|
| <b>Futures auf Index</b>     |                      |         |                |                                                  |                              |
| 53                           | DJE 600 INDUS 0926   | EUR     | J.P. Morgan SE | 3,100,659                                        | 27,825                       |
| 25                           | DJ.STOXX600 /202609  | EUR     | J.P. Morgan SE | 966,550                                          | (98,800)                     |
| 184                          | DJ.STOXX600 /202609  | EUR     | J.P. Morgan SE | 5,172,884                                        | 145,553                      |
| (555)                        | STOXX EUR 60 /202609 | EUR     | J.P. Morgan SE | 17,808,008                                       | (113,775)                    |
| 107                          | EURO STOXX 50 0926   | EUR     | J.P. Morgan SE | 6,771,056                                        | 52,965                       |
| (43)                         | ZTS MSCI EMER 0926   | USD     | J.P. Morgan SE | 3,570,358                                        | (11,493)                     |
| <b>Futures auf Anleihen</b>  |                      |         |                |                                                  |                              |
| 14                           | EURO BOBL 0926       | EUR     | J.P. Morgan SE | 1,393,266                                        | 5,180                        |
| 159                          | EUROBOND             | EUR     | J.P. Morgan SE | 15,592,017                                       | 226,392                      |
| (89)                         | US 10YR NOTE 0926    | USD     | J.P. Morgan SE | 7,758,016                                        | (35,273)                     |
| <b>Futures auf Währungen</b> |                      |         |                |                                                  |                              |
| 112                          | BRAZIL REAL /202608  | USD     | J.P. Morgan SE | 1,897,864                                        | 18,613                       |
|                              |                      |         |                |                                                  | <b>112,983</b>               |

#### Candriam L Conservative Asset Allocation

| Anzahl<br>(Kauf/(Verkauf))   | Bezeichnung          | Währung | Gegenpartei    | Verpflichtung<br>(in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|------------------------------|----------------------|---------|----------------|--------------------------------------------------|------------------------------|
| <b>Futures auf Index</b>     |                      |         |                |                                                  |                              |
| (8)                          | SP 500 MINI 0926     | USD     | J.P. Morgan SE | 2,623,759                                        | 27,272                       |
| (4)                          | NASDAQ 100 E- 0926   | USD     | J.P. Morgan SE | 2,118,524                                        | (66,463)                     |
| 9                            | EMINI ENERGY /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 881,824                                          | (35,345)                     |
| 10                           | TOPIX (OSE) /202609  | JPY     | J.P. Morgan SE | 2,149,861                                        | 3,256                        |
| 24                           | DJ.STOXX600 /202609  | EUR     | J.P. Morgan SE | 927,888                                          | (94,848)                     |
| 29                           | EUREX MINI M /202609 | EUR     | J.P. Morgan SE | 922,464                                          | (24,244)                     |
| 40                           | ZTS MSCI EMER 0926   | USD     | J.P. Morgan SE | 3,321,263                                        | (69,868)                     |
| 39                           | EM RUSS 2000 /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 5,158,327                                        | 96,309                       |
| 114                          | EURO STOXX 50 0926   | EUR     | J.P. Morgan SE | 7,214,023                                        | 56,430                       |
| 55                           | DJE 600 INDUS 0926   | EUR     | J.P. Morgan SE | 3,217,665                                        | 28,875                       |
| 36                           | DJ.STOXX600. /202609 | EUR     | J.P. Morgan SE | 879,642                                          | (27,900)                     |
| 401                          | EURO STOXX BANK IDX  | EUR     | J.P. Morgan SE | 5,888,685                                        | 77,326                       |
| 178                          | DJ.STOXX600 /202609  | EUR     | J.P. Morgan SE | 5,004,203                                        | 140,807                      |
| (758)                        | STOXX EUR 60 /202609 | EUR     | J.P. Morgan SE | 24,321,567                                       | (155,390)                    |
| <b>Futures auf Anleihen</b>  |                      |         |                |                                                  |                              |
| 187                          | EURO BOBL 0926       | EUR     | J.P. Morgan SE | 18,610,053                                       | 69,190                       |
| 202                          | EUROBOND             | EUR     | J.P. Morgan SE | 19,808,726                                       | 286,800                      |
| (86)                         | US 10YR NOTE 0926    | USD     | J.P. Morgan SE | 7,496,510                                        | (34,084)                     |
| <b>Futures auf Währungen</b> |                      |         |                |                                                  |                              |
| 105                          | BRAZIL REAL /202608  | USD     | J.P. Morgan SE | 1,779,247                                        | 17,449                       |
|                              |                      |         |                |                                                  | <b>295,572</b>               |

#### Candriam L Dynamic Asset Allocation

| Anzahl<br>(Kauf/(Verkauf))  | Bezeichnung          | Währung | Gegenpartei    | Verpflichtung<br>(in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|-----------------------------|----------------------|---------|----------------|--------------------------------------------------|------------------------------|
| <b>Futures auf Index</b>    |                      |         |                |                                                  |                              |
| (23)                        | STOXX EUR 60 /202609 | EUR     | J.P. Morgan SE | 737,990                                          | (4,820)                      |
| 1                           | SP 500 MINI 0926     | USD     | J.P. Morgan SE | 327,970                                          | (3,411)                      |
| 1                           | DJ.STOXX600 /202609  | EUR     | J.P. Morgan SE | 38,662                                           | (3,952)                      |
| 1                           | DJ.STOXX600. /202609 | EUR     | J.P. Morgan SE | 24,435                                           | (775)                        |
| 1                           | EUREX MINI M /202609 | EUR     | J.P. Morgan SE | 31,809                                           | (836)                        |
| 2                           | EM RUSS 2000 /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 264,530                                          | 4,939                        |
| 2                           | DJE 600 INDUS 0926   | EUR     | J.P. Morgan SE | 117,006                                          | 1,050                        |
| 6                           | EURO STOXX 50 0926   | EUR     | J.P. Morgan SE | 379,685                                          | 2,970                        |
| 8                           | DJ.STOXX600 /202609  | EUR     | J.P. Morgan SE | 224,908                                          | 6,328                        |
| 14                          | EURO STOXX BANK IDX  | EUR     | J.P. Morgan SE | 205,590                                          | 2,576                        |
| <b>Futures auf Anleihen</b> |                      |         |                |                                                  |                              |
| (4)                         | EURO BOBL 0926       | EUR     | J.P. Morgan SE | 398,076                                          | (2,480)                      |



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Futures (Fortsetzung)

#### Candriam L Dynamic Asset Allocation (Fortsetzung)

| Anzahl<br>(Kauf/(Verkauf))   | Bezeichnung         | Währung | Gegenpartei    | Verpflichtung<br>(in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|------------------------------|---------------------|---------|----------------|--------------------------------------------------|------------------------------|
| <b>Futures auf Index</b>     |                     |         |                |                                                  |                              |
| (4)                          | US 10YR NOTE 0926   | USD     | J.P. Morgan SE | 348,675                                          | (1,585)                      |
| 6                            | EUROBOND            | EUR     | J.P. Morgan SE | 588,378                                          | 8,540                        |
| <b>Futures auf Währungen</b> |                     |         |                |                                                  |                              |
| 3                            | BRAZIL REAL /202608 | USD     | J.P. Morgan SE | 50,836                                           | 499                          |
|                              |                     |         |                |                                                  | <b>9,043</b>                 |

#### Candriam L Multi-Asset Income

| Anzahl<br>(Kauf/(Verkauf))   | Bezeichnung          | Währung | Gegenpartei    | Verpflichtung<br>(in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|------------------------------|----------------------|---------|----------------|--------------------------------------------------|------------------------------|
| <b>Futures auf Index</b>     |                      |         |                |                                                  |                              |
| 24                           | EMINI ENERGY /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 2,351,530                                        | (94,253)                     |
| 37                           | EM RUSS 2000 /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 4,893,798                                        | 91,370                       |
| 180                          | DJ.STOXX600 /202609  | EUR     | J.P. Morgan SE | 5,060,430                                        | 142,389                      |
| 33                           | TOPIX (OSE) /202609  | JPY     | J.P. Morgan SE | 7,094,541                                        | 162,178                      |
| 146                          | ZTS MSCI EMER 0926   | USD     | J.P. Morgan SE | 12,122,610                                       | (225,100)                    |
| 31                           | DJ.STOXX600 /202609  | EUR     | J.P. Morgan SE | 1,198,522                                        | (99,310)                     |
| 92                           | DJ.STOXX600. /202609 | EUR     | J.P. Morgan SE | 2,247,974                                        | (71,300)                     |
| 334                          | EURO STOXX BANK IDX  | EUR     | J.P. Morgan SE | 4,904,790                                        | 93,520                       |
| 86                           | DJE 600 INDUS 0926   | EUR     | J.P. Morgan SE | 5,031,258                                        | 45,150                       |
| (461)                        | STOXX EUR 60 /202609 | EUR     | J.P. Morgan SE | 14,791,877                                       | (116,065)                    |
| <b>Futures auf Anleihen</b>  |                      |         |                |                                                  |                              |
| (128)                        | ONG GILT FU /202609  | GBP     | J.P. Morgan SE | 9,555,719                                        | (86,185)                     |
| 525                          | EUROBOND             | EUR     | J.P. Morgan SE | 51,483,075                                       | 740,249                      |
| <b>Futures auf Währungen</b> |                      |         |                |                                                  |                              |
| 241                          | BRAZIL REAL /202608  | USD     | J.P. Morgan SE | 4,083,796                                        | 40,051                       |
|                              |                      |         |                |                                                  | <b>622,694</b>               |

#### Candriam L Multi-Asset Income & Growth

| Anzahl<br>(Kauf/(Verkauf))   | Bezeichnung          | Währung | Gegenpartei    | Verpflichtung<br>(in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|------------------------------|----------------------|---------|----------------|--------------------------------------------------|------------------------------|
| <b>Futures auf Index</b>     |                      |         |                |                                                  |                              |
| (110)                        | STOXX EUR 60 /202609 | EUR     | J.P. Morgan SE | 3,529,515                                        | (22,550)                     |
| (4)                          | SP 500 MINI 0926     | USD     | J.P. Morgan SE | 1,311,880                                        | 13,636                       |
| 17                           | DJ.STOXX600 /202609  | EUR     | J.P. Morgan SE | 657,254                                          | (55,583)                     |
| 78                           | DJ.STOXX600 /202609  | EUR     | J.P. Morgan SE | 2,192,853                                        | 61,702                       |
| 19                           | TOPIX (OSE) /202609  | JPY     | J.P. Morgan SE | 4,084,736                                        | 87,991                       |
| 21                           | EM RUSS 2000 /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 2,777,561                                        | 51,859                       |
| 13                           | EMINI ENERGY /202609 | USD     | J.P. Morgan SE | 1,273,745                                        | (51,054)                     |
| (92)                         | EURO STOXX 50 0926   | EUR     | J.P. Morgan SE | 5,821,843                                        | (44,160)                     |
| 53                           | DJ.STOXX600. /202609 | EUR     | J.P. Morgan SE | 1,295,029                                        | (41,075)                     |
| 49                           | DJE 600 INDUS 0926   | EUR     | J.P. Morgan SE | 2,866,647                                        | 25,725                       |
| 191                          | EURO STOXX BANK IDX  | EUR     | J.P. Morgan SE | 2,804,835                                        | 53,480                       |
| 125                          | ZTS MSCI EMER 0926   | USD     | J.P. Morgan SE | 10,378,947                                       | (207,981)                    |
| <b>Futures auf Anleihen</b>  |                      |         |                |                                                  |                              |
| 78                           | EUROBOND             | EUR     | J.P. Morgan SE | 7,648,914                                        | 109,980                      |
| (37)                         | ONG GILT FU /202609  | GBP     | J.P. Morgan SE | 2,762,200                                        | (24,913)                     |
| <b>Futures auf Währungen</b> |                      |         |                |                                                  |                              |
| 67                           | BRAZIL REAL /202608  | USD     | J.P. Morgan SE | 1,135,329                                        | 11,134                       |
|                              |                      |         |                |                                                  | <b>(31,809)</b>              |

Siehe Anhangangabe 9 über Barmittel bei Brokern im Zusammenhang mit Futures.



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Differenzkontrakte

Zum 30. Juni 2026 waren die folgenden CFD-Kontrakte ausstehend:

#### Candriam L Alternative Multi-Strategies

| Anzahl | Long / Short Position | Währung | Basiswert                           | Gegenpartei                         | Nennwert (in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert (in EUR) |
|--------|-----------------------|---------|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------------|---------------------------|
| 46,000 | Short                 | USD     | PELTON INTERAC - REGISTERED SHS -A- | UBS Europe SE Frankfurt             | 237,785                                  | 22,934                    |
| 10,000 | Short                 | EUR     | ING GROEP NV                        | Morgan Stanley Europe SE            | 276,700                                  | (26,696)                  |
| 10,000 | Short                 | USD     | UNIVERSAL TECHNICAL INSTITUTE       | UBS Europe SE Frankfurt             | 374,093                                  | (12,070)                  |
| 6,500  | Short                 | SGD     | DBS GROUP HOLDINGS LTD              | UBS Europe SE Frankfurt             | 287,463                                  | (3,402)                   |
| 6,000  | Short                 | USD     | BANCO SANTANDER SA-SPON ADR         | J.P. Morgan SE                      | 72,422                                   | (7,662)                   |
| 5,500  | Short                 | JPY     | NOMURA RESEARCH INSTITUTE LT        | UBS Europe SE Frankfurt             | 135,920                                  | 15,481                    |
| 3,100  | Short                 | USD     | ALPHABET INC-CL C                   | UBS Europe SE Frankfurt             | 958,036                                  | (50,814)                  |
| 2,500  | Short                 | USD     | APOGEE THERAPEUTICS INC             | Citibank Europe plc, Germany Branch | 290,234                                  | (248)                     |
| 1,000  | Long                  | USD     | AECOM                               | UBS Europe SE Frankfurt             | 61,051                                   | (2,143)                   |
| 1,000  | Long                  | USD     | MSC INDUSTRIAL DIRECT CO-A          | UBS Europe SE Frankfurt             | 104,041                                  | 6,184                     |
| 1,000  | Long                  | USD     | EXPEDIA GROUP INC                   | J.P. Morgan SE                      | 223,808                                  | 17,434                    |
| 3,500  | Long                  | USD     | APPLE INC                           | UBS Europe SE Frankfurt             | 885,822                                  | 16,822                    |
| 7,900  | Long                  | USD     | ROCKET COS INC-CLASS A              | UBS Europe SE Frankfurt             | 108,830                                  | 10,848                    |
| 9,000  | Long                  | NOK     | KONGSBERG GRUPPEN ASA               | Morgan Stanley Europe SE            | 237,301                                  | (19,570)                  |
| 11,000 | Long                  | USD     | TETRA TECH INC                      | UBS Europe SE Frankfurt             | 277,959                                  | 4,535                     |
| 15,000 | Long                  | USD     | PINTEREST INC- CLASS A              | UBS Europe SE Frankfurt             | 275,912                                  | (4,198)                   |
| 16,000 | Long                  | EUR     | CREDIT AGRICOLE SA                  | Morgan Stanley Europe SE            | 281,520                                  | 18,320                    |
| 32,000 | Long                  | SEK     | HEXAGON AB-B SHS                    | Morgan Stanley Europe SE            | 231,707                                  | (19,145)                  |
| 33,000 | Long                  | JPY     | JAPAN POST HOLDINGS CO LTD          | UBS Europe SE Frankfurt             | 385,206                                  | 23,798                    |
| 8,300  | Long                  | JPY     | SEIKO EPSON CORP                    | UBS Europe SE Frankfurt             | 120,470                                  | (10,117)                  |
| 8,300  | Long                  | JPY     | FUJITSU LIMITED                     | UBS Europe SE Frankfurt             | 145,037                                  | (16,404)                  |
| 1,000  | Short                 | JPY     | TOKYO SEIMITSU CO LTD               | UBS Europe SE Frankfurt             | 108,334                                  | (17,066)                  |
| 1,368  | Long                  | USD     | DECKERS OUTDOOR CORP                | J.P. Morgan SE                      | 118,804                                  | (13,413)                  |
| 410    | Long                  | USD     | HUBSPOT INC                         | UBS Europe SE Frankfurt             | 65,450                                   | (28,578)                  |
| 250    | Long                  | USD     | CHEMED CORP                         | UBS Europe SE Frankfurt             | 101,841                                  | 9,381                     |
| 3,403  | Long                  | DKK     | ISS A/S                             | Citibank Europe plc, Germany Branch | 121,828                                  | 1,275                     |
| 710    | Short                 | USD     | AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC        | UBS Europe SE Frankfurt             | 182,068                                  | (8,874)                   |
| 1,940  | Long                  | USD     | WEX INC                             | UBS Europe SE Frankfurt             | 239,408                                  | (14,135)                  |
| 10,600 | Long                  | EUR     | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA         | Morgan Stanley Europe SE            | 162,604                                  | 5,406                     |
| 10,600 | Long                  | JPY     | CANON INC                           | UBS Europe SE Frankfurt             | 236,570                                  | (10,442)                  |
| 160    | Long                  | CAD     | CELESTICA INC                       | UBS Europe SE Frankfurt             | 51,021                                   | (7,003)                   |
| 10,400 | Long                  | JPY     | CENTRAL JAPAN RAILWAY CO            | UBS Europe SE Frankfurt             | 194,159                                  | 3,974                     |
| 2,300  | Short                 | USD     | O'REILLY AUTOMOTIVE INC             | UBS Europe SE Frankfurt             | 185,259                                  | (10,964)                  |
| 13,491 | Long                  | GBP     | SMITH & NEPHEW PLC                  | Citibank Europe plc, Germany Branch | 170,791                                  | (6,343)                   |
| 2,900  | Long                  | EUR     | SYMRISE AG                          | Morgan Stanley Europe SE            | 254,678                                  | 30,682                    |
| 2,000  | Long                  | USD     | M & T BANK CORP                     | UBS Europe SE Frankfurt             | 416,356                                  | 22,431                    |
| 2,000  | Long                  | JPY     | ENEOS HOLDINGS INC                  | UBS Europe SE Frankfurt             | 12,884                                   | (732)                     |
| 3,800  | Long                  | EUR     | SOCIETE GENERALE SA                 | Morgan Stanley Europe SE            | 294,006                                  | 24,890                    |
| 3,800  | Long                  | JPY     | AGC INC                             | UBS Europe SE Frankfurt             | 142,438                                  | (838)                     |
| 6,300  | Long                  | USD     | OVINTIV INC                         | UBS Europe SE Frankfurt             | 290,121                                  | (30,252)                  |
| 5,100  | Long                  | USD     | SCOTTS MIRACLE-GRO CO               | UBS Europe SE Frankfurt             | 303,823                                  | 41,842                    |
| 8,400  | Long                  | JPY     | KYOCERA CORP                        | UBS Europe SE Frankfurt             | 160,980                                  | 1,040                     |
| 8,400  | Long                  | JPY     | DENTSU GROUP INC                    | UBS Europe SE Frankfurt             | 140,004                                  | (585)                     |
| 28,600 | Long                  | JPY     | MITSUBISHI CHEMICAL GROUP CO        | UBS Europe SE Frankfurt             | 173,695                                  | 5,695                     |
| 700    | Short                 | EUR     | ALLIANZ SE-REG                      | Morgan Stanley Europe SE            | 289,870                                  | (23,651)                  |
| 700    | Short                 | USD     | MARVELL TECHNOLOGY INC              | UBS Europe SE Frankfurt             | 182,387                                  | 6,162                     |
| 4,400  | Short                 | USD     | SUNBELT RENTALS HOLDINGS INC        | UBS Europe SE Frankfurt             | 287,907                                  | (2,933)                   |
| 118    | Short                 | USD     | CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A        | J.P. Morgan SE                      | 78,764                                   | 1,964                     |
| 4,300  | Short                 | NOK     | AKER BP ASA                         | Citibank Europe plc, Germany Branch | 115,239                                  | 6,879                     |
| 4,300  | Short                 | USD     | FASTENAL CO                         | UBS Europe SE Frankfurt             | 180,643                                  | (15,195)                  |
| 4,800  | Long                  | USD     | DRAFTKINGS INC-CL A                 | UBS Europe SE Frankfurt             | 106,051                                  | (4,492)                   |
| 4,800  | Long                  | USD     | SCHWAB (CHARLES) CORP               | UBS Europe SE Frankfurt             | 387,384                                  | 2,278                     |
| 4,800  | Long                  | CAD     | OCEANAGOLD CORP                     | UBS Europe SE Frankfurt             | 105,200                                  | (5,389)                   |
| 2,400  | Long                  | JPY     | TOTO LTD                            | UBS Europe SE Frankfurt             | 111,220                                  | 13,355                    |
| 3,600  | Long                  | USD     | OPTION CARE HEALTH INC              | UBS Europe SE Frankfurt             | 66,030                                   | 1,606                     |



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Differenzkontrakte (Fortsetzung)

#### Candriam L Alternative Multi-Strategies (Fortsetzung)

| Anzahl | Long / Short Position | Währung | Basiswert                    | Gegenpartei                         | Nennwert<br>(in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|--------|-----------------------|---------|------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------------|------------------------------|
| 3,600  | Long                  | USD     | BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | UBS Europe SE Frankfurt             | 191,036                                     | (73,618)                     |
| 22,200 | Long                  | NOK     | KONGSBERG MARITIME AS        | UBS Europe SE Frankfurt             | 100,546                                     | (12,284)                     |
| 10,200 | Long                  | JPY     | SUMITOMO MITSUI TRUST GROUP  | UBS Europe SE Frankfurt             | 332,489                                     | 29,551                       |
| 1,500  | Short                 | JPY     | RESONAC HOLDINGS CORP        | UBS Europe SE Frankfurt             | 142,884                                     | 5,893                        |
| 24,000 | Short                 | JPY     | AZBIL CORP                   | UBS Europe SE Frankfurt             | 222,092                                     | (22,276)                     |
| 9,000  | Short                 | EUR     | DSM-FIRMENICH AG             | Morgan Stanley Europe SE            | 747,000                                     | (104,400)                    |
| 7,300  | Long                  | EUR     | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV   | Morgan Stanley Europe SE            | 530,418                                     | 24,966                       |
| 7,300  | Long                  | USD     | KBR INC                      | UBS Europe SE Frankfurt             | 220,475                                     | (7,151)                      |
| 26,500 | Long                  | JPY     | JFE HOLDINGS INC             | UBS Europe SE Frankfurt             | 222,480                                     | (8,519)                      |
| 7,500  | Long                  | JPY     | BROTHER INDUSTRIES LTD       | UBS Europe SE Frankfurt             | 148,172                                     | (2,301)                      |
| 4,500  | Long                  | USD     | ANTERO MIDSTREAM CORP        | UBS Europe SE Frankfurt             | 89,543                                      | 7,557                        |
| 600    | Short                 | USD     | CREDIT ACCEPTANCE CORP       | UBS Europe SE Frankfurt             | 334,159                                     | (30,010)                     |
| 23,000 | Long                  | EUR     | CAIXABANK SA                 | Morgan Stanley Europe SE            | 284,855                                     | 18,975                       |
| 3,300  | Long                  | EUR     | VOESTALPINE AG               | Morgan Stanley Europe SE            | 134,772                                     | (18,084)                     |
| 3,300  | Long                  | NOK     | EQUINOR ASA                  | Morgan Stanley Europe SE            | 91,444                                      | (11,522)                     |
| 15,800 | Long                  | JPY     | OTSUKA CORP                  | UBS Europe SE Frankfurt             | 235,833                                     | (23,214)                     |
| 2,800  | Long                  | USD     | QUALYS INC                   | UBS Europe SE Frankfurt             | 336,720                                     | 57,437                       |
| 2,800  | Long                  | USD     | JARDINE MATHESON HOLDINGS    | Citibank Europe plc, Germany Branch | 150,617                                     | (11,021)                     |
| 2,800  | Long                  | JPY     | ROHM CO LTD                  | UBS Europe SE Frankfurt             | 81,130                                      | 3,044                        |
| 2,800  | Long                  | JPY     | THK CO LTD                   | UBS Europe SE Frankfurt             | 110,334                                     | (6,555)                      |
| 1,100  | Short                 | JPY     | KONAMI GROUP CORP            | UBS Europe SE Frankfurt             | 104,575                                     | 12,601                       |
| 4,000  | Short                 | JPY     | TDK CORP                     | UBS Europe SE Frankfurt             | 76,851                                      | 11,495                       |
| 16,300 | Short                 | GBP     | HSBC HOLDINGS PLC            | Morgan Stanley Europe SE            | 270,746                                     | (9,121)                      |
| 19,400 | Short                 | JPY     | CANON MARKETING JAPAN INC    | UBS Europe SE Frankfurt             | 359,362                                     | 13,401                       |
| 7,018  | Long                  | USD     | KEYCORP                      | Morgan Stanley Europe SE            | 141,489                                     | 1,616                        |
| 16,600 | Long                  | JPY     | KDDI CORP                    | UBS Europe SE Frankfurt             | 245,228                                     | 5,144                        |
| 3,900  | Short                 | USD     | SERVICETITAN INC-A           | UBS Europe SE Frankfurt             | 241,204                                     | 23,776                       |
| 800    | Short                 | JPY     | HIROSE ELECTRIC CO LTD       | UBS Europe SE Frankfurt             | 124,145                                     | (1,916)                      |
| 800    | Short                 | JPY     | HORIBA LTD                   | UBS Europe SE Frankfurt             | 118,010                                     | (3,466)                      |
| 3,000  | Short                 | USD     | GULFPORT ENERGY              | UBS Europe SE Frankfurt             | 445,290                                     | (134)                        |
| 3,000  | Short                 | JPY     | ORACLE CORP JAPAN            | UBS Europe SE Frankfurt             | 134,004                                     | 13,046                       |
| 3,000  | Short                 | JPY     | RENESAS ELECTRONICS CORP     | UBS Europe SE Frankfurt             | 77,610                                      | (6,297)                      |
| 4,300  | Long                  | USD     | AMAZON.COM INC               | UBS Europe SE Frankfurt             | 896,407                                     | 20,987                       |
| 900    | Long                  | USD     | CROWN HOLDINGS INC           | UBS Europe SE Frankfurt             | 88,024                                      | 13,603                       |
| 900    | Long                  | USD     | ENCOMPASS HEALTH CORP        | UBS Europe SE Frankfurt             | 79,570                                      | (1,299)                      |
| 9,300  | Short                 | USD     | MOSAIC CO/THE                | UBS Europe SE Frankfurt             | 172,367                                     | 17,408                       |
| 5,200  | Short                 | USD     | INTERNATIONAL PAPER CO       | UBS Europe SE Frankfurt             | 173,288                                     | (20,058)                     |
| 5,200  | Short                 | JPY     | HITACHI LTD                  | UBS Europe SE Frankfurt             | 125,120                                     | 17,537                       |
| 419    | Short                 | USD     | MOHAWK INDUSTRIES INC        | Morgan Stanley Europe SE            | 44,465                                      | (4,381)                      |
| 1,300  | Long                  | USD     | QUALCOMM INC                 | UBS Europe SE Frankfurt             | 210,117                                     | (47,060)                     |
| 1,300  | Long                  | USD     | TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | UBS Europe SE Frankfurt             | 113,319                                     | (2,017)                      |
| 1,300  | Long                  | JPY     | HOYA CORP                    | UBS Europe SE Frankfurt             | 181,552                                     | 579                          |
| 389    | Short                 | USD     | AVIS BUDGET GROUP            | Morgan Stanley Europe SE            | 50,298                                      | 9,368                        |
| 1,147  | Long                  | USD     | EPAM SYSTEMS INC             | J.P. Morgan SE                      | 79,607                                      | (27,467)                     |
| 203    | Long                  | USD     | WESTERN DIGITAL CORP         | Morgan Stanley Europe SE            | 113,409                                     | (4,288)                      |
| 1,461  | Long                  | USD     | SUPER MICRO COMPUTER INC     | J.P. Morgan SE                      | 37,480                                      | (22,427)                     |
| 2,971  | Short                 | EUR     | SPIE SA                      | Citibank Europe plc, Germany Branch | 149,738                                     | (1,486)                      |
| 2,130  | Short                 | USD     | LOAR HOLDINGS INC            | Morgan Stanley Europe SE            | 150,179                                     | (20,383)                     |
| 1,900  | Long                  | USD     | SPX TECHNOLOGIES INC         | UBS Europe SE Frankfurt             | 407,437                                     | 40,300                       |
| 1,900  | Long                  | USD     | NEXTPOWER INC-CL A           | UBS Europe SE Frankfurt             | 197,994                                     | (43,009)                     |
| 180    | Short                 | USD     | CARLISLE COS INC             | Morgan Stanley Europe SE            | 57,111                                      | (1,275)                      |
| 180    | Short                 | USD     | TEXAS PACIFIC LAND CORP      | J.P. Morgan SE                      | 68,902                                      | (10,928)                     |
| 8,100  | Long                  | USD     | BANK OF AMERICA CORP         | UBS Europe SE Frankfurt             | 403,689                                     | 5,406                        |
| 500    | Short                 | USD     | IRON MOUNTAIN INC            | J.P. Morgan SE                      | 55,239                                      | 31                           |
| 500    | Short                 | USD     | ARM HOLDINGS PLC-ADR         | UBS Europe SE Frankfurt             | 155,064                                     | 37,067                       |
| 2,600  | Long                  | CAD     | PAN AMERICAN SILVER CORP     | UBS Europe SE Frankfurt             | 101,913                                     | (9,394)                      |
| 6,500  | Long                  | EUR     | AXA SA                       | Morgan Stanley Europe SE            | 285,025                                     | 27,820                       |
| 11,500 | Long                  | GBP     | STANDARD CHARTERED PLC       | Morgan Stanley Europe SE            | 272,481                                     | 4,272                        |
| 2,400  | Short                 | JPY     | KOKUSAI ELECTRIC CORP        | UBS Europe SE Frankfurt             | 140,204                                     | (42,106)                     |
| 400    | Short                 | USD     | REVOLUTION MEDICINES INC     | J.P. Morgan SE                      | 65,523                                      | (8,257)                      |



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Differenzkontrakte (Fortsetzung)

#### Candriam L Alternative Multi-Strategies (Fortsetzung)

| Anzahl | Long / Short Position | Währung | Basiswert                    | Gegenpartei              | Nennwert<br>(in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|--------|-----------------------|---------|------------------------------|--------------------------|---------------------------------------------|------------------------------|
| 400    | Short                 | JPY     | KEYENCE CORP                 | UBS Europe SE Frankfurt  | 174,496                                     | (4,753)                      |
| 7,100  | Long                  | EUR     | COMMERZBANK AG               | Morgan Stanley Europe SE | 264,333                                     | 1,775                        |
| 7,100  | Long                  | JPY     | SHISEIDO CO LTD              | UBS Europe SE Frankfurt  | 100,034                                     | 2,091                        |
| 9,700  | Short                 | USD     | INVENTRUST PROPERTIES CORP   | UBS Europe SE Frankfurt  | 300,341                                     | (9,166)                      |
| 500    | Long                  | EUR     | HERMES INTERNATIONAL         | Morgan Stanley Europe SE | 799,000                                     | (5,750)                      |
| 500    | Long                  | USD     | BLOOM ENERGY CORP- A         | UBS Europe SE Frankfurt  | 132,380                                     | 12,766                       |
| 28,900 | Long                  | JPY     | RICOH CO LTD                 | UBS Europe SE Frankfurt  | 218,677                                     | (9,487)                      |
| 4,200  | Short                 | USD     | LENNAR CORP-A                | UBS Europe SE Frankfurt  | 332,422                                     | (4,445)                      |
| 2,800  | Short                 | JPY     | TREND MICRO INC              | UBS Europe SE Frankfurt  | 90,141                                      | 5,324                        |
| 2,800  | Short                 | JPY     | RAKUTEN BANK LTD             | UBS Europe SE Frankfurt  | 77,906                                      | (10,126)                     |
| 942    | Long                  | USD     | SALESFORCE INC               | J.P. Morgan SE           | 129,077                                     | (39,274)                     |
| 7,400  | Long                  | USD     | SOFI TECHNOLOGIES INC        | UBS Europe SE Frankfurt  | 116,052                                     | (4,207)                      |
| 7,400  | Long                  | JPY     | NEXON CO LTD                 | UBS Europe SE Frankfurt  | 85,444                                      | (5,827)                      |
| 7,400  | Long                  | JPY     | ASAHI INTECC CO LTD          | UBS Europe SE Frankfurt  | 151,333                                     | 3,982                        |
| 996    | Long                  | USD     | NETFLIX INC                  | Morgan Stanley Europe SE | 62,201                                      | (1,718)                      |
| 312    | Long                  | USD     | GENERAL ELECTRIC             | J.P. Morgan SE           | 101,989                                     | 13,562                       |
| 1,119  | Short                 | USD     | INSMED INC                   | Morgan Stanley Europe SE | 104,354                                     | (7,644)                      |
| 68     | Long                  | USD     | COMFORT SYSTEMS USA INC      | J.P. Morgan SE           | 117,880                                     | 10,750                       |
| 1,865  | Short                 | USD     | IONQ INC                     | J.P. Morgan SE           | 86,880                                      | 26,133                       |
| 510    | Long                  | USD     | FERGUSON ENTERPRISES INC     | UBS Europe SE Frankfurt  | 105,867                                     | 5,777                        |
| 983    | Long                  | USD     | ACCENTURE PLC-CL A           | Morgan Stanley Europe SE | 106,993                                     | (944)                        |
| 225    | Long                  | USD     | FLEX LTD                     | J.P. Morgan SE           | 31,895                                      | 2,767                        |
| 1,634  | Short                 | USD     | SEA LTD-ADR                  | J.P. Morgan SE           | 136,960                                     | (2,914)                      |
| 859    | Short                 | USD     | ENTEGRIS INC                 | J.P. Morgan SE           | 135,135                                     | (33,569)                     |
| 742    | Long                  | USD     | WORKDAY INC-CLASS A          | J.P. Morgan SE           | 79,450                                      | (22,592)                     |
| 5,300  | Short                 | JPY     | KAWASAKI HEAVY INDUSTRIES    | UBS Europe SE Frankfurt  | 83,359                                      | 344                          |
| 915    | Short                 | USD     | SERVICENOW INC               | J.P. Morgan SE           | 79,455                                      | 11,905                       |
| 5,600  | Long                  | JPY     | SEIBU HOLDINGS INC           | UBS Europe SE Frankfurt  | 95,626                                      | 11,348                       |
| 5,600  | Long                  | JPY     | YOKOGAWA ELECTRIC CORP       | UBS Europe SE Frankfurt  | 169,825                                     | 17,184                       |
| 7,500  | Short                 | USD     | LAZARD INC                   | UBS Europe SE Frankfurt  | 275,125                                     | 15,394                       |
| 5,300  | Long                  | USD     | PRIMO BRANDS CORP            | UBS Europe SE Frankfurt  | 113,297                                     | (232)                        |
| 8,200  | Short                 | USD     | NATL HEALTH INVESTORS INC    | UBS Europe SE Frankfurt  | 546,954                                     | 9,444                        |
| 1,100  | Long                  | USD     | SCIENCE APPLICATIONS INTE    | UBS Europe SE Frankfurt  | 106,228                                     | (4,493)                      |
| 1,100  | Long                  | USD     | SELECTIVE INSURANCE GROUP    | UBS Europe SE Frankfurt  | 93,336                                      | 10,478                       |
| 1,100  | Long                  | USD     | HEALTHEQUITY INC             | UBS Europe SE Frankfurt  | 86,899                                      | (308)                        |
| 1,100  | Long                  | USD     | SOUTHWEST GAS HOLDINGS INC   | UBS Europe SE Frankfurt  | 85,321                                      | 4,031                        |
| 1,100  | Long                  | USD     | TEXAS INSTRUMENTS INC        | UBS Europe SE Frankfurt  | 286,781                                     | (23,944)                     |
| 1,100  | Long                  | USD     | ABBVIE INC                   | UBS Europe SE Frankfurt  | 242,110                                     | (1,718)                      |
| 82     | Long                  | USD     | EMCOR GROUP INC              | J.P. Morgan SE           | 59,521                                      | (77)                         |
| 1,274  | Long                  | AUD     | BRAMBLES LTD                 | UBS Europe SE Frankfurt  | 15,039                                      | 2,069                        |
| 932    | Long                  | USD     | ATRIUM THERAPEUTICS INC      | UBS Europe SE Frankfurt  | 10,964                                      | 628                          |
| 88     | Long                  | USD     | DELL TECHNOLOGIES -C         | Morgan Stanley Europe SE | 33,210                                      | 2,797                        |
| 88     | Long                  | USD     | REGENERON PHARMACEUTICALS    | J.P. Morgan SE           | 47,994                                      | 925                          |
| 711    | Long                  | USD     | ILLUMINA INC                 | J.P. Morgan SE           | 109,346                                     | 7,108                        |
| 3,800  | Short                 | USD     | ROLLINS INC                  | UBS Europe SE Frankfurt  | 138,732                                     | 15,223                       |
| 366    | Long                  | USD     | NEWMONT CORP                 | J.P. Morgan SE           | 29,900                                      | (4,735)                      |
| 1,101  | Long                  | USD     | ATMOS ENERGY CORP            | Morgan Stanley Europe SE | 165,896                                     | 3,938                        |
| 159    | Short                 | USD     | FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI | J.P. Morgan SE           | 14,209                                      | 382                          |
| 3,014  | Short                 | CAD     | RESTAURANT BRANDS INTERN     | UBS Europe SE Frankfurt  | 191,147                                     | (4,069)                      |
| 2,082  | Short                 | USD     | ROBLOX CORP -CLASS A         | J.P. Morgan SE           | 99,028                                      | (13,439)                     |
| 682    | Short                 | USD     | THE CIGNA GROUP              | J.P. Morgan SE           | 164,448                                     | 37                           |
| 89     | Long                  | USD     | NORTHERN TRUST CORP          | J.P. Morgan SE           | 13,533                                      | 428                          |
| 360    | Long                  | USD     | INTERDIGITAL INC             | UBS Europe SE Frankfurt  | 89,151                                      | 8,462                        |
| 3,200  | Long                  | USD     | GARRETT MOTION INC           | Morgan Stanley Europe SE | 101,405                                     | 14,051                       |
| 2,500  | Long                  | USD     | GENPACT LTD                  | UBS Europe SE Frankfurt  | 60,133                                      | (15,197)                     |
| 2,500  | Long                  | USD     | ZILLOW GROUP INC - C         | UBS Europe SE Frankfurt  | 68,923                                      | (10,343)                     |
| 2,500  | Long                  | JPY     | FUJI CORP                    | UBS Europe SE Frankfurt  | 112,989                                     | 13,438                       |
| 1,170  | Short                 | USD     | NUCOR CORP                   | UBS Europe SE Frankfurt  | 227,952                                     | 29,411                       |
| 5,900  | Long                  | JPY     | NEC CORP                     | UBS Europe SE Frankfurt  | 124,627                                     | (12,468)                     |
| 550    | Long                  | USD     | HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | UBS Europe SE Frankfurt  | 107,710                                     | (106,389)                    |
| 320    | Short                 | CAD     | TC ENERGY CORP               | UBS Europe SE Frankfurt  | 18,529                                      | (470)                        |



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Differenzkontrakte (Fortsetzung)

#### Candriam L Alternative Multi-Strategies (Fortsetzung)

| Anzahl | Long / Short Position | Währung | Basiswert                      | Gegenpartei              | Nennwert<br>(in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|--------|-----------------------|---------|--------------------------------|--------------------------|---------------------------------------------|------------------------------|
| 270    | Long                  | USD     | GRAHAM HOLDINGS CO-CLASS B     | UBS Europe SE Frankfurt  | 269,556                                     | 7,389                        |
| 270    | Long                  | USD     | SPOTIFY TECHNOLOGY SA          | J.P. Morgan SE           | 108,427                                     | (11,484)                     |
| 270    | Long                  | USD     | MONGODB INC                    | J.P. Morgan SE           | 79,326                                      | (16,054)                     |
| 700    | Long                  | USD     | CREDO TECHNOLOGY GROUP HOLDI   | UBS Europe SE Frankfurt  | 166,505                                     | 28,072                       |
| 700    | Long                  | USD     | DYCOM INDUSTRIES INC           | UBS Europe SE Frankfurt  | 309,554                                     | 7,163                        |
| 4,700  | Long                  | GBP     | CRODA INTERNATIONAL PLC        | Morgan Stanley Europe SE | 164,997                                     | 1,855                        |
| 2,990  | Short                 | USD     | SLB LTD                        | J.P. Morgan SE           | 121,582                                     | 21,602                       |
| 630    | Long                  | GBP     | INTERNATIONAL PERSONAL FINAN   | UBS Europe SE Frankfurt  | 1,814                                       | 0                            |
| 300    | Short                 | JPY     | MARUWA CO LTD                  | UBS Europe SE Frankfurt  | 114,307                                     | 9,396                        |
| 300    | Short                 | JPY     | LASERTEC CORP                  | UBS Europe SE Frankfurt  | 80,241                                      | (18,276)                     |
| 11,200 | Short                 | USD     | PAYMENTUS HOLDINGS INC-A       | UBS Europe SE Frankfurt  | 236,676                                     | 980                          |
| 200    | Short                 | JPY     | DISCO CORP                     | UBS Europe SE Frankfurt  | 87,463                                      | (18,836)                     |
| 5,640  | Long                  | GBP     | WEIR GROUP PLC/THE             | Morgan Stanley Europe SE | 157,401                                     | 1,179                        |
| 1,200  | Long                  | USD     | SERVICE CORP INTERNATIONAL     | UBS Europe SE Frankfurt  | 79,727                                      | 2,970                        |
| 1,200  | Long                  | USD     | NEW YORK TIMES CO-A            | UBS Europe SE Frankfurt  | 73,451                                      | (6,539)                      |
| 7,700  | Long                  | USD     | ANTERO RESOURCES CORP          | UBS Europe SE Frankfurt  | 236,664                                     | (10,911)                     |
| 90     | Long                  | USD     | COSTCO WHOLESALE CORP          | UBS Europe SE Frankfurt  | 173,640                                     | (1,366)                      |
| 790    | Short                 | USD     | VULCAN MATERIALS CO            | UBS Europe SE Frankfurt  | 203,847                                     | (9,294)                      |
| 440    | Long                  | USD     | JAZZ PHARMACEUTICALS PLC       | Morgan Stanley Europe SE | 92,738                                      | 6,016                        |
| 440    | Long                  | USD     | MODINE MANUFACTURING CO        | UBS Europe SE Frankfurt  | 102,763                                     | (11,777)                     |
| 440    | Long                  | USD     | LPL FINANCIAL HOLDINGS INC     | UBS Europe SE Frankfurt  | 108,405                                     | (2,473)                      |
| 350    | Short                 | USD     | IDEXX LABORATORIES INC         | UBS Europe SE Frankfurt  | 161,160                                     | 12,352                       |
| 350    | Short                 | USD     | CUMMINS INC                    | UBS Europe SE Frankfurt  | 218,336                                     | (21,340)                     |
| 13,600 | Long                  | JPY     | DAI NIPPON PRINTING CO LTD     | UBS Europe SE Frankfurt  | 216,426                                     | 16,975                       |
| 800    | Long                  | EUR     | AURUBIS AG                     | Morgan Stanley Europe SE | 144,960                                     | (26,880)                     |
| 800    | Long                  | USD     | INGREDION INC                  | UBS Europe SE Frankfurt  | 66,271                                      | (4,926)                      |
| 800    | Long                  | USD     | AON PLC-CLASS A                | UBS Europe SE Frankfurt  | 232,093                                     | 2,030                        |
| 800    | Long                  | USD     | HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN   | UBS Europe SE Frankfurt  | 231,232                                     | (1,749)                      |
| 800    | Long                  | USD     | HOWARD HUGHES HOLDINGS INC     | Morgan Stanley Europe SE | 50,024                                      | 6,018                        |
| 800    | Long                  | USD     | ADVANCED ENERGY INDUSTRIES INC | UBS Europe SE Frankfurt  | 260,908                                     | 54,733                       |
| 1,600  | Short                 | USD     | WALMART INC                    | UBS Europe SE Frankfurt  | 158,503                                     | 1,875                        |
| 190    | Long                  | USD     | TD SYNEX CORP                  | Morgan Stanley Europe SE | 44,428                                      | (2,311)                      |
| 1,200  | Short                 | USD     | SIMON PROPERTY GROUP INC       | UBS Europe SE Frankfurt  | 234,742                                     | 3,329                        |
| 1,200  | Short                 | JPY     | MURATA MANUFACTURING CO LTD    | UBS Europe SE Frankfurt  | 73,589                                      | (5,845)                      |
| 600    | Long                  | USD     | VERTEX PHARMACEUTICALS INC     | UBS Europe SE Frankfurt  | 260,682                                     | 2,751                        |
| 600    | Long                  | USD     | ASTERA LABS INC                | UBS Europe SE Frankfurt  | 253,487                                     | 85,505                       |
| 600    | Long                  | USD     | AMERIPRISE FINANCIAL INC       | UBS Europe SE Frankfurt  | 240,756                                     | 3,051                        |
| 930    | Long                  | USD     | EXXON MOBIL CORP               | Morgan Stanley Europe SE | 111,213                                     | (1,921)                      |
| 187    | Short                 | USD     | STRATEGY INC                   | Morgan Stanley Europe SE | 14,218                                      | 3,214                        |
| 650    | Long                  | CHF     | FLUGHAFEN ZURICH AG-REG        | Morgan Stanley Europe SE | 176,200                                     | 13,814                       |
| 1,700  | Long                  | USD     | SONOCO PRODUCTS CO             | UBS Europe SE Frankfurt  | 83,788                                      | 12,431                       |
| 1,700  | Long                  | USD     | TKO GROUP HOLDINGS INC         | UBS Europe SE Frankfurt  | 299,333                                     | 3,673                        |
| 1,700  | Long                  | USD     | FEDERATED HERMES INC           | UBS Europe SE Frankfurt  | 82,108                                      | (996)                        |
| 1,700  | Long                  | USD     | BORGWARNER INC                 | UBS Europe SE Frankfurt  | 98,732                                      | (6,929)                      |
| 1,800  | Long                  | USD     | CIRRUS LOGIC INC               | UBS Europe SE Frankfurt  | 233,844                                     | (30,228)                     |
| 1,800  | Long                  | USD     | BANK OF NEW YORK MELLON CORP   | UBS Europe SE Frankfurt  | 227,673                                     | 1,585                        |
| 1,800  | Long                  | JPY     | SOFTBANK GROUP CORP            | UBS Europe SE Frankfurt  | 57,764                                      | (24,973)                     |
| 1,800  | Long                  | JPY     | TAISEI CORP                    | UBS Europe SE Frankfurt  | 138,041                                     | 9,135                        |
| 200    | Long                  | EUR     | ASML HOLDING NV                | Morgan Stanley Europe SE | 344,280                                     | 12,621                       |
| 666    | Long                  | USD     | DOORDASH INC - A               | J.P. Morgan SE           | 107,493                                     | 11,505                       |
| 400    | Long                  | USD     | FEDEX CORP                     | UBS Europe SE Frankfurt  | 109,553                                     | (8,873)                      |
| 400    | Long                  | USD     | NELNET INC-CL A                | Morgan Stanley Europe SE | 46,647                                      | 1,459                        |
| 400    | Long                  | JPY     | ADVANTEST CORP                 | UBS Europe SE Frankfurt  | 69,618                                      | 13,991                       |
| 400    | Long                  | JPY     | SHIONOGI & CO LTD              | UBS Europe SE Frankfurt  | 6,004                                       | (164)                        |
| 2,600  | Short                 | JPY     | ZENSHO HOLDINGS CO LTD         | UBS Europe SE Frankfurt  | 112,849                                     | (2,683)                      |
| 1,500  | Long                  | CHF     | ACCELLERON INDUSTRIES AG       | Morgan Stanley Europe SE | 134,996                                     | 9,271                        |
| 1,500  | Long                  | USD     | COLUMBIA SPORTSWEAR CO         | UBS Europe SE Frankfurt  | 81,107                                      | (5,497)                      |
| 1,500  | Long                  | JPY     | SCREEN HOLDINGS CO LTD         | UBS Europe SE Frankfurt  | 143,732                                     | 55,943                       |



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Differenzkontrakte (Fortsetzung)

#### Candriam L Alternative Multi-Strategies (Fortsetzung)

| Anzahl  | Long / Short Position | Währung | Basiswert                    | Gegenpartei                         | Nennwert<br>(in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|---------|-----------------------|---------|------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------------|------------------------------|
| 300     | Long                  | JPY     | RECRUIT HOLDINGS CO LTD      | UBS Europe SE Frankfurt             | 18,292                                      | 694                          |
| 300     | Long                  | JPY     | KIOXIA HOLDINGS CORP         | UBS Europe SE Frankfurt             | 144,789                                     | 27,737                       |
| 4,600   | Long                  | EUR     | ENI SPA                      | Morgan Stanley Europe SE            | 94,852                                      | (11,040)                     |
| 4,600   | Long                  | USD     | BRIDGEBIO PHARMA INC         | UBS Europe SE Frankfurt             | 299,666                                     | 36,694                       |
| 2,900   | Short                 | JPY     | OMRON CORP                   | UBS Europe SE Frankfurt             | 90,520                                      | 3,593                        |
| 830     | Short                 | USD     | WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | UBS Europe SE Frankfurt             | 260,623                                     | (30,999)                     |
| 12,600  | Long                  | JPY     | TOHO CO LTD                  | UBS Europe SE Frankfurt             | 88,186                                      | 6,069                        |
| 4,000   | Long                  | EUR     | TENARIS SA                   | Morgan Stanley Europe SE            | 96,840                                      | (10,880)                     |
| 4,000   | Long                  | USD     | NEWMARK GROUP INC            | Morgan Stanley Europe SE            | 52,865                                      | 3,953                        |
| 1,050   | Short                 | USD     | ALBEMARLE CORP               | UBS Europe SE Frankfurt             | 124,011                                     | 33,154                       |
| 670     | Long                  | USD     | COCA-COLA CO/THE             | UBS Europe SE Frankfurt             | 47,626                                      | (812)                        |
| 290     | Short                 | USD     | SYNOPSIS INC                 | Citibank Europe plc, Germany Branch | 113,146                                     | 2,108                        |
| 330     | Short                 | USD     | MARTIN MARIETTA MATERIALS    | UBS Europe SE Frankfurt             | 166,458                                     | (1,657)                      |
| 845     | Short                 | USD     | AST SPACEMOBILE INC          | Morgan Stanley Europe SE            | 65,675                                      | (12,447)                     |
| 111     | Long                  | USD     | INTUITIVE SURGICAL INC       | Morgan Stanley Europe SE            | 38,610                                      | (583)                        |
| 108     | Long                  | USD     | FAIR ISAAC CORP              | J.P. Morgan SE                      | 112,863                                     | (8,499)                      |
| 444     | Short                 | USD     | INTL BUSINESS MACHINES CORP  | J.P. Morgan SE                      | 109,208                                     | 15,227                       |
| 15,743  | Long                  | USD     | PARAGON 28 INC               | J.P. Morgan SE                      | 1,239                                       | 0                            |
| 70      | Long                  | CHF     | GIVAUDAN-REG                 | Morgan Stanley Europe SE            | 259,583                                     | 43,491                       |
| 70      | Long                  | USD     | FIRST CITIZENS BCSHS -CL A   | UBS Europe SE Frankfurt             | 127,399                                     | 8,638                        |
| 70      | Long                  | USD     | JPMORGAN CHASE & CO          | Morgan Stanley Europe SE            | 20,041                                      | (140)                        |
| 52      | Long                  | USD     | COHERENT CORP                | Morgan Stanley Europe SE            | 17,941                                      | 258                          |
| 166     | Short                 | CHF     | KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 35,270                                      | (1,422)                      |
| 612     | Long                  | USD     | MCDONALD'S CORP              | Morgan Stanley Europe SE            | 144,695                                     | (2,719)                      |
| 130     | Long                  | USD     | MICRON TECHNOLOGY INC        | Morgan Stanley Europe SE            | 131,250                                     | 8,638                        |
| 309     | Long                  | USD     | FIRST SOLAR INC              | J.P. Morgan SE                      | 63,773                                      | (18,119)                     |
| 58      | Long                  | USD     | MICRON TECHNOLOGY INC        | J.P. Morgan SE                      | 58,558                                      | 6,026                        |
| 93      | Long                  | USD     | JABIL INC                    | J.P. Morgan SE                      | 31,356                                      | 2,075                        |
| 7,000   | Long                  | USD     | RANGE RESOURCES CORP         | UBS Europe SE Frankfurt             | 227,701                                     | (15,858)                     |
| 190,000 | Short                 | HKD     | SINO LAND CO                 | UBS Europe SE Frankfurt             | 217,850                                     | 30,845                       |
| 72,000  | Short                 | NOK     | VAR ENERGI ASA               | Morgan Stanley Europe SE            | 262,136                                     | 36,975                       |
| 1,360   | Short                 | USD     | CORNING INC                  | UBS Europe SE Frankfurt             | 303,844                                     | (93,652)                     |
| 5,800   | Long                  | NOK     | SUBSEA 7 SA                  | Morgan Stanley Europe SE            | 173,280                                     | 13,534                       |
| 618     | Short                 | USD     | OWENS CORNING                | Morgan Stanley Europe SE            | 85,924                                      | (18,998)                     |
| 576     | Long                  | USD     | ADOBE INC                    | J.P. Morgan SE                      | 103,290                                     | (34,768)                     |
| 3,058   | Long                  | EUR     | NORTH ATLANTIC ENERGIES      | Citibank Europe plc, Germany Branch | 134,552                                     | (15,718)                     |
| 865     | Short                 | EUR     | ESSILORLUXOTTICA             | Citibank Europe plc, Germany Branch | 141,903                                     | 17,300                       |
| 185     | Short                 | USD     | AKAMAI TECHNOLOGIES INC      | J.P. Morgan SE                      | 19,128                                      | 3,822                        |
| 4,900   | Long                  | EUR     | TECHNOPROBE SPA              | Morgan Stanley Europe SE            | 171,010                                     | 9,800                        |
| 720     | Long                  | USD     | INSULET CORP                 | J.P. Morgan SE                      | 95,880                                      | 2,595                        |
| 14,600  | Long                  | JPY     | AEON CO LTD                  | UBS Europe SE Frankfurt             | 105,366                                     | (1,193)                      |
| 370     | Long                  | USD     | HEICO CORP                   | UBS Europe SE Frankfurt             | 115,272                                     | 7,424                        |
| 740     | Long                  | CAD     | SHOPIFY INC - CLASS A        | UBS Europe SE Frankfurt             | 74,025                                      | (4,293)                      |
| 810     | Long                  | EUR     | ACKERMANS & VAN HAAREN       | Morgan Stanley Europe SE            | 231,498                                     | 16,362                       |
| 1,225   | Short                 | USD     | IPG PHOTONICS CORP           | Morgan Stanley Europe SE            | 125,704                                     | (5,832)                      |
| 10,300  | Long                  | USD     | AVANTOR INC                  | UBS Europe SE Frankfurt             | 89,189                                      | 6,396                        |
| 10,500  | Long                  | JPY     | TOKYO GAS CO LTD             | UBS Europe SE Frankfurt             | 345,885                                     | (3,051)                      |
| 830     | Long                  | USD     | AUTODESK INC                 | J.P. Morgan SE                      | 141,143                                     | (34,255)                     |
| 11,500  | Short                 | USD     | DMY TECHNOLOGY GROUP INC     | UBS Europe SE Frankfurt             | 299,143                                     | (6,626)                      |
| 430     | Short                 | CHF     | ZURICH INSURANCE GROUP AG    | Morgan Stanley Europe SE            | 279,098                                     | (21,821)                     |
| 2,840   | Long                  | USD     | US FOODS HOLDING CORP        | UBS Europe SE Frankfurt             | 253,993                                     | 52,214                       |
| 570     | Long                  | USD     | REDDIT INC-CL A              | UBS Europe SE Frankfurt             | 86,539                                      | (2,129)                      |
| 45      | Long                  | USD     | INCYTE CORP                  | J.P. Morgan SE                      | 4,462                                       | 699                          |
| 1,523   | Long                  | USD     | AMPHENOL CORP-CL A           | J.P. Morgan SE                      | 234,877                                     | 39,937                       |
| 734     | Long                  | USD     | POPULAR INC                  | Morgan Stanley Europe SE            | 105,404                                     | 10,520                       |
| 351     | Short                 | USD     | WINGSTOP INC                 | Morgan Stanley Europe SE            | 53,238                                      | (5,877)                      |
| 1,387   | Long                  | USD     | EXPAND ENERGY CORP           | Morgan Stanley Europe SE            | 110,628                                     | 1,358                        |
| 131     | Long                  | USD     | GE VERNOVA INC               | J.P. Morgan SE                      | 134,616                                     | 26,018                       |
| 652     | Short                 | USD     | SMURFIT WESTROCK PLC         | Morgan Stanley Europe SE            | 26,381                                      | (738)                        |
| 412     | Long                  | USD     | EVERCORE INC - A             | Morgan Stanley Europe SE            | 123,041                                     | (9,132)                      |



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Differenzkontrakte (Fortsetzung)

#### Candriam L Alternative Multi-Strategies (Fortsetzung)

| Anzahl  | Long / Short Position | Währung | Basiswert                    | Gegenpartei                         | Nennwert (in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert (in EUR) |
|---------|-----------------------|---------|------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------------|---------------------------|
| 662     | Short                 | DKK     | DSV A/S                      | Citibank Europe plc, Germany Branch | 137,185                                  | 3,587                     |
| 1,820   | Long                  | USD     | COCA-COLA CONSOLIDATED INC   | UBS Europe SE Frankfurt             | 303,922                                  | 28,418                    |
| 488     | Long                  | USD     | INTEL CORP                   | Morgan Stanley Europe SE            | 59,599                                   | 13,679                    |
| 3,138   | Long                  | USD     | BLUEPRINT MEDICINES CVR      | J.P. Morgan SE                      | 1,263                                    | 1,262                     |
| 49      | Long                  | USD     | TERADYNE INC                 | Morgan Stanley Europe SE            | 20,737                                   | 3,059                     |
| 321     | Long                  | USD     | LAS VEGAS SANDS CORP         | J.P. Morgan SE                      | 12,969                                   | (1,296)                   |
| 3,100   | Long                  | USD     | CITIGROUP INC                | UBS Europe SE Frankfurt             | 379,494                                  | (8,522)                   |
| 3,100   | Long                  | USD     | GUARDANT HEALTH INC          | UBS Europe SE Frankfurt             | 406,799                                  | 56,642                    |
| 3,100   | Long                  | JPY     | OTSUKA HOLDINGS CO LTD       | UBS Europe SE Frankfurt             | 180,263                                  | 8,791                     |
| 210     | Short                 | USD     | UNITED RENTALS INC           | UBS Europe SE Frankfurt             | 208,088                                  | (24,810)                  |
| 228     | Long                  | USD     | ADVANCED MICRO DEVICES       | Morgan Stanley Europe SE            | 115,847                                  | 14,585                    |
| 3,593   | Short                 | NOK     | SALMAR ASA                   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 147,105                                  | 27,090                    |
| 1,993   | Long                  | USD     | ABBOTT LABORATORIES          | Morgan Stanley Europe SE            | 158,178                                  | 4,723                     |
| 236     | Long                  | USD     | VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | J.P. Morgan SE                      | 36,633                                   | 382                       |
| 2,244   | Long                  | USD     | EDISON INTERNATIONAL         | J.P. Morgan SE                      | 146,126                                  | 10,520                    |
| 4,600   | Short                 | USD     | ESTABLISHMENT LABS HOLDINGS  | UBS Europe SE Frankfurt             | 345,251                                  | (71,336)                  |
| 4,600   | Short                 | USD     | HINGE HEALTH INC-A           | UBS Europe SE Frankfurt             | 333,946                                  | (88,838)                  |
| 551     | Short                 | USD     | NATERA INC                   | J.P. Morgan SE                      | 130,822                                  | (25,667)                  |
| 588     | Long                  | USD     | DAVITA INC                   | J.P. Morgan SE                      | 114,422                                  | 16,802                    |
| 1,485   | Short                 | USD     | TEMPUS AI INC-CL A           | Morgan Stanley Europe SE            | 75,244                                   | (11,596)                  |
| 2,700   | Long                  | USD     | MICROSOFT CORP               | UBS Europe SE Frankfurt             | 880,918                                  | (146)                     |
| 2,700   | Long                  | USD     | ENSIGN GROUP INC/THE         | UBS Europe SE Frankfurt             | 378,562                                  | (11,099)                  |
| 3,600   | Short                 | USD     | SUPER MICRO COMPUTER INC     | Morgan Stanley Europe SE            | 92,354                                   | 32,915                    |
| 3,600   | Short                 | USD     | NICOLET BANKSHARES INC       | UBS Europe SE Frankfurt             | 520,777                                  | (58,517)                  |
| 302     | Short                 | USD     | DATADOG INC - CLASS A        | J.P. Morgan SE                      | 68,773                                   | (7,594)                   |
| 1,407   | Short                 | USD     | CARVANA CO                   | J.P. Morgan SE                      | 81,001                                   | 6,029                     |
| 11,600  | Long                  | USD     | AMERICAN HEALTHCARE REIT INC | UBS Europe SE Frankfurt             | 529,117                                  | 49,919                    |
| 12,500  | Long                  | EUR     | RYANAIR HOLDINGS PLC         | Morgan Stanley Europe SE            | 341,875                                  | 36,875                    |
| 582     | Long                  | USD     | CME GROUP INC                | Morgan Stanley Europe SE            | 112,414                                  | (16,697)                  |
| 2,711   | Long                  | USD     | PENUMBRA INC                 | Citibank Europe plc, Germany Branch | 748,708                                  | (8,513)                   |
| 31,901  | Short                 | EUR     | POSTE ITALIANE SPA           | Citibank Europe plc, Germany Branch | 913,007                                  | (41,708)                  |
| 101,041 | Long                  | GBP     | BEAZLEY PLC                  | Citibank Europe plc, Germany Branch | 1,509,633                                | 3,784                     |
| 770     | Long                  | USD     | KLA CORP                     | J.P. Morgan SE                      | 203,198                                  | 72,539                    |
| 770     | Long                  | USD     | S&P GLOBAL INC               | Citibank Europe plc, Germany Branch | 274,285                                  | 2,487                     |
| 35,723  | Short                 | USD     | KENVUE INC                   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 597,102                                  | (33,120)                  |
| 2,803   | Short                 | USD     | BOSTON SCIENTIFIC CORP       | Citibank Europe plc, Germany Branch | 104,637                                  | 13,876                    |
| 5,184   | Long                  | USD     | KIMBERLY-CLARK CORP          | Citibank Europe plc, Germany Branch | 497,724                                  | 37,135                    |
| 3,187   | Short                 | USD     | BROWN & BROWN INC            | J.P. Morgan SE                      | 178,821                                  | (19,758)                  |
| 3,187   | Short                 | USD     | INTERNATIONAL MONEY EXPRESS  | Citibank Europe plc, Germany Branch | 40,280                                   | 613                       |
| 146,351 | Long                  | EUR     | TELECOM ITALIA SPA           | Citibank Europe plc, Germany Branch | 1,164,661                                | 41,344                    |
| 1,069   | Short                 | EUR     | INFINEON TECHNOLOGIES AG     | Citibank Europe plc, Germany Branch | 87,305                                   | (983)                     |
| 3,928   | Short                 | EUR     | BECHTLE AG                   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 121,689                                  | 1,021                     |
| 1,789   | Short                 | EUR     | CTS EVENTIM AG & CO KGAA     | Citibank Europe plc, Germany Branch | 91,328                                   | 3,489                     |
| 598     | Long                  | DKK     | GENMAB A/S                   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 143,603                                  | 16,080                    |
| 889     | Short                 | EUR     | DEUTSCHE BOERSE AG           | Citibank Europe plc, Germany Branch | 212,293                                  | 7,912                     |
| 2,397   | Long                  | CHF     | NOVARTIS AG-REG              | Citibank Europe plc, Germany Branch | 328,991                                  | 16,530                    |
| 2,261   | Long                  | CHF     | ABB LTD-REG                  | Citibank Europe plc, Germany Branch | 214,712                                  | 12,258                    |
| 1,192   | Long                  | EUR     | STMICROELECTRONICS NV        | Citibank Europe plc, Germany Branch | 76,872                                   | (4,720)                   |
| 9,767   | Long                  | EUR     | CREDIT AGRICOLE SA           | Citibank Europe plc, Germany Branch | 171,850                                  | 6,495                     |
| 41,304  | Long                  | GBP     | BARCLAYS PLC                 | Citibank Europe plc, Germany Branch | 242,914                                  | 12,803                    |
| 298     | Short                 | CHF     | SWISS LIFE HOLDING AG-REG    | Citibank Europe plc, Germany Branch | 287,450                                  | (5,622)                   |
| 298     | Short                 | USD     | CLOUDFLARE INC - CLASS A     | J.P. Morgan SE                      | 63,932                                   | 6,657                     |
| 42,357  | Long                  | GBP     | KINGFISHER PLC               | Citibank Europe plc, Germany Branch | 139,256                                  | (1,131)                   |
| 7,866   | Long                  | EUR     | AZIMUT HOLDING SPA           | Citibank Europe plc, Germany Branch | 279,086                                  | (14,237)                  |
| 50,994  | Long                  | GBP     | SAINSBURY (J) PLC            | Citibank Europe plc, Germany Branch | 189,318                                  | 4,736                     |
| 2,337   | Long                  | EUR     | NORDEX SE                    | Citibank Europe plc, Germany Branch | 107,969                                  | 12,854                    |
| 2,911   | Long                  | EUR     | NESTE OYJ                    | Citibank Europe plc, Germany Branch | 83,371                                   | 5,880                     |
| 3,409   | Long                  | EUR     | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA | Citibank Europe plc, Germany Branch | 190,393                                  | 15,341                    |
| 1,209   | Short                 | EUR     | EIFFAGE                      | Citibank Europe plc, Germany Branch | 156,082                                  | (363)                     |
| 4,947   | Short                 | EUR     | ENGIE                        | Citibank Europe plc, Germany Branch | 136,488                                  | (1,435)                   |
| 7,652   | Short                 | SEK     | GETINGE AB-B SHS             | Citibank Europe plc, Germany Branch | 136,996                                  | (1,106)                   |



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Differenzkontrakte (Fortsetzung)

#### Candriam L Alternative Multi-Strategies (Fortsetzung)

| Anzahl  | Long / Short Position | Währung | Basiswert                    | Gegenpartei                         | Nennwert (in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert (in EUR) |
|---------|-----------------------|---------|------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------------|---------------------------|
| 2,953   | Short                 | DKK     | AL SYDBANK                   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 227,553                                  | (6,321)                   |
| 1,265   | Long                  | EUR     | IPSEN                        | Citibank Europe plc, Germany Branch | 213,532                                  | 15,939                    |
| 6,598   | Short                 | GBP     | WEIR GROUP PLC/THE           | Citibank Europe plc, Germany Branch | 184,137                                  | 3,064                     |
| 4,711   | Long                  | EUR     | SBM OFFSHORE NV              | Citibank Europe plc, Germany Branch | 142,932                                  | (11,024)                  |
| 1,308   | Long                  | CHF     | LOGITECH INTERNATIONAL-REG   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 107,420                                  | (18,182)                  |
| 31,106  | Long                  | GBP     | INVESTEC PLC                 | Citibank Europe plc, Germany Branch | 216,846                                  | (14,625)                  |
| 6,191   | Long                  | GBP     | WHITBREAD PLC                | Citibank Europe plc, Germany Branch | 171,844                                  | 144                       |
| 5,132   | Short                 | DKK     | ORSTED A/S                   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 100,788                                  | 5,458                     |
| 5,132   | Short                 | GBP     | 3I GROUP PLC                 | Citibank Europe plc, Germany Branch | 148,110                                  | (11,975)                  |
| 37,145  | Short                 | GBP     | AVIVA PLC                    | Citibank Europe plc, Germany Branch | 280,377                                  | (8,279)                   |
| 13,700  | Short                 | EUR     | BANKINTER SA                 | Citibank Europe plc, Germany Branch | 200,568                                  | (754)                     |
| 2,591   | Long                  | GBP     | FRESNILLO PLC                | Citibank Europe plc, Germany Branch | 82,446                                   | (13,806)                  |
| 304     | Short                 | EUR     | PUBLICIS GROUPE              | Citibank Europe plc, Germany Branch | 26,284                                   | 1,021                     |
| 1,916   | Long                  | EUR     | AIXTRON SE                   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 100,820                                  | (11,956)                  |
| 4,753   | Long                  | GBP     | ZEGONA COMMUNICATIONS PLC    | Citibank Europe plc, Germany Branch | 87,843                                   | (10,484)                  |
| 51,096  | Short                 | GBP     | HALEON PLC                   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 206,247                                  | (7,474)                   |
| 17,200  | Short                 | GBP     | ENTAIN PLC                   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 111,618                                  | 5,910                     |
| 5,973   | Short                 | EUR     | VOPAK                        | Citibank Europe plc, Germany Branch | 272,608                                  | (2,509)                   |
| 5,335   | Short                 | EUR     | EDENRED                      | Citibank Europe plc, Germany Branch | 120,038                                  | (7,789)                   |
| 3,290   | Short                 | EUR     | RENAULT SA                   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 82,513                                   | 12,239                    |
| 3,128   | Long                  | EUR     | EXOR NV                      | Citibank Europe plc, Germany Branch | 209,576                                  | (469)                     |
| 346     | Long                  | EUR     | NEMETSCHEK SE                | Citibank Europe plc, Germany Branch | 18,373                                   | (1,125)                   |
| 346     | Long                  | USD     | REGENERON PHARMACEUTICALS    | Morgan Stanley Europe SE            | 188,704                                  | 5,642                     |
| 3,523   | Short                 | EUR     | DR ING HC F PORSCHE AG       | Citibank Europe plc, Germany Branch | 153,286                                  | 22,195                    |
| 462     | Short                 | EUR     | SAP SE                       | Citibank Europe plc, Germany Branch | 61,908                                   | 4,241                     |
| 356     | Short                 | EUR     | SARTORIUS AG-VORZUG          | Citibank Europe plc, Germany Branch | 81,738                                   | (214)                     |
| 71      | Long                  | EUR     | ASML HOLDING NV              | Citibank Europe plc, Germany Branch | 122,219                                  | 7,043                     |
| 5,158   | Short                 | SEK     | SAGAX AB-B                   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 71,881                                   | 653                       |
| 3,724   | Long                  | EUR     | COMMERZBANK AG               | Citibank Europe plc, Germany Branch | 138,645                                  | 3,798                     |
| 1,564   | Long                  | GBP     | DCC PLC                      | Citibank Europe plc, Germany Branch | 113,296                                  | 1,543                     |
| 11,525  | Short                 | SEK     | TELE2 AB-B SHS               | Citibank Europe plc, Germany Branch | 175,661                                  | 12,291                    |
| 27,430  | Long                  | GBP     | BALFOUR BEATTY PLC           | Citibank Europe plc, Germany Branch | 276,242                                  | 9,075                     |
| 11,642  | Long                  | GBP     | SAGE GROUP PLC/THE           | Citibank Europe plc, Germany Branch | 110,284                                  | (1,433)                   |
| 3,147   | Short                 | GBP     | HALMA PLC                    | Citibank Europe plc, Germany Branch | 143,723                                  | 3,069                     |
| 6,888   | Short                 | GBP     | SSE PLC                      | Citibank Europe plc, Germany Branch | 194,790                                  | (4,798)                   |
| 4,023   | Long                  | GBP     | PEARSON PLC                  | Citibank Europe plc, Germany Branch | 55,857                                   | 2,615                     |
| 17,749  | Long                  | GBP     | PRUDENTIAL PLC               | Citibank Europe plc, Germany Branch | 206,666                                  | (618)                     |
| 264,485 | Long                  | GBP     | VODAFONE GROUP PLC           | Citibank Europe plc, Germany Branch | 305,813                                  | (39,608)                  |
| 78,803  | Long                  | GBP     | SENIOR PLC                   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 263,470                                  | 0                         |
| 1,252   | Short                 | EUR     | MERCK KGAA                   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 183,856                                  | (17,716)                  |
| 2,729   | Long                  | EUR     | VOESTALPINE AG               | Citibank Europe plc, Germany Branch | 111,452                                  | (17,684)                  |
| 1,448   | Long                  | EUR     | NN GROUP NV                  | Citibank Europe plc, Germany Branch | 111,004                                  | 4,344                     |
| 164     | Long                  | EUR     | ARGENX SE                    | Citibank Europe plc, Germany Branch | 133,070                                  | 8,233                     |
| 5,314   | Short                 | SEK     | AXFOOD AB                    | Citibank Europe plc, Germany Branch | 123,617                                  | 3,410                     |
| 187,349 | Long                  | EUR     | PERMANENT TSB GROUP HOLDINGS | Citibank Europe plc, Germany Branch | 562,047                                  | 5,620                     |
| 12,643  | Short                 | SEK     | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | Citibank Europe plc, Germany Branch | 162,936                                  | (4,628)                   |
| 8,621   | Short                 | SEK     | ASSA ABLOY AB-B              | Citibank Europe plc, Germany Branch | 266,772                                  | (3,350)                   |
| 10,858  | Short                 | EUR     | KESKO OYJ-B SHS              | Citibank Europe plc, Germany Branch | 212,382                                  | 3,149                     |
| 5,541   | Short                 | EUR     | NOKIA OYJ                    | Citibank Europe plc, Germany Branch | 64,026                                   | 5,430                     |
| 26,200  | Short                 | EUR     | INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | Citibank Europe plc, Germany Branch | 161,392                                  | 12,314                    |
| 3,299   | Short                 | EUR     | PUMA SE                      | Citibank Europe plc, Germany Branch | 87,687                                   | 4,718                     |
| 240,012 | Long                  | GBP     | ADVANCED MEDICAL SOLUTIONS   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 780,164                                  | 5,392                     |
| 1,317   | Short                 | EUR     | VINCI SA                     | Citibank Europe plc, Germany Branch | 168,313                                  | 66                        |
| 3,595   | Short                 | EUR     | SODEXO SA                    | Citibank Europe plc, Germany Branch | 182,087                                  | (1,079)                   |
| 99      | Short                 | EUR     | ASM INTERNATIONAL NV         | Citibank Europe plc, Germany Branch | 99,050                                   | 2,426                     |
| 8,264   | Long                  | EUR     | ING GROEP NV                 | Citibank Europe plc, Germany Branch | 228,665                                  | 11,115                    |
| 7,408   | Long                  | EUR     | GLANBIA PLC                  | Citibank Europe plc, Germany Branch | 181,200                                  | 20,446                    |
| 12,372  | Long                  | GBP     | CONVATEC GROUP PLC           | Citibank Europe plc, Germany Branch | 30,880                                   | 1,580                     |
| 20,838  | Short                 | EUR     | ITALGAS SPA                  | Citibank Europe plc, Germany Branch | 211,193                                  | 8,127                     |
| 1,895   | Short                 | EUR     | DELIVERY HERO SE             | Citibank Europe plc, Germany Branch | 68,220                                   | 3,222                     |



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Differenzkontrakte (Fortsetzung)

#### Candriam L Alternative Multi-Strategies (Fortsetzung)

| Anzahl | Long / Short Position | Währung | Basiswert                    | Gegenpartei                         | Nennwert (in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert (in EUR) |
|--------|-----------------------|---------|------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------------|---------------------------|
| 41,701 | Short                 | EUR     | PIRELLI & C SPA              | Citibank Europe plc, Germany Branch | 275,852                                  | (4,796)                   |
| 15,072 | Long                  | EUR     | AIB GROUP PLC                | Citibank Europe plc, Germany Branch | 154,865                                  | 452                       |
| 6,665  | Long                  | EUR     | RANDSTAD NV                  | Citibank Europe plc, Germany Branch | 168,025                                  | (13,330)                  |
| 347    | Short                 | EUR     | BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES  | Citibank Europe plc, Germany Branch | 99,624                                   | 9,438                     |
| 38,975 | Long                  | GBP     | JTC PLC                      | Citibank Europe plc, Germany Branch | 599,059                                  | 2,715                     |
| 5,339  | Long                  | EUR     | REPSOL SA                    | Citibank Europe plc, Germany Branch | 117,511                                  | 1,869                     |
| 9,533  | Short                 | CHF     | SIG GROUP AG                 | Citibank Europe plc, Germany Branch | 139,855                                  | (13,024)                  |
| 65,798 | Long                  | GBP     | ABERDEEN GROUP PLC           | Citibank Europe plc, Germany Branch | 181,949                                  | 917                       |
| 22,417 | Long                  | GBP     | STANDARD LIFE PLC            | Citibank Europe plc, Germany Branch | 216,779                                  | 9,889                     |
| 457    | Long                  | EUR     | DSM-FIRMENICH AG             | Citibank Europe plc, Germany Branch | 37,931                                   | 4,360                     |
| 40,450 | Short                 | EUR     | NEXI SPA                     | Citibank Europe plc, Germany Branch | 143,274                                  | (1,982)                   |
| 7,961  | Long                  | GBP     | ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | Citibank Europe plc, Germany Branch | 183,545                                  | 5,499                     |
| 1,168  | Short                 | CHF     | HELVETIA BALOISE HOLDING AG  | Citibank Europe plc, Germany Branch | 264,185                                  | (2,280)                   |
| 32,907 | Long                  | GBP     | AIRTEL AFRICA PLC            | Citibank Europe plc, Germany Branch | 125,149                                  | (14,593)                  |
| 4,025  | Long                  | EUR     | PROSUS NV                    | Citibank Europe plc, Germany Branch | 152,910                                  | (6,360)                   |
| 6,757  | Short                 | EUR     | FDJ UNITED                   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 144,532                                  | 11,149                    |
| 5,360  | Short                 | EUR     | ELISA OYJ                    | Citibank Europe plc, Germany Branch | 196,926                                  | 16,080                    |
| 605    | Long                  | EUR     | SIEMENS ENERGY AG            | Citibank Europe plc, Germany Branch | 100,309                                  | 5,808                     |
| 1,087  | Short                 | EUR     | HENSOLDT AG                  | Citibank Europe plc, Germany Branch | 73,655                                   | 4,326                     |
| 6,905  | Short                 | SEK     | LAGERCRANTZ GROUP AB-B SHS   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 159,005                                  | (2,995)                   |
| 10,428 | Short                 | GBP     | DIAGEO PLC                   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 184,312                                  | (2,542)                   |
| 2,095  | Long                  | EUR     | EUROFINS SCIENTIFIC          | Citibank Europe plc, Germany Branch | 143,633                                  | 10,852                    |
| 20,717 | Short                 | GBP     | BP PLC                       | Citibank Europe plc, Germany Branch | 112,339                                  | 12,001                    |
| 20,816 | Short                 | EUR     | STELLANTIS NV                | Citibank Europe plc, Germany Branch | 103,570                                  | 23,095                    |
| 79,286 | Long                  | EUR     | ALLFUNDS GROUP PLC           | Citibank Europe plc, Germany Branch | 666,795                                  | (13,479)                  |
| 4,244  | Long                  | DKK     | VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | Citibank Europe plc, Germany Branch | 104,810                                  | 8,517                     |
| 19,437 | Short                 | SEK     | HEXAGON AB-B SHS             | Citibank Europe plc, Germany Branch | 140,740                                  | (211)                     |
| 4,864  | Long                  | SEK     | INVESTOR AB-B SHS            | Citibank Europe plc, Germany Branch | 176,955                                  | 8,660                     |
| 8,269  | Short                 | EUR     | DASSAULT SYSTEMES SE         | Citibank Europe plc, Germany Branch | 147,312                                  | (3,597)                   |
| 7,750  | Long                  | USD     | ELECTRONIC ARTS INC          | Citibank Europe plc, Germany Branch | 1,389,889                                | 13,015                    |
| 9,718  | Long                  | EUR     | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | Citibank Europe plc, Germany Branch | 212,533                                  | 12,342                    |
| 3,544  | Long                  | EUR     | SACYR SA                     | Citibank Europe plc, Germany Branch | 16,572                                   | 64                        |
| 23,422 | Long                  | USD     | WARNER BROS DISCOVERY INC    | Citibank Europe plc, Germany Branch | 546,165                                  | (97)                      |
| 59,284 | Long                  | GBP     | TATE & LYLE PLC              | Citibank Europe plc, Germany Branch | 381,279                                  | (9,291)                   |
| 42,231 | Long                  | EUR     | AEGON LTD                    | Citibank Europe plc, Germany Branch | 314,114                                  | 1,858                     |
| 1,097  | Short                 | GBP     | ASTRAZENECA PLC              | Citibank Europe plc, Germany Branch | 179,565                                  | (11,462)                  |
| 1,097  | Short                 | USD     | CARVANA CO                   | Morgan Stanley Europe SE            | 63,155                                   | 250                       |
| 4,506  | Long                  | DKK     | ROCKWOOL A/S-B SHS           | Citibank Europe plc, Germany Branch | 126,110                                  | (4,340)                   |
| 4,961  | Short                 | SEK     | MYCRONIC AB                  | Citibank Europe plc, Germany Branch | 144,010                                  | (2,421)                   |
| 2,672  | Long                  | EUR     | AUMOVIO SE                   | Citibank Europe plc, Germany Branch | 96,192                                   | (13,761)                  |
| 8,668  | Short                 | EUR     | VERISURE PLC                 | Citibank Europe plc, Germany Branch | 84,600                                   | 8,148                     |
| 22,155 | Long                  | EUR     | TELECOM ITALIA SPA           | Citibank Europe plc, Germany Branch | 176,309                                  | 2,016                     |
| 1,433  | Long                  | CAD     | MANULIFE FINANCIAL CORP      | UBS Europe SE Frankfurt             | 50,816                                   | 4,656                     |
| 7,942  | Short                 | USD     | SILICON LABORATORIES INC     | UBS Europe SE Frankfurt             | 1,518,240                                | (3,738)                   |
| 22,736 | Short                 | CAD     | TELUS CORP                   | UBS Europe SE Frankfurt             | 210,252                                  | 32,333                    |
| 55,791 | Long                  | AUD     | SIGMA HEALTHCARE LTD         | UBS Europe SE Frankfurt             | 92,971                                   | (5,747)                   |
| 2,720  | Long                  | USD     | BRINK'S CO/THE               | UBS Europe SE Frankfurt             | 224,799                                  | (20,294)                  |
| 468    | Long                  | USD     | LANDSTAR SYSTEM INC          | UBS Europe SE Frankfurt             | 84,656                                   | (2,698)                   |
| 4,696  | Long                  | CAD     | KINROSS GOLD CORP            | UBS Europe SE Frankfurt             | 97,218                                   | (16,532)                  |
| 10,100 | Short                 | JPY     | FUJIFILM HOLDINGS CORP       | UBS Europe SE Frankfurt             | 189,319                                  | (5,544)                   |
| 10,100 | Short                 | SGD     | SEMBICORP INDUSTRIES LTD     | UBS Europe SE Frankfurt             | 43,370                                   | (478)                     |
| 19,100 | Short                 | SGD     | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | UBS Europe SE Frankfurt             | 320,185                                  | (9,170)                   |
| 290    | Long                  | USD     | ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | UBS Europe SE Frankfurt             | 76,357                                   | 1,370                     |
| 4,573  | Long                  | CAD     | FIRST QUANTUM MINERALS LTD   | UBS Europe SE Frankfurt             | 109,219                                  | (13,476)                  |
| 44,500 | Short                 | JPY     | NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS  | UBS Europe SE Frankfurt             | 223,536                                  | (8,884)                   |
| 3,190  | Long                  | USD     | EXLSERVICE HOLDINGS INC      | UBS Europe SE Frankfurt             | 72,154                                   | (10,318)                  |
| 6,358  | Long                  | NOK     | SUBSEA 7 SA                  | UBS Europe SE Frankfurt             | 189,950                                  | (9,092)                   |
| 8,162  | Short                 | AUD     | LYNAS RARE EARTHS LTD        | UBS Europe SE Frankfurt             | 89,323                                   | 1,684                     |
| 11,545 | Short                 | AUD     | GOODMAN GROUP                | UBS Europe SE Frankfurt             | 217,783                                  | 3,641                     |
| 5,840  | Long                  | USD     | DARLING INGREDIENTS INC      | UBS Europe SE Frankfurt             | 279,000                                  | (29,729)                  |



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Differenzkontrakte (Fortsetzung)

#### Candriam L Alternative Multi-Strategies (Fortsetzung)

| Anzahl  | Long / Short Position | Währung | Basiswert                    | Gegenpartei             | Nennwert<br>(in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|---------|-----------------------|---------|------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|------------------------------|
| 2,870   | Short                 | USD     | COOPER COS INC/THE           | UBS Europe SE Frankfurt | 180,012                                     | (28,918)                     |
| 46,600  | Short                 | HKD     | LINK REIT                    | UBS Europe SE Frankfurt | 189,710                                     | 14,787                       |
| 620     | Long                  | USD     | GRAND CANYON EDUCATION INC   | UBS Europe SE Frankfurt | 77,607                                      | (4,998)                      |
| 22,500  | Short                 | USD     | COEUR MINING INC             | UBS Europe SE Frankfurt | 321,176                                     | 23,315                       |
| 36,574  | Long                  | USD     | SELECT MEDICAL HOLDINGS CORP | UBS Europe SE Frankfurt | 527,833                                     | (320)                        |
| 7,676   | Short                 | AUD     | COMPUTERSHARE LTD            | UBS Europe SE Frankfurt | 178,056                                     | (15,675)                     |
| 1,420   | Long                  | USD     | SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS   | UBS Europe SE Frankfurt | 77,067                                      | (8,731)                      |
| 7,740   | Long                  | USD     | PILGRIM'S PRIDE CORP         | UBS Europe SE Frankfurt | 190,301                                     | (4,604)                      |
| 3       | Short                 | CAD     | CONSTELLATION SOFTWARE INC   | UBS Europe SE Frankfurt | 4,938                                       | 484                          |
| 13,890  | Long                  | USD     | STARWOOD PROPERTY            | UBS Europe SE Frankfurt | 199,001                                     | (5,103)                      |
| 1,560   | Short                 | USD     | CBRE GROUP INC - A           | UBS Europe SE Frankfurt | 183,781                                     | (13,713)                     |
| 1,580   | Short                 | USD     | XYLEM INC                    | UBS Europe SE Frankfurt | 163,362                                     | (13,654)                     |
| 6,246   | Short                 | CAD     | KEYERA CORP                  | UBS Europe SE Frankfurt | 219,373                                     | 1,282                        |
| 249,000 | Short                 | HKD     | HKT TRUST AND HKT LTD-SS     | UBS Europe SE Frankfurt | 323,824                                     | 14,298                       |
| 64,650  | Long                  | GBP     | SCHRODERS PLC                | UBS Europe SE Frankfurt | 440,932                                     | 3,002                        |
| 2,680   | Long                  | USD     | POST HOLDINGS INC            | UBS Europe SE Frankfurt | 206,890                                     | (2,039)                      |
| 1,250   | Long                  | USD     | ALLISON TRANSMISSION HOLDING | UBS Europe SE Frankfurt | 123,262                                     | 1,170                        |
| 1,250   | Long                  | USD     | NEWMONT CORP                 | UBS Europe SE Frankfurt | 102,117                                     | (11,394)                     |
| 2,260   | Long                  | USD     | JAZZ PHARMACEUTICALS PLC     | UBS Europe SE Frankfurt | 476,334                                     | 16,466                       |
| 6,127   | Long                  | AUD     | NORTHERN STAR RESOURCES LTD  | UBS Europe SE Frankfurt | 70,357                                      | 1,226                        |
| 820     | Long                  | USD     | POPULAR INC                  | UBS Europe SE Frankfurt | 117,754                                     | 11,762                       |
| 12,400  | Long                  | JPY     | IYOGIN HLDGS --- SHS         | UBS Europe SE Frankfurt | 210,076                                     | 4,543                        |
| 40,651  | Short                 | AUD     | QANTAS AIRWAYS LTD           | UBS Europe SE Frankfurt | 261,605                                     | (34,556)                     |
| 1,660   | Long                  | USD     | ARAMARK                      | UBS Europe SE Frankfurt | 82,615                                      | 3,644                        |
| 312,000 | Short                 | HKD     | HONG KONG & CHINA GAS        | UBS Europe SE Frankfurt | 226,193                                     | 20,986                       |
| 19,500  | Long                  | HKD     | SWIRE PACIFIC LTD - CL A     | UBS Europe SE Frankfurt | 177,692                                     | (2,879)                      |
| 141,113 | Short                 | USD     | CLEAR CHANNEL OUTDOOR HOLDIN | UBS Europe SE Frankfurt | 298,691                                     | (1,234)                      |
| 22,322  | Long                  | AUD     | TRANSURBAN GROUP             | UBS Europe SE Frankfurt | 194,510                                     | (10,206)                     |
| 11,951  | Short                 | AUD     | CAR GROUP LTD                | UBS Europe SE Frankfurt | 186,552                                     | 334                          |
| 203,462 | Long                  | EUR     | PERMANENT TSB GROUP HOLDINGS | UBS Europe SE Frankfurt | 610,386                                     | 14,242                       |
| 3,361   | Long                  | AUD     | WISETECH GLOBAL LTD          | UBS Europe SE Frankfurt | 67,210                                      | (12,525)                     |
| 34,400  | Short                 | JPY     | PAN PACIFIC INTERNATIONAL HO | UBS Europe SE Frankfurt | 152,362                                     | 377                          |
| 4,250   | Long                  | USD     | EURONET WORLDWIDE INC        | UBS Europe SE Frankfurt | 272,070                                     | (2,565)                      |
| 4,790   | Long                  | USD     | ROKU INC                     | UBS Europe SE Frankfurt | 578,755                                     | (4,112)                      |
| 7,440   | Long                  | USD     | CNX RESOURCES CORP           | UBS Europe SE Frankfurt | 220,799                                     | 3,059                        |
| 23,600  | Short                 | JPY     | SG HOLDINGS CO LTD           | UBS Europe SE Frankfurt | 195,974                                     | (14,566)                     |
| 26,269  | Long                  | AUD     | SANTOS LTD                   | UBS Europe SE Frankfurt | 114,770                                     | (9,392)                      |
| 1,959   | Short                 | AUD     | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | UBS Europe SE Frankfurt | 195,419                                     | (2,003)                      |
| 6,730   | Long                  | USD     | DOCUSIGN INC                 | UBS Europe SE Frankfurt | 261,477                                     | (74,170)                     |
| 10,261  | Long                  | GBP     | JTC PLC                      | UBS Europe SE Frankfurt | 157,715                                     | 953                          |
| 6,790   | Short                 | USD     | KEURIG DR PEPPER INC         | UBS Europe SE Frankfurt | 194,382                                     | (15,026)                     |
| 824     | Long                  | CAD     | BANK OF MONTREAL             | UBS Europe SE Frankfurt | 127,340                                     | 12,543                       |
| 3,003   | Short                 | AUD     | XERO LTD                     | UBS Europe SE Frankfurt | 131,420                                     | 15,886                       |
| 1,687   | Long                  | CAD     | CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   | UBS Europe SE Frankfurt | 203,172                                     | 19,404                       |
| 23,401  | Long                  | NOK     | ELMERA GROUP ASA             | UBS Europe SE Frankfurt | 96,181                                      | (255)                        |
| 266,200 | Short                 | JPY     | SOFTBANK CORP                | UBS Europe SE Frankfurt | 298,126                                     | 10,783                       |
| 8,200   | Long                  | JPY     | OBIC CO LTD                  | UBS Europe SE Frankfurt | 168,709                                     | (4,862)                      |
| 7,430   | Long                  | USD     | YETI HOLDINGS INC            | UBS Europe SE Frankfurt | 322,077                                     | 14,167                       |
| 4,642   | Short                 | USD     | FOX CORP - CLASS A           | UBS Europe SE Frankfurt | 211,779                                     | 482                          |
| 121,139 | Long                  | AUD     | TELSTRA GROUP LTD            | UBS Europe SE Frankfurt | 372,905                                     | (4,813)                      |
| 82,100  | Long                  | JPY     | LY CORP                      | UBS Europe SE Frankfurt | 191,669                                     | 6,438                        |
| 16,800  | Short                 | JPY     | ASAHI GROUP HOLDINGS LTD     | UBS Europe SE Frankfurt | 139,959                                     | (5,295)                      |
| 13,800  | Short                 | JPY     | SUMITOMO PHARMA CO LTD       | UBS Europe SE Frankfurt | 111,476                                     | 3,106                        |
| 17,800  | Long                  | JPY     | KIRIN HOLDINGS CO LTD        | UBS Europe SE Frankfurt | 269,230                                     | 18,714                       |
| 11,100  | Short                 | JPY     | SBI SHINSEI BANK LTD         | UBS Europe SE Frankfurt | 82,437                                      | (1,254)                      |
| 3,200   | Short                 | JPY     | NINTENDO CO LTD              | UBS Europe SE Frankfurt | 117,364                                     | 7,534                        |
| 101,200 | Long                  | JPY     | NIPPON STEEL CORP            | UBS Europe SE Frankfurt | 291,975                                     | (6,567)                      |
| 58,600  | Long                  | JPY     | NISSAN MOTOR CO LTD          | UBS Europe SE Frankfurt | 94,610                                      | (11,543)                     |



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Differenzkontrakte (Fortsetzung)

#### Candriam L Alternative Multi-Strategies (Fortsetzung)

| Anzahl  | Long / Short Position | Währung | Basiswert                    | Gegenpartei             | Nennwert (in EUR) (in absolutem Wert) | Nicht realisiert (in EUR) |
|---------|-----------------------|---------|------------------------------|-------------------------|---------------------------------------|---------------------------|
| 7,900   | Short                 | JPY     | SHIMADZU CORP                | UBS Europe SE Frankfurt | 174,994                               | (7,873)                   |
| 45,300  | Long                  | JPY     | SUMITOMO CHEMICAL CO LTD     | UBS Europe SE Frankfurt | 125,187                               | (18,041)                  |
| 14,700  | Short                 | JPY     | TERUMO CORP                  | UBS Europe SE Frankfurt | 176,734                               | 8,821                     |
| 32,300  | Short                 | JPY     | YAMAHA MOTOR CO LTD          | UBS Europe SE Frankfurt | 213,462                               | 8,778                     |
| 9,100   | Short                 | JPY     | SQUARE ENIX HOLDINGS CO LTD  | UBS Europe SE Frankfurt | 118,026                               | 4,436                     |
| 1,700   | Short                 | USD     | BUNGE GLOBAL SA              | UBS Europe SE Frankfurt | 158,699                               | 34,556                    |
| 1,700   | Short                 | JPY     | SHIMANO INC                  | UBS Europe SE Frankfurt | 158,688                               | (11,454)                  |
| 1,017   | Long                  | AUD     | PRO MEDICUS LTD              | UBS Europe SE Frankfurt | 125,368                               | 36,341                    |
| 10,020  | Long                  | NZD     | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | UBS Europe SE Frankfurt | 194,482                               | 10,300                    |
| 19,900  | Short                 | JPY     | ITOCHU CORP                  | UBS Europe SE Frankfurt | 198,556                               | 2,093                     |
| 12,800  | Short                 | SGD     | UNITED OVERSEAS BANK LTD     | UBS Europe SE Frankfurt | 344,149                               | (11,816)                  |
| 590     | Long                  | USD     | CHORD ENERGY CORP            | UBS Europe SE Frankfurt | 58,985                                | (12,230)                  |
| 20,210  | Long                  | USD     | NOV INC                      | UBS Europe SE Frankfurt | 327,907                               | (25,632)                  |
| 41,400  | Short                 | USD     | OPENDOOR TECHNOLOGIES INC    | UBS Europe SE Frankfurt | 167,295                               | 24,986                    |
| 4,050   | Long                  | USD     | TRAVEL + LEISURE CO          | UBS Europe SE Frankfurt | 270,744                               | 27,099                    |
| 32,500  | Short                 | USD     | EASTERN BANKSHARES INC       | UBS Europe SE Frankfurt | 632,205                               | (46,796)                  |
| 1,400   | Long                  | USD     | LIBERTY MEDIA CORP-FORMULA-C | UBS Europe SE Frankfurt | 116,501                               | 4,972                     |
| 18,100  | Long                  | JPY     | USS CO LTD                   | UBS Europe SE Frankfurt | 185,320                               | 12,264                    |
| 268,377 | Short                 | USD     | OLAPLEX HOLDINGS INC         | UBS Europe SE Frankfurt | 481,215                               | (181)                     |
| 4,047   | Short                 | CAD     | GILDAN ACTIVEWEAR INC        | UBS Europe SE Frankfurt | 182,434                               | 21,007                    |
| 7,600   | Long                  | JPY     | NIPPON EXPRESS HOLDINGS INC  | UBS Europe SE Frankfurt | 206,304                               | (8,344)                   |
| 1,010   | Short                 | USD     | CINTAS CORP                  | UBS Europe SE Frankfurt | 150,250                               | 2,491                     |
| 4,390   | Long                  | USD     | COMMERCIAL METALS CO         | UBS Europe SE Frankfurt | 240,945                               | (49,917)                  |
| 10,560  | Long                  | USD     | BLUE OWL CAPITAL INC         | UBS Europe SE Frankfurt | 80,819                                | (15,887)                  |
| 1,910   | Short                 | USD     | GENUINE PARTS CO             | UBS Europe SE Frankfurt | 197,098                               | (34,615)                  |
| 4,840   | Long                  | USD     | HAEMONETICS CORP/MASS        | UBS Europe SE Frankfurt | 317,502                               | 32,936                    |
| 1,650   | Long                  | USD     | HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | UBS Europe SE Frankfurt | 328,759                               | 114,668                   |
| 2,850   | Long                  | USD     | MURPHY OIL CORP              | UBS Europe SE Frankfurt | 81,165                                | (11,841)                  |
| 1,380   | Long                  | USD     | REGAL REXNORD CORP           | UBS Europe SE Frankfurt | 287,503                               | 43,574                    |
| 3,820   | Short                 | USD     | STARBUCKS CORP               | UBS Europe SE Frankfurt | 341,438                               | (5,521)                   |
| 1,840   | Long                  | USD     | TOLL BROTHERS INC            | UBS Europe SE Frankfurt | 265,145                               | 42,439                    |
| 4,419   | Long                  | CAD     | BROOKFIELD RENEWABLE CORP    | UBS Europe SE Frankfurt | 143,627                               | (3,271)                   |
| 42,031  | Short                 | NOK     | SAIPEM SPA                   | UBS Europe SE Frankfurt | 185,315                               | 11,114                    |
| 64      | Short                 | USD     | UNITEDHEALTH GROUP INC       | J.P. Morgan SE          | 23,266                                | (2,002)                   |
| 9,102   | Long                  | USD     | FORD MOTOR CO                | J.P. Morgan SE          | 110,660                               | (21,734)                  |
| 764     | Long                  | USD     | ON SEMICONDUCTOR             | J.P. Morgan SE          | 63,176                                | (17,628)                  |
| 2,747   | Short                 | USD     | GLOBAL PAYMENTS INC          | J.P. Morgan SE          | 174,339                               | 2,790                     |
| 748     | Long                  | USD     | ALIGN TECHNOLOGY INC         | J.P. Morgan SE          | 110,345                               | (873)                     |
| 2,499   | Short                 | USD     | JM SMUCKER CO/THE            | J.P. Morgan SE          | 245,900                               | (25,782)                  |
| 1,719   | Long                  | USD     | SKYWORKS SOLUTIONS INC       | J.P. Morgan SE          | 101,940                               | (11,562)                  |
| 985     | Short                 | USD     | DICK'S SPORTING GOODS INC    | J.P. Morgan SE          | 195,406                               | (8,913)                   |
| 1,203   | Short                 | USD     | MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | J.P. Morgan SE          | 95,962                                | 313                       |
| 578     | Short                 | USD     | STRATEGY INC                 | J.P. Morgan SE          | 43,948                                | 28,094                    |
| 2,468   | Short                 | USD     | SOMNIGROUP INTERNATIONAL INC | J.P. Morgan SE          | 169,239                               | (20,810)                  |
| 1,305   | Long                  | USD     | ALLSTATE CORP                | J.P. Morgan SE          | 271,593                               | 34,539                    |
| 7,561   | Long                  | EUR     | RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA  | J.P. Morgan SE          | 387,879                               | 3,531                     |
| 1,201   | Long                  | USD     | CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   | J.P. Morgan SE          | 113,724                               | (5,294)                   |
| 966     | Long                  | USD     | WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | J.P. Morgan SE          | 303,327                               | 33,082                    |
| 1,788   | Long                  | USD     | DEXCOM INC                   | J.P. Morgan SE          | 105,328                               | (11,760)                  |
| 2,354   | Long                  | USD     | AERCAP HOLDINGS NV           | J.P. Morgan SE          | 300,154                               | 19,163                    |
| 604     | Long                  | USD     | FORTINET INC                 | J.P. Morgan SE          | 81,157                                | 3,423                     |
| 604     | Long                  | USD     | ECHOSTAR CORP-A              | J.P. Morgan SE          | 53,622                                | (13,693)                  |
| 1,357   | Long                  | USD     | DOLLAR TREE INC              | J.P. Morgan SE          | 143,557                               | 11,394                    |
| 880     | Long                  | USD     | ALBEMARLE CORP               | J.P. Morgan SE          | 103,933                               | (21,505)                  |
| 248     | Short                 | USD     | COHERENT CORP                | J.P. Morgan SE          | 85,567                                | (6,848)                   |
| 248     | Short                 | USD     | TESLA INC                    | J.P. Morgan SE          | 91,235                                | (1,024)                   |
| 2,206   | Long                  | USD     | GENERAL MOTORS CO            | J.P. Morgan SE          | 148,726                               | (10,805)                  |
| 518     | Short                 | USD     | MOTOROLA SOLUTIONS INC       | J.P. Morgan SE          | 188,157                               | (1,681)                   |
| 30,833  | Long                  | CAD     | ARC RESOURCES LTD            | J.P. Morgan SE          | 566,458                               | (34,026)                  |



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Differenzkontrakte (Fortsetzung)

#### Candriam L Alternative Multi-Strategies (Fortsetzung)

| Anzahl  | Long / Short Position | Währung | Basiswert                            | Gegenpartei    | Nennwert<br>(in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|---------|-----------------------|---------|--------------------------------------|----------------|---------------------------------------------|------------------------------|
| 44,204  | Long                  | USD     | DIGITALBRIDGE GROUP INC              | J.P. Morgan SE | 610,110                                     | 4,253                        |
| 1,114   | Short                 | USD     | INSMED INC                           | J.P. Morgan SE | 103,888                                     | (575)                        |
| 602     | Long                  | USD     | HCA HEALTHCARE INC                   | J.P. Morgan SE | 205,295                                     | 11,668                       |
| 414     | Short                 | USD     | NXP SEMICONDUCTORS NV                | J.P. Morgan SE | 101,764                                     | 10,990                       |
| 1,584   | Long                  | USD     | CITIGROUP INC                        | J.P. Morgan SE | 193,909                                     | 15,060                       |
| 445     | Long                  | USD     | RALPH LAUREN CORP                    | J.P. Morgan SE | 156,238                                     | 13,231                       |
| 15,505  | Short                 | USD     | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN         | J.P. Morgan SE | 303,238                                     | (12,368)                     |
| 718     | Short                 | USD     | ATLASSIAN CORP-CL A                  | J.P. Morgan SE | 48,853                                      | 12,604                       |
| 2,193   | Long                  | USD     | ZOETIS INC                           | J.P. Morgan SE | 137,837                                     | (10,933)                     |
| 566     | Long                  | USD     | CREDO TECHNOLOGY GROUP HOLDI         | J.P. Morgan SE | 134,631                                     | 22,698                       |
| 2,499   | Long                  | USD     | SYNCHRONY FINANCIAL                  | J.P. Morgan SE | 166,228                                     | 11,506                       |
| 1,973   | Long                  | USD     | TOPBUILD CORP                        | J.P. Morgan SE | 735,420                                     | 24,101                       |
| 14,388  | Short                 | USD     | KRAFT HEINZ CO/THE                   | J.P. Morgan SE | 297,249                                     | (605)                        |
| 10,899  | Long                  | USD     | TAYLOR MORRISON HOME CORP            | J.P. Morgan SE | 683,892                                     | 1,694                        |
| 441     | Long                  | USD     | ALPHABET INC-CL A                    | J.P. Morgan SE | 137,847                                     | (5,947)                      |
| 1,609   | Long                  | USD     | CVS HEALTH CORP                      | J.P. Morgan SE | 145,588                                     | 8,924                        |
| 342     | Short                 | USD     | ASTERA LABS INC                      | J.P. Morgan SE | 144,488                                     | (48,738)                     |
| 1,845   | Short                 | USD     | IREN LTD                             | J.P. Morgan SE | 73,797                                      | 31,630                       |
| 8,411   | Long                  | USD     | P G & E CORP                         | J.P. Morgan SE | 123,741                                     | 4,929                        |
| 688     | Short                 | USD     | OKTA INC                             | J.P. Morgan SE | 82,111                                      | (11,816)                     |
| 21,091  | Long                  | USD     | JANUS HENDERSON GROUP LTD            | J.P. Morgan SE | 959,269                                     | 4,981                        |
| 884     | Short                 | USD     | TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE        | J.P. Morgan SE | 193,285                                     | (18,937)                     |
| 3,094   | Short                 | USD     | SAMSARA INC-CL A                     | J.P. Morgan SE | 87,762                                      | 16,562                       |
| 249     | Short                 | USD     | BROADCOM INC                         | J.P. Morgan SE | 82,270                                      | 17,907                       |
| 1,771   | Long                  | USD     | AVANOS MEDICAL INC                   | J.P. Morgan SE | 38,540                                      | (263)                        |
| 432     | Short                 | USD     | BLOOM ENERGY CORP- A                 | J.P. Morgan SE | 114,376                                     | (11,030)                     |
| 81,028  | Long                  | CAD     | INTERRENT REAL ESTATE INVEST         | J.P. Morgan SE | 647,405                                     | 1,998                        |
| 617     | Long                  | USD     | FUTU HOLDINGS LTD-ADR                | J.P. Morgan SE | 50,588                                      | (4,916)                      |
| 617     | Long                  | USD     | VALERO ENERGY CORP                   | J.P. Morgan SE | 140,551                                     | 4,274                        |
| 3,348   | Long                  | USD     | ARCOSA INC                           | J.P. Morgan SE | 425,462                                     | 2,503                        |
| 1,212   | Short                 | USD     | ARES MANAGEMENT CORP - A             | J.P. Morgan SE | 117,999                                     | 18,264                       |
| 163     | Long                  | USD     | DELL TECHNOLOGIES -C                 | J.P. Morgan SE | 61,513                                      | (4,919)                      |
| 1,558   | Long                  | USD     | INTERCONTINENTAL HOTELS GROU         | J.P. Morgan SE | 234,729                                     | 26,028                       |
| 5,102   | Long                  | USD     | FOX CORP - CLASS A                   | J.P. Morgan SE | 232,765                                     | (58,422)                     |
| 4,401   | Short                 | USD     | PINTEREST INC- CLASS A               | J.P. Morgan SE | 80,953                                      | 3,670                        |
| 1,772   | Long                  | USD     | ZOOM COMMUNICATIONS INC              | J.P. Morgan SE | 133,772                                     | (35,393)                     |
| 2,002   | Short                 | USD     | ONEOK INC                            | J.P. Morgan SE | 152,238                                     | (3,485)                      |
| 6,444   | Short                 | USD     | GEN DIGITAL INC                      | J.P. Morgan SE | 140,288                                     | 16,176                       |
| 275     | Long                  | USD     | VERTIV HOLDINGS CO-A                 | J.P. Morgan SE | 80,535                                      | 2,749                        |
| 162,288 | Long                  | USD     | ESPERION THERAPEUTICS INC            | J.P. Morgan SE | 448,553                                     | 4,258                        |
| 6,436   | Long                  | USD     | THERAVANCE BIO WHEN ISSUED           | J.P. Morgan SE | 95,698                                      | (442)                        |
| 0.5     | Long                  | USD     | DEVON ENERGY CORP                    | J.P. Morgan SE | 18                                          | (2)                          |
| 25,238  | Long                  | USD     | CAESARS ENTERTAINMENT INC            | J.P. Morgan SE | 666,214                                     | 7,546                        |
| 264     | Short                 | USD     | SNOWFLAKE INC                        | J.P. Morgan SE | 58,767                                      | (3,261)                      |
| 1,655   | Long                  | USD     | INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A         | J.P. Morgan SE | 125,996                                     | (2,388)                      |
| 2,757   | Long                  | USD     | TRADE DESK INC/THE -CLASS A          | J.P. Morgan SE | 43,599                                      | (12,395)                     |
| 137,666 | Short                 | USD     | EMERALD HOLDING --- REGISTERED SHS   | J.P. Morgan SE | 606,872                                     | (6,021)                      |
| 674     | Short                 | USD     | VERISIGN INC                         | J.P. Morgan SE | 148,300                                     | 26,546                       |
| 873     | Long                  | USD     | HOST HOTELS & RESORTS INC            | J.P. Morgan SE | 18,104                                      | 405                          |
| 1,291   | Short                 | USD     | AFFIRM HOLDINGS INC                  | J.P. Morgan SE | 92,085                                      | (9,756)                      |
| 5,237   | Long                  | USD     | CHART INDUSTRIES INC                 | J.P. Morgan SE | 957,071                                     | 6,643                        |
| 2,957   | Long                  | USD     | APA CORP                             | J.P. Morgan SE | 84,238                                      | (13,397)                     |
| 508     | Long                  | USD     | EXPAND ENERGY CORP                   | J.P. Morgan SE | 40,518                                      | (400)                        |
| 633     | Short                 | USD     | COINBASE GLOBAL INC -CLASS A         | J.P. Morgan SE | 80,940                                      | 8,787                        |
| 3,810   | Long                  | USD     | ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD | J.P. Morgan SE | 86,644                                      | 4,266                        |
| 232     | Short                 | USD     | MARVELL TECHNOLOGY INC               | J.P. Morgan SE | 60,448                                      | (15,921)                     |
| 30,106  | Short                 | USD     | ORGANON & CO                         | J.P. Morgan SE | 356,543                                     | (4,740)                      |



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Differenzkontrakte (Fortsetzung)

#### Candriam L Alternative Multi-Strategies (Fortsetzung)

| Anzahl | Long / Short Position | Währung | Basiswert                    | Gegenpartei              | Nennwert<br>(in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|--------|-----------------------|---------|------------------------------|--------------------------|---------------------------------------------|------------------------------|
| 4,149  | Short                 | USD     | SOFI TECHNOLOGIES INC        | J.P. Morgan SE           | 65,067                                      | (5,208)                      |
| 146    | Short                 | USD     | ADVANCED MICRO DEVICES       | J.P. Morgan SE           | 74,183                                      | (9,039)                      |
| 140    | Long                  | USD     | APPLOVIN CORP-CLASS A        | J.P. Morgan SE           | 63,091                                      | (12,058)                     |
| 365    | Short                 | USD     | PALO ALTO NETWORKS INC       | J.P. Morgan SE           | 108,871                                     | (12,942)                     |
| 5,675  | Short                 | USD     | RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A      | J.P. Morgan SE           | 86,120                                      | (1,985)                      |
| 8,822  | Short                 | USD     | BAXTER INTERNATIONAL INC     | J.P. Morgan SE           | 164,511                                     | (21,733)                     |
| 40,119 | Short                 | USD     | GRAB HOLDINGS LTD - CL A     | J.P. Morgan SE           | 132,291                                     | (6,556)                      |
| 10,537 | Short                 | USD     | THE CAMPBELL'S COMPANY       | J.P. Morgan SE           | 205,247                                     | (10,662)                     |
| 833    | Short                 | USD     | AST SPACEMOBILE INC          | J.P. Morgan SE           | 64,743                                      | 12,233                       |
| 247    | Short                 | USD     | CISCO SYSTEMS INC            | J.P. Morgan SE           | 25,376                                      | 836                          |
| 3,331  | Long                  | USD     | COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | J.P. Morgan SE           | 112,840                                     | (51,425)                     |
| 2,505  | Short                 | USD     | FISERV INC                   | J.P. Morgan SE           | 107,470                                     | 21,910                       |
| 788    | Short                 | USD     | ARTHUR J GALLAGHER & CO      | J.P. Morgan SE           | 158,227                                     | (16,176)                     |
| 5,678  | Short                 | USD     | GENERAL MILLS INC            | J.P. Morgan SE           | 172,828                                     | (6,044)                      |
| 1,776  | Short                 | USD     | GENUINE PARTS CO             | J.P. Morgan SE           | 183,270                                     | (32,234)                     |
| 269    | Long                  | USD     | IDEXX LABORATORIES INC       | J.P. Morgan SE           | 123,863                                     | (9,351)                      |
| 568    | Short                 | USD     | INTEL CORP                   | J.P. Morgan SE           | 69,369                                      | (14,968)                     |
| 1,374  | Short                 | USD     | INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | J.P. Morgan SE           | 95,205                                      | (6,462)                      |
| 16,965 | Long                  | USD     | LEGGETT PLATT INC            | J.P. Morgan SE           | 173,760                                     | 24,929                       |
| 4,066  | Long                  | USD     | MGM RESORTS INTERNATIONAL    | J.P. Morgan SE           | 170,030                                     | (10,242)                     |
| 483    | Long                  | USD     | MICROSOFT CORP               | J.P. Morgan SE           | 157,587                                     | (35,050)                     |
| 3,324  | Short                 | USD     | OMNICOM GROUP                | J.P. Morgan SE           | 211,744                                     | 8,867                        |
| 425    | Short                 | USD     | ORACLE CORP                  | J.P. Morgan SE           | 54,477                                      | 24,239                       |
| 639    | Short                 | USD     | ROPER TECHNOLOGIES INC       | J.P. Morgan SE           | 189,129                                     | 2,765                        |
| 467    | Short                 | USD     | QUALCOMM INC                 | J.P. Morgan SE           | 75,481                                      | 13,445                       |
| 3,730  | Long                  | USD     | SOUTHWEST AIRLINES CO        | J.P. Morgan SE           | 167,757                                     | 28,687                       |
| 237    | Long                  | USD     | TERADYNE INC                 | J.P. Morgan SE           | 100,297                                     | 23,708                       |
| 398    | Short                 | USD     | TEXAS INSTRUMENTS INC        | J.P. Morgan SE           | 103,763                                     | (1,695)                      |
| 20,147 | Short                 | USD     | QXO INC                      | J.P. Morgan SE           | 304,505                                     | (9,163)                      |
| 2,920  | Long                  | USD     | WEBSTER FINANCIAL CORP       | J.P. Morgan SE           | 195,177                                     | 10,318                       |
| 147    | Long                  | USD     | WESTERN DIGITAL CORP         | J.P. Morgan SE           | 82,124                                      | 11,896                       |
|        |                       |         | ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | J.P. Morgan SE           |                                             |                              |
| 818    | Long                  | USD     | SILA REALTY TRUST INC        | J.P. Morgan SE           | 188,355                                     | 9,516                        |
| 35,645 | Long                  | USD     | TE CONNECTIVITY PLC          | J.P. Morgan SE           | 947,166                                     | 4,432                        |
| 1,004  | Long                  | USD     | LAM RESEARCH CORP            | J.P. Morgan SE           | 177,046                                     | (7,761)                      |
| 365    | Long                  | USD     | JOHNSON & JOHNSON            | Morgan Stanley Europe SE | 138,341                                     | 37,100                       |
| 365    | Long                  | USD     | NVIDIA CORP                  | J.P. Morgan SE           | 81,080                                      | 5,829                        |
| 781    | Long                  | USD     | SANDISK CORP                 | J.P. Morgan SE           | 136,684                                     | (14,703)                     |
| 72     | Short                 | USD     | COREWEAVE INC-CL A           | J.P. Morgan SE           | 143,190                                     | (32,262)                     |
| 1,133  | Short                 | USD     | ALLIED GOLD CORP             | J.P. Morgan SE           | 98,643                                      | 22,417                       |
| 30,190 | Long                  | CAD     | ROCKET LAB CORP              | J.P. Morgan SE           | 627,233                                     | (35,687)                     |
| 1,070  | Short                 | USD     | CIRCLE INTERNET GROUP INC    | J.P. Morgan SE           | 95,133                                      | 19,410                       |
| 1,352  | Long                  | USD     | PINNACLE FINANCIAL PARTNERS  | J.P. Morgan SE           | 74,063                                      | (23,562)                     |
| 2,102  | Short                 | USD     | SHELL PLC-ADR                | J.P. Morgan SE           | 185,472                                     | (9,532)                      |
| 6,211  | Short                 | CAD     | BIOGEN IDEC RTS 31-12-49     | J.P. Morgan SE           | 421,238                                     | 31,440                       |
| 4,958  | Long                  | USD     | ON SEMICONDUCTOR             | J.P. Morgan SE           | 130                                         | 0                            |
| 369    | Long                  | USD     | COMCAST CORP-CLASS A         | Morgan Stanley Europe SE | 30,513                                      | (9,904)                      |
| 10,817 | Long                  | USD     | WHITE MOUNTAINS INSURANCE GP | Morgan Stanley Europe SE | 232,273                                     | 18,953                       |
| 177    | Short                 | USD     | MOLINA HEALTHCARE INC        | Morgan Stanley Europe SE | 320,992                                     | (8,963)                      |
| 215    | Short                 | USD     | LENNOX INTERNATIONAL INC     | Morgan Stanley Europe SE | 43,008                                      | (7,543)                      |
| 215    | Short                 | USD     | LAS VEGAS SANDS CORP         | Morgan Stanley Europe SE | 107,744                                     | (8,500)                      |
| 3,618  | Long                  | USD     | PSP SWISS PROPERTY AG-REG    | Morgan Stanley Europe SE | 146,169                                     | (4,760)                      |
| 1,020  | Long                  | CHF     | NORDEX SE                    | Morgan Stanley Europe SE | 159,373                                     | (1,991)                      |
| 3,700  | Long                  | EUR     | VAIL RESORTS INC             | Morgan Stanley Europe SE | 170,940                                     | 13,616                       |
| 256    | Short                 | USD     | FLOWERS FOODS INC            | Morgan Stanley Europe SE | 30,486                                      | 1,117                        |
| 3,216  | Short                 | USD     | UNDER ARMOUR INC-CLASS A     | Morgan Stanley Europe SE | 22,222                                      | (1,328)                      |
| 6,828  | Short                 | USD     | MASTERCARD INC - A           | Morgan Stanley Europe SE | 38,162                                      | (5,035)                      |
| 133    | Long                  | USD     | STIFEL FINANCIAL CORP        | Morgan Stanley Europe SE | 59,747                                      | 2,372                        |
| 1,333  | Long                  | USD     | ROLLINS INC                  | Morgan Stanley Europe SE | 81,346                                      | 955                          |
| 2,968  | Long                  | USD     | LULULEMON ATHLETICA INC      | Morgan Stanley Europe SE | 108,357                                     | (10,688)                     |
| 1,481  | Long                  | USD     |                              |                          | 147,906                                     | 11,086                       |



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Differenzkontrakte (Fortsetzung)

#### Candriam L Alternative Multi-Strategies (Fortsetzung)

| Anzahl | Long / Short Position | Währung | Basiswert                    | Gegenpartei              | Nennwert<br>(in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|--------|-----------------------|---------|------------------------------|--------------------------|---------------------------------------------|------------------------------|
| 495    | Long                  | USD     | ENTERGY CORP                 | Morgan Stanley Europe SE | 49,729                                      | 925                          |
| 8,831  | Short                 | USD     | SUMMIT THERAPEUTICS INC      | Morgan Stanley Europe SE | 112,541                                     | 1,527                        |
| 1,877  | Short                 | USD     | RYAN SPECIALTY HOLDINGS INC  | Morgan Stanley Europe SE | 61,992                                      | (5,779)                      |
| 921    | Long                  | USD     | FLEX LTD                     | Morgan Stanley Europe SE | 130,558                                     | 9,784                        |
| 2,580  | Long                  | GBP     | DIPLOMA PLC                  | Morgan Stanley Europe SE | 213,552                                     | 6,889                        |
| 11,867 | Short                 | USD     | GRAPHIC PACKAGING HOLDING CO | Morgan Stanley Europe SE | 109,712                                     | (5,325)                      |
| 4,507  | Short                 | USD     | HIGHWOODS PROPERTIES INC     | Morgan Stanley Europe SE | 118,894                                     | (3,622)                      |
| 557    | Short                 | USD     | CBOE GLOBAL MARKETS INC      | Morgan Stanley Europe SE | 118,225                                     | 6,077                        |
| 978    | Long                  | USD     | HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | Morgan Stanley Europe SE | 239,423                                     | (9,567)                      |
| 212    | Short                 | USD     | CREDIT ACCEPTANCE CORP       | Morgan Stanley Europe SE | 118,070                                     | (12,099)                     |
| 2,761  | Short                 | USD     | FORTUNE BRANDS INNOVATIONS   | Morgan Stanley Europe SE | 132,580                                     | (33,646)                     |
| 1,896  | Long                  | USD     | CBRE GROUP INC - A           | Morgan Stanley Europe SE | 223,364                                     | 17,948                       |
| 8,321  | Long                  | USD     | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | Morgan Stanley Europe SE | 162,737                                     | 1,408                        |
| 155    | Long                  | USD     | META PLATFORMS INC-CLASS A   | Morgan Stanley Europe SE | 76,367                                      | 168                          |
| 1,227  | Short                 | USD     | ATLASSIAN CORP-CL A          | Morgan Stanley Europe SE | 83,485                                      | 3,848                        |
| 7,971  | Short                 | USD     | NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN | Morgan Stanley Europe SE | 147,177                                     | (12,938)                     |
| 3,802  | Long                  | USD     | ZOETIS INC                   | Morgan Stanley Europe SE | 238,968                                     | (18,900)                     |
| 253    | Short                 | USD     | SPROUTS FARMERS MARKET INC   | Morgan Stanley Europe SE | 18,717                                      | (459)                        |
| 8,742  | Short                 | USD     | CNH INDUSTRIAL NV            | Morgan Stanley Europe SE | 85,868                                      | (7,976)                      |
| 1,291  | Long                  | USD     | INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | Morgan Stanley Europe SE | 139,014                                     | (23,132)                     |
| 1,401  | Short                 | USD     | PERRIGO CO PLC               | Morgan Stanley Europe SE | 12,732                                      | 453                          |
| 22,262 | Long                  | USD     | RITHM CAPITAL CORP           | Morgan Stanley Europe SE | 182,839                                     | 4,539                        |
| 3,570  | Long                  | EUR     | SPIE SA                      | Morgan Stanley Europe SE | 179,928                                     | 3,856                        |
| 705    | Short                 | USD     | APPFOLIO INC - A             | Morgan Stanley Europe SE | 98,878                                      | (7,957)                      |
| 1,242  | Short                 | USD     | GLOBANT SA                   | Morgan Stanley Europe SE | 31,438                                      | 1,858                        |
| 47     | Long                  | USD     | ALPHABET INC-CL A            | Morgan Stanley Europe SE | 14,691                                      | (373)                        |
| 1,209  | Long                  | USD     | PENUMBRA INC                 | Morgan Stanley Europe SE | 333,895                                     | (2,624)                      |
| 577    | Long                  | USD     | HEWLETT PACKARD ENTERPRISE   | Morgan Stanley Europe SE | 22,766                                      | (552)                        |
| 503    | Short                 | USD     | CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | Morgan Stanley Europe SE | 62,566                                      | (7,082)                      |
| 640    | Long                  | USD     | TWILIO INC - A               | Morgan Stanley Europe SE | 115,500                                     | 13,858                       |
| 162    | Long                  | USD     | ASTERA LABS INC              | Morgan Stanley Europe SE | 68,442                                      | 11,832                       |
| 291    | Long                  | USD     | STEEL DYNAMICS INC           | Morgan Stanley Europe SE | 58,404                                      | (4,292)                      |
| 713    | Short                 | USD     | ELF BEAUTY INC               | Morgan Stanley Europe SE | 46,149                                      | (7,514)                      |
| 3,253  | Short                 | USD     | VALVOLINE INC                | Morgan Stanley Europe SE | 112,502                                     | (10,633)                     |
| 28,211 | Long                  | USD     | AGNC INVESTMENT CORP         | Morgan Stanley Europe SE | 268,958                                     | 13,988                       |
| 242    | Short                 | USD     | FLOOR & DECOR HOLDINGS INC-A | Morgan Stanley Europe SE | 12,565                                      | (1,853)                      |
| 13,369 | Long                  | EUR     | AYVENS SA                    | Morgan Stanley Europe SE | 154,011                                     | 1,898                        |
| 18,500 | Long                  | SEK     | SSAB AB - B SHARES           | Morgan Stanley Europe SE | 149,772                                     | (13,353)                     |
| 967    | Long                  | USD     | ROKU INC                     | Morgan Stanley Europe SE | 116,838                                     | 2,622                        |
| 1,533  | Short                 | USD     | SAMSARA INC-CL A             | Morgan Stanley Europe SE | 43,484                                      | 5,952                        |
| 2,690  | Short                 | USD     | CRANE NXT CO                 | Morgan Stanley Europe SE | 120,371                                     | (14,949)                     |
| 804    | Long                  | USD     | STERIS PLC                   | Morgan Stanley Europe SE | 148,079                                     | 5,710                        |
| 8,176  | Short                 | USD     | AVANTOR INC                  | Morgan Stanley Europe SE | 70,797                                      | (3,739)                      |
| 723    | Short                 | USD     | ENPHASE ENERGY INC           | Morgan Stanley Europe SE | 31,138                                      | 294                          |
| 2,277  | Short                 | USD     | SHIFT4 PAYMENTS INC-CLASS A  | Morgan Stanley Europe SE | 96,872                                      | (20,755)                     |
| 2,627  | Long                  | USD     | ROYALTY PHARMA PLC- CL A     | Morgan Stanley Europe SE | 128,834                                     | 5,684                        |
| 3,773  | Short                 | USD     | WILLSCOT HOLDINGS CORP       | Morgan Stanley Europe SE | 95,241                                      | (4,213)                      |
| 2,798  | Short                 | USD     | BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B  | Morgan Stanley Europe SE | 73,150                                      | (1,294)                      |
| 994    | Short                 | USD     | MP MATERIALS CORP            | Morgan Stanley Europe SE | 48,696                                      | 1,324                        |
| 14,743 | Short                 | USD     | QUANTUMSCAPE CORP            | Morgan Stanley Europe SE | 97,487                                      | 20,374                       |
| 8,455  | Short                 | USD     | ALBERTSONS COS INC - CLASS A | Morgan Stanley Europe SE | 100,058                                     | 2,779                        |
| 7,404  | Short                 | USD     | COUPANG INC                  | Morgan Stanley Europe SE | 112,488                                     | (2,170)                      |
| 816    | Long                  | USD     | AMKOR TECHNOLOGY INC         | Morgan Stanley Europe SE | 61,544                                      | 881                          |
| 636    | Short                 | USD     | COINBASE GLOBAL INC -CLASS A | Morgan Stanley Europe SE | 81,323                                      | 13,258                       |
| 3,789  | Short                 | USD     | SOFI TECHNOLOGIES INC        | Morgan Stanley Europe SE | 59,422                                      | 436                          |
| 9,700  | Long                  | NOK     | DNB BANK ASA                 | Morgan Stanley Europe SE | 252,671                                     | 7,545                        |
| 1,148  | Short                 | USD     | DUOLINGO                     | Morgan Stanley Europe SE | 115,493                                     | 9,580                        |
| 3,335  | Short                 | USD     | RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A      | Morgan Stanley Europe SE | 50,610                                      | (7,101)                      |



## Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

### Differenzkontrakte (Fortsetzung)

#### Candriam L Alternative Multi-Strategies (Fortsetzung)

| Anzahl | Long / Short Position | Währung | Basiswert                   | Gegenpartei                         | Nennwert<br>(in EUR)<br>(in absolutem Wert) | Nicht realisiert<br>(in EUR) |
|--------|-----------------------|---------|-----------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------------|------------------------------|
| 48     | Long                  | USD     | AUTOZONE INC                | Morgan Stanley Europe SE            | 134,177                                     | 8,417                        |
| 8,556  | Short                 | USD     | BAXTER INTERNATIONAL INC    | Morgan Stanley Europe SE            | 159,550                                     | (13,664)                     |
| 1,729  | Long                  | USD     | BOSTON SCIENTIFIC CORP      | Morgan Stanley Europe SE            | 64,544                                      | (3,514)                      |
| 1,404  | Long                  | USD     | FEDERAL REALTY INVS TRUST   | Morgan Stanley Europe SE            | 151,587                                     | 1,269                        |
| 114    | Long                  | USD     | CORNING INC                 | Morgan Stanley Europe SE            | 25,469                                      | 6,469                        |
| 59,000 | Long                  | EUR     | A2A SPA                     | Morgan Stanley Europe SE            | 133,340                                     | 1,652                        |
| 11,649 | Short                 | USD     | BELLRING BRANDS INC         | Morgan Stanley Europe SE            | 131,845                                     | (29,982)                     |
| 794    | Short                 | USD     | ESAB CORP                   | Morgan Stanley Europe SE            | 68,497                                      | 917                          |
| 7,058  | Long                  | USD     | WARNER BROS DISCOVERY INC   | Morgan Stanley Europe SE            | 164,582                                     | (3,446)                      |
| 3,811  | Short                 | USD     | INTERNATIONAL PAPER CO      | Morgan Stanley Europe SE            | 127,000                                     | (6,203)                      |
| 119    | Long                  | USD     | ELI LILLY & CO              | Morgan Stanley Europe SE            | 124,842                                     | 13,265                       |
| 487    | Long                  | USD     | NUCOR CORP                  | Morgan Stanley Europe SE            | 94,883                                      | (7,442)                      |
| 5,817  | Short                 | USD     | ROBERT HALF INC             | Morgan Stanley Europe SE            | 156,199                                     | (2,539)                      |
| 3,988  | Short                 | USD     | QXO INC                     | Morgan Stanley Europe SE            | 60,275                                      | (3,610)                      |
| 4,808  | Long                  | USD     | WEBSTER FINANCIAL CORP      | Morgan Stanley Europe SE            | 321,374                                     | 16,981                       |
| 5,321  | Short                 | USD     | SAILPOINT INC               | Morgan Stanley Europe SE            | 68,136                                      | 7,761                        |
| 1,257  | Short                 | USD     | KARMAN HOLDINGS INC         | Morgan Stanley Europe SE            | 54,884                                      | (3,094)                      |
| 44     | Long                  | USD     | SANDISK CORP                | Morgan Stanley Europe SE            | 87,505                                      | 10,319                       |
| 581    | Short                 | USD     | CIRCLE INTERNET GROUP INC   | Morgan Stanley Europe SE            | 31,827                                      | 7,133                        |
| 1,725  | Short                 | USD     | BULLISH                     | Morgan Stanley Europe SE            | 35,351                                      | 1,498                        |
| 9,463  | Short                 | USD     | FERMI INC                   | Morgan Stanley Europe SE            | 75,817                                      | (21,189)                     |
| 6,251  | Long                  | USD     | VERSANT MEDIA GROUP INC     | Morgan Stanley Europe SE            | 196,885                                     | (12,474)                     |
| 5,469  | Long                  | SEK     | OCTAVE INTELLIGENCE PLC-SDR | Morgan Stanley Europe SE            | 77,302                                      | (2,768)                      |
| 8,736  | Long                  | USD     | IRIDIUM COMMUNICATIONS INC  | Citibank Europe plc, Germany Branch | 419,111                                     | 8,676                        |
| 18,720 | Long                  | EUR     | POSTE ITALIANE SPA          | Citibank Europe plc, Germany Branch | 535,766                                     | 8,568                        |
| 85,874 | Short                 | EUR     | TELECOM ITALIA SPA          | Citibank Europe plc, Germany Branch | 683,385                                     | 1,872                        |
|        |                       |         |                             |                                     |                                             | <b>(75,426)</b>              |

Siehe Anhangangabe 9 zu den Barmitteln beim Broker im Zusammenhang mit CFD-Verträgen.

## Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

### Anhangangabe 1 – Allgemeines

Candriam L (nachstehend die „SICAV“) ist eine offene Investmentgesellschaft nach luxemburgischem Recht. Sie wurde am 17. Dezember 2013 in Luxemburg gemäß der Gesetzgebung des Großherzogtums Luxemburg auf unbegrenzte Zeit gegründet. Die SICAV unterliegt den Bestimmungen des Gesetzes vom 10. August 1915 in aktueller Fassung über Handelsgesellschaften (nachstehend das „Gesetz vom 10. August 1915“), sofern sie nicht durch dieses Gesetz davon befreit ist.

Ihr Mindestkapital beträgt 1.250.000 EUR.

Die SICAV unterliegt dem Teil I des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen („OGA“) in seiner geänderten Fassung.

Zurzeit stehen den Anlegern folgende Teilfonds zur Verfügung:

| <u>Teilfonds</u>                         | <u>Referenzwährung</u> |
|------------------------------------------|------------------------|
| Candriam L Alternative Multi-Strategies  | EUR                    |
| Candriam L Balanced Asset Allocation     | EUR                    |
| Candriam L Conservative Asset Allocation | EUR                    |
| Candriam L Dynamic Asset Allocation      | EUR                    |
| Candriam L Multi-Asset Income            | EUR                    |
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth   | EUR                    |

Die SICAV ist ein Umbrella-Fonds, d. h. sie setzt sich aus mehreren Teilfonds zusammen, von denen jeder eine spezifische Sammlung von Vermögenswerten und Verbindlichkeiten darstellt und einer eigenen Anlagepolitik entspricht.

Die aus mehreren Teilfonds bestehende Struktur bietet Anlegern nicht nur den Vorteil, zwischen verschiedenen Teilfonds wählen zu können, sondern auch von einem Teilfonds in einen anderen wechseln zu können, sofern dies zulässig ist. In jedem Teilfonds kann die SICAV Namensanteile in verschiedenen Kategorien mit unterschiedlichen Rechten und Provisionen oder Ausschüttungsregeln ausgeben.

Die Anteile sind nur als Namensanteile erhältlich. Folgende Anteilsklassen wurden aufgelegt:

- die **Anteilsklasse C**, die sowohl natürlichen als auch juristischen Personen angeboten wird.
- die **Anteilsklasse I**, die ausschließlich institutionellen Anlegern vorbehalten ist.
- die **Anteilsklasse N**, die Vertriebsstellen vorbehalten ist, die von der Verwaltungsgesellschaft eigens genehmigt wurden.
- die **Anteilsklasse PI**, die institutionellen Anlegern vorbehalten ist, die Anteile des Teilfonds vor Erreichen einer kritischen Größe hinsichtlich des verwalteten Vermögens zeichnen. Bei Erstzeichnung gilt ein Mindestanlagebetrag in Höhe von 1.000.000 EUR bzw. für die auf eine Fremdwährung lautenden Anteilsklassen in Höhe des entsprechenden Gegenwerts in dieser Fremdwährung. Der Verwaltungsrat kann diesen Mindestbetrag unter Wahrung der Gleichbehandlung der Anteilinhaber an einem Bewertungstag nach eigenem Ermessen ändern. Diese Klasse kann gezeichnet werden bis zum Eintritt eines der folgenden Ereignisse:
  - (i) die vom Verwaltungsrat festgelegte Laufzeit ist abgelaufen;
  - (ii) der Teilfonds hat in Bezug auf das verwaltete Vermögen eine vom Verwaltungsrat bestimmte kritische Größe erreicht; oder
  - (iii) der Verwaltungsrat hat aus berechtigten Gründen beschlossen, diese Klasse für eine Zeichnung zu schließen.
 Der Verwaltungsrat kann die Klasse PI nach eigenem Ermessen ohne vorherige Mitteilung an die Anteilinhaber wieder eröffnen.
- die **Anteilsklasse R**, die Finanzintermediären (einschließlich Vertriebspartnern und Plattformbetreibern) vorbehalten ist, die
  - die gesonderte Vereinbarungen mit ihren Kunden bezüglich der Bereitstellung von Wertpapierdienstleistungen hinsichtlich des Teilfonds geschlossen haben, und
  - denen es aufgrund der für sie geltenden Rechts- und Verwaltungsvorschriften oder aufgrund von Vereinbarungen mit ihren Kunden untersagt ist, für die Bereitstellung der oben genannten Wertpapierdienstleistungen von der Verwaltungsgesellschaft Gebühren, Provisionen oder sonstige finanzielle Vergünstigungen anzunehmen oder einzubehalten.
- die **Anteilsklasse R2**, die folgenden Anlegern vorbehalten ist:
  - Vertriebsstellen und/oder Finanzintermediären, die von der Verwaltungsgesellschaft zugelassen wurden und die für Anlagen in dieser Anteilsklasse von keinem Unternehmen der Candriam-Gruppe eine Vergütung erhalten, wenn die Anlagen in den Anteilen letztlich im Rahmen eines Mandats erfolgen.
  - OGA, die von der Verwaltungsgesellschaft zugelassen wurden.
- die **Anteilsklasse S**, die ausschließlich institutionellen Anlegern vorbehalten ist, die von der Verwaltungsgesellschaft eigens genehmigt wurden.
- die **Anteilsklasse V**, die ausschließlich institutionellen Anlegern mit einer Mindesterstzeichnung von 15.000.000 EUR vorbehalten ist. Der Verwaltungsrat kann diesen Mindestbetrag nach eigenem Ermessen anpassen, sofern alle Anteilinhaber an einem bestimmten Bewertungstag gleich behandelt werden.
- die **Anteilsklasse VB**, die OGA nach belgischem Recht vorbehalten ist, die von der Verwaltungsgesellschaft zugelassen wurden.
- die **Anteilsklasse Z**, die folgenden Anlegern vorbehalten ist:
  - institutionelle oder professionelle Anleger, die von der Verwaltungsgesellschaft zugelassen wurden. Die Portfolioverwaltungstätigkeit für diese Anteilsklasse wird direkt über einen mit dem Anleger geschlossenen Verwaltungsvertrag vergütet. Daher wird auf die Vermögenswerte dieser Anteilsklasse keine Portfolioverwaltungsgebühr erhoben.
  - OGA, die von der Verwaltungsgesellschaft zugelassen wurden und von einem Unternehmen der Candriam-Gruppe verwaltet werden.
- die **Anteilsklasse ZB**, die OGA nach belgischem Recht vorbehalten ist, die von der Verwaltungsgesellschaft zugelassen wurden und von einem Unternehmen der Candriam-Gruppe verwaltet werden.



## Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

### Anhangangabe 1 – Allgemeines (Fortsetzung)

Die SICAV kann gegebenenfalls für einige oder alle Anteilsklassen häufiger Dividenden ausschütten als einmal pro Jahr oder Dividenden zu anderen Zeitpunkten des Jahres ausschütten, wie es der Verwaltungsrat jeweils für angebracht hält. Es ist vorgesehen, dass Anteilsklassen mit dem Zusatz:

- (m) eine monatliche Ausschüttung vornehmen
- (q) eine quartalsweise Ausschüttung vornehmen
- (s) eine halbjährliche Ausschüttung vornehmen

Die Vermögenswerte der verschiedenen Klassen werden zu einer einzigen Einheit zusammengefasst.

Die SICAV ist bestrebt, den Aktionären über die verfügbaren Teilfonds ein ideales Anlageinstrument zur Verfügung zu stellen, das unter Berücksichtigung des Risikos, das der Anleger zu akzeptieren bereit ist, ein bestimmtes Verwaltungsziel verfolgt.

Darüber hinaus kann für die Anteilsklassen ein Verfahren zur Währungsabsicherung angewandt werden:

- Gegenüber der Basiswährung abgesicherte Anteilsklassen:  
Ziel dieser abgesicherten Anteilsklassen ist es, die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Basiswährung des Teilfonds und der Währung, auf die die jeweilige abgesicherte Anteilsklasse lautet, zu verringern.  
Mit dieser Art der Absicherung soll erreicht werden, dass sich die Performance der abgesicherten Anteilsklasse auf angemessener Grundlage (d. h. um die Zinsdifferenz zwischen den beiden Währungen bereinigt) mit der Performance einer Anteilsklasse, die auf die Basiswährung des Teilfonds lautet, vergleichen lässt. Diese Absicherungsart wird in der Bezeichnung der Anteilsklasse durch Hinzufügung des Suffixes H gekennzeichnet.

Die ausgegebenen Anteile werden im Abschnitt „Statistik“ zu den einzelnen Teilfonds ausführlich beschrieben.

Im Rahmen der Offenlegungsvorschriften für nachhaltige Finanzprodukte (Sustainable Finance Disclosure Regulation, SFDR) sind Informationen zu ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und/oder nachhaltigen Investitionen in den entsprechenden Anhängen unter dem Abschnitt (ungeprüft) Sustainable Finance Disclosure Regulation verfügbar.

### Anhangangabe 2 – Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze

Der Abschluss der SICAV wurde in Übereinstimmung mit den luxemburgischen Vorschriften für Organismen für gemeinsame Anlagen erstellt. Aufgrund von Rundungsregeln können in einigen Summen oder Zwischensummen des Abschlusses geringfügige Abweichungen auftreten. Die für den Abschluss verwendeten Nettoinventarwerte beziehen sich auf den 30. Juni 2026. Der Nettoinventarwert der anderen Teilfonds wurde am 1. Juli 2026 basierend auf den zuletzt bekannten Preisen zum Bewertungszeitpunkt berechnet.

#### a) Bewertung des Portfolios der einzelnen Teilfonds

Die Bewertung eines Wertpapiers, das zum Handel an einer amtlichen Notierung oder an einem anderen geregelten Markt mit ordnungsgemäßer Funktionsweise, der anerkannt und für das Publikum offen ist, zugelassen ist, erfolgt auf der Grundlage des letzten in Luxemburg am Bewertungstag bekannten Kurses oder, wenn diese Aktie an mehreren Märkten gehandelt wird, auf der Grundlage des letzten bekannten Kurses an dem Hauptmarkt, an dem sie gehandelt wird. Ist der letzte bekannte Preis nicht repräsentativ, erfolgt die Bewertung auf der Grundlage des wahrscheinlichen Veräußerungswerts, der vom Verwaltungsrat nach bestem Wissen und Gewissen geschätzt wird. Wertpapiere, die weder an einer Börse noch an einem anderen geregelten Markt, der anerkannt und für das Publikum offen ist, notiert sind oder gehandelt werden, werden auf der Grundlage des wahrscheinlichen Veräußerungswerts bewertet, der mit der gebotenen Vorsicht und in gutem Glauben geschätzt wird. Alle anderen Vermögenswerte werden von den Geschäftsführern auf der Grundlage des wahrscheinlichen Veräußerungswerts bewertet, der nach Treu und Glauben und nach allgemein anerkannten Grundsätzen und Verfahren geschätzt werden muss.

#### b) Realisierte Nettogewinne oder -verluste aus dem Verkauf von Kapitalanlagen

Die realisierten Gewinne oder Verluste aus Wertpapierverkäufen in jedem Teilfonds werden auf der Grundlage der durchschnittlichen Kosten der verkauften Wertpapiere berechnet.

#### c) Umrechnung von Fremdwährungen

Die in einer anderen Währung als der Referenzwährung der einzelnen Teilfonds ausgedrückten Werte werden zu dem am Abschlussdatum geltenden Wechselkurs in diese Währung umgerechnet.

Erträge und Aufwendungen, die auf eine andere Währung als die Referenzwährung des jeweiligen Teilfonds lauten, werden zu den am Transaktionsdatum geltenden Wechselkursen in die jeweilige Währung umgerechnet.

Die Erwerbskosten von Wertpapieren der einzelnen Teilfonds, die auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lauten, werden zu den am Tag des Erwerbs geltenden Wechselkursen in diese Währung umgerechnet.

Zum 30. Juni 2026 verwendete Wechselkurse:

|         |          |     |         |            |     |         |             |     |         |          |     |
|---------|----------|-----|---------|------------|-----|---------|-------------|-----|---------|----------|-----|
| 1 EUR = | 1.650250 | AUD | 1 EUR = | 0.861400   | GBP | 1 EUR = | 1771.314750 | KRW | 1 EUR = | 1.478800 | SGD |
| 1 EUR = | 1.622050 | CAD | 1 EUR = | 8.965800   | HKD | 1 EUR = | 11.313500   | NOK | 1 EUR = | 1.143300 | USD |
| 1 EUR = | 0.922250 | CHF | 1 EUR = | 355.925000 | HUF | 1 EUR = | 2.009850    | NZD |         |          |     |
| 1 EUR = | 7.474850 | DKK | 1 EUR = | 185.814800 | JPY | 1 EUR = | 11.065000   | SEK |         |          |     |

#### d) Kombinierte Abschlüsse der SICAV

Die kombinierte Aufstellung des Nettovermögens der SICAV und die kombinierte Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens, die in EUR ausgedrückt sind, sind die Summe der Aufstellung des Nettovermögens und der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens jedes Teilfonds, umgerechnet in die Währung der SICAV unter Verwendung der am Abschlussdatum geltenden Wechselkurse.



## Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

### Anhangangabe 2 – Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

Die von bestimmten Teilfonds der SICAV in anderen Teilfonds der SICAV getätigten Anlagen wurden in der kombinierten Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2026 nicht herausgerechnet. Zum 30. Juni 2026 belief sich der Gesamtbetrag der SICAV-internen Anlagen auf EUR 21.803.950. Dies bedeutet, dass sich das Gesamtvermögen am Bilanzstichtag auf insgesamt EUR 1.084.802.420 belaufen hätte, wenn man diese innerhalb der SICAV erfolgten Anlagevorgänge nicht berücksichtigt hätte.

| Teilfonds                                | SICAV-interne Anlagen                       | Betrag (EUR) |
|------------------------------------------|---------------------------------------------|--------------|
| Candriam L Balanced Asset Allocation     | CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME & GROWTH Z C  | 3,273,466    |
| Candriam L Balanced Asset Allocation     | CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME Z C           | 4,402,313    |
| Candriam L Balanced Asset Allocation     | CANDRIAM L ALTERNATIVE MULTI-STRATEGIES Z C | 728,503      |
| Candriam L Conservative Asset Allocation | CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME & GROWTH Z C  | 4,974,302    |
| Candriam L Conservative Asset Allocation | CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME Z C           | 6,944,627    |
| Candriam L Conservative Asset Allocation | CANDRIAM L ALTERNATIVE MULTI-STRATEGIES Z C | 1,337,055    |
| Candriam L Dynamic Asset Allocation      | CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME & GROWTH Z C  | 56,351       |
| Candriam L Dynamic Asset Allocation      | CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME Z C           | 69,358       |
| Candriam L Dynamic Asset Allocation      | CANDRIAM L ALTERNATIVE MULTI-STRATEGIES Z C | 17,975       |

#### e) Bewertung von Optionen und Futures

Die Bewertung von Optionen und Futures, die an einer amtlichen Notierung oder einem sonstigen geregelten Markt zugelassen sind, erfolgt auf der Grundlage des letzten bekannten Kurses oder, wenn die Option an mehreren Märkten gehandelt wird, auf der Grundlage des letzten bekannten Kurses an dem Markt, an dem der Vertrag von der SICAV abgeschlossen wurde.

Optionen und Futures, die nicht an einer Börse oder einem sonstigen geregelten Markt gehandelt werden, werden zu ihrem wahrscheinlichen Marktwert bewertet, der konservativ und in gutem Glauben geschätzt wird. Der Marktwert der Optionen ist in der Aufstellung des Nettovermögens unter der Rubrik „Optionen (Long-Position) / (Short-Position) zum Marktwert“ enthalten.

Die realisierten Gewinne / (Verluste) und die Veränderung der nicht realisierten Wertsteigerungen / Abschreibungen auf Optionen werden in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter den Überschriften „Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Optionen“ und „Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung / -abschreibung aus Optionen“ ausgewiesen.

Der nicht realisierte Wertzuwachs / (Wertverlust) von Terminkontrakten wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Wertzuwachs / (Wertverlust) von Terminkontrakten (netto)“ ausgewiesen. Veränderungen am Marktwert von offenen Futures werden als nicht realisierte Gewinne/Verluste in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Veränderung bei nicht realisierten Gewinnen/Verlusten aus Futures“ erfasst.

Realisierte Gewinne oder Verluste, die der Differenz zwischen dem Wert des Kontrakts zum Zeitpunkt seiner Eröffnung und dem Wert zum Zeitpunkt seiner Schließung entsprechen, werden bei der Schließung oder dem Verfall von Futures-Kontrakten in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures“ ausgewiesen.

Einzelheiten zu ausstehenden Optionen und Finanzterminkontrakten finden Sie ggf. im Abschnitt „Anhang zum Jahresabschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente“.

#### f) Bewertung von Devisenterminkontrakten

Die Devisenterminkontrakte werden auf der Grundlage der am Abschlussdatum geltenden Devisenterminkurse bewertet, die für den verbleibenden Zeitraum bis zum Verfallsdatum gelten. Der nicht realisierte Gewinn/(Verlust) aus Devisenterminkontrakten wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) aus Devisenterminkontrakten“ ausgewiesen.

Die daraus resultierenden realisierten Gewinne / (Verluste) und die Veränderung der nicht realisierten Wertsteigerung / Wertminderung sind in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Devisenterminkontrakten“ bzw. „Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/-verlusts aus Devisenterminkontrakten“ enthalten.

Einzelheiten zu Devisenterminkontrakten finden Sie ggf. im Abschnitt „Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente“.

#### g) Bewertung von Differenzkontrakten („CFD“)

CFD werden zum angemessenen Wert auf der Grundlage der letzten bekannten Spread- und Zinskurven bzw. des letzten bekannten Schlusskurses des Basiswerts bewertet.

Die nicht realisierte Wertsteigerung / (Wertminderung) aus CFD wird in der Nettovermögensaufstellung unter der Rubrik „Nicht realisierter Gewinn / (Verlust) aus CFD“ erfasst. Realisierte Gewinne / (Verluste) und die sich hieraus ergebende Veränderung der nicht realisierten Wertsteigerungen / Wertminderungen werden in der Gewinn- und Verlustrechnung bzw. in der Aufstellung über die Veränderung des Nettovermögens in der Rubrik „Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus CFD“ sowie der Rubrik „Veränderung des nicht realisierten Gewinns / Verlusts aus CFD“ erfasst.

Einzelheiten zu ausstehenden CFD finden Sie ggf. im Abschnitt „Anhang zum Abschluss - Aufstellung der derivativen Instrumente“.

#### h) Bewertung von Kreditausfallkontrakten („CDS“)

Die Ermittlung des Werts eines „Credit Default Swaps“ erfolgt über eine Gegenüberstellung der abgezinsten künftigen Prämienströme, die durch den Käufer der Sicherheit bezahlt werden, und des aktuellen Werts der erwarteten Verluste des Referenzobjekts im Falle von Kreditereignissen, die im Swapvertrag definiert sind. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus Credit Default Swaps werden in der Nettovermögensaufstellung in der Rubrik „Nicht realisierter Gewinn / (Verlust) aus Swaps“ erfasst.

Realisierte Gewinne / (Verluste) und die sich daraus ergebende Veränderung der nicht realisierten Wertsteigerungen / Wertminderungen werden in der Gewinn- und Verlustrechnung bzw. in der Aufstellung über die Veränderung des Nettovermögens in der Rubrik „Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Swaps“ sowie der Rubrik „Veränderung der nicht realisierten Gewinne / Verluste aus Swaps“ erfasst.

Einzelheiten zu ausstehenden Credit Default Swaps finden Sie ggf. im Abschnitt „Anhang zum Jahresabschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente“.

#### i) Bewertung von Total Return Swaps-Kontrakten („TRS“)

Die tägliche marktnahe Bewertung (Mark-to-market) der Total Return Swaps erfolgt unter Bezugnahme auf den Marktwert des jeweils zugrundeliegenden Vermögenswertes. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus Total Return Swaps werden in der Nettovermögensaufstellung in der Rubrik „Nicht realisierter Gewinn / (Verlust) aus Swaps“ erfasst.

Realisierte Gewinne / (Verluste) und die sich daraus ergebende Veränderung der nicht realisierten Wertsteigerungen / Wertminderungen werden in der Gewinn- und Verlustrechnung bzw. in der Aufstellung über die Veränderung des Nettovermögens in der Rubrik „Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Swaps“ sowie der Rubrik „Veränderung der nicht realisierten Gewinne / Verluste aus Swaps“ erfasst.



## Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

### Anhangangabe 2 – Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

Nähere Angaben zu den ausstehenden Total Return Swaps finden Sie gegebenenfalls im Abschnitt „Erläuterungen zum Jahresabschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente“.

#### j) Pensionsgeschäfte

Ein umgekehrtes Pensionsgeschäft ist eine Vereinbarung, bei der die SICAV gegen Zahlung eines Betrags übertragbare Wertpapiere von einer Gegenpartei erhält (kauft), die sich verpflichtet, diese zu einem Preis und innerhalb einer Frist zurückzukaufen, die zwischen den beiden Parteien bei Abschluss der Vereinbarung festgelegt werden. In seinen Auswirkungen ähnelt ein umgekehrtes Pensionsgeschäft einem Darlehen der SICAV an die Gegenpartei, das durch übertragbare Wertpapiere gesichert ist.

Die SICAV verbucht das Pensionsgeschäft wie ein Darlehen und weist es in der Nettovermögensaufstellung unter der Rubrik „Forderungen aus umgekehrten Pensionsgeschäften / Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften“ aus. Zinsforderungen / Zinsverpflichtungen (im Falle negativer Zinsen) aus dieser Transaktion werden unter der Position sonstige Vermögenswerte/sonstige Verbindlichkeiten in der Vermögensaufstellung ausgewiesen. Ein umgekehrtes Pensionsgeschäft ist im Allgemeinen nur von kurzer Dauer und nicht übertragbar. Die SICAV bewertet diese Art von Vereinbarung zu Anschaffungskosten, was in Verbindung mit Stückzinsen eine Annäherung an den Wert darstellt, zu dem die Wertpapiere von der Gegenpartei zurückgekauft werden. Die erhaltenen oder gezahlten Zinsen (im Falle negativer Zinssätze) werden in der Entwicklung des Nettovermögens unter dem Posten „Zinsen aus umgekehrten Pensionsgeschäften“ ausgewiesen.

#### k) Transaktionskosten

In der am 30. Juni 2026 endenden Periode fielen für die SICAV beim Kauf und Verkauf von Wertpapieren, Geldmarktinstrumenten, sonstigen zulässigen Anlagen und Derivaten Transaktionskosten und Maklergebühren an. Diese Kosten werden in der Übersicht über die Entwicklung des Nettovermögens unter der Überschrift „Transaktionskosten“ ausgewiesen.

#### l) Erträge

Zinserträge laufen gemäß den Bedingungen der zugrunde liegenden Anlage auf. Erträge werden nach Abzug einer etwaigen Quellensteuer erfasst. Dividenden werden auf EX-Datumsbasis ausgewiesen.

#### m) In Anlageportfolios verwendete Abkürzungen

A: Jährliche  
FL.R: Variabel verzinsliche Anleihen  
Q: Vierteljährlich  
S: Halbjährlich  
XX: Anleihen ohne festgelegte Laufzeit  
ZCP oder U: Null-Coupon

### Anhangangabe 3 – Verwaltungsgebühren

Candriam (nachstehend die „Verwaltungsgesellschaft“), eine Kommanditgesellschaft auf Aktien mit Sitz in SERENITY – Bloc B 19-21, Route d'Arlon, L-8009 Strassen, wurde von der SICAV aufgrund eines zwischen der SICAV und der Verwaltungsgesellschaft geschlossenen Vertrags zur Verwaltungsgesellschaft der SICAV bestellt.

Candriam wurde am 10. Juli 1991 in Luxemburg gegründet. Sie nahm ihre Verwaltungstätigkeit am 1. Februar 1999 auf. Sie ist eine Tochtergesellschaft der Candriam Group (vormals New York Life Investment Management Global Holdings S.à r.l.), einem Unternehmen der New York Life Insurance Company Group.

Sie ist als Verwaltungsgesellschaft gemäß Kapitel 15 des Gesetzes von 2010 über OGAW zugelassen und darf die Tätigkeiten der gemeinsamen Portfolioverwaltung, der Verwaltung von Anlageportfolios und der Erbringung von Anlageberatungsdienstleistungen ausüben.

Die Funktion der Portfolioverwaltung wird direkt von Candriam und/oder von einer oder mehrerer ihrer Niederlassungen sichergestellt: Candriam-Belgian Branch, Candriam – Succursale française, Candriam – UK Establishment.

Der zum 30. Juni 2026 geltende Satz der Verwaltungsgebühren:

| Teilfonds                                | Anteilsklasse | Anteilsart    | ISIN         | Verwaltungsgebühr |
|------------------------------------------|---------------|---------------|--------------|-------------------|
| Candriam L Alternative Multi-Strategies  | C             | Thesaurierung | LU1797471627 | 1.50%             |
|                                          | I             | Thesaurierung | LU1797471890 | 0.75%             |
|                                          | PI            | Thesaurierung | LU1797472195 | 0.38%             |
|                                          | R             | Thesaurierung | LU1797472278 | 0.75%             |
|                                          | S             | Thesaurierung | LU1797472351 | 0.04%             |
|                                          | Z             | Thesaurierung | LU1797472435 | 0.00%             |
|                                          | ZB            | Thesaurierung | LU3218668088 | 0.00%             |
| Candriam L Balanced Asset Allocation     | C             | Thesaurierung | LU0982874694 | 1.25%             |
|                                          | C             | Ausschüttung  | LU0982874777 | 1.25%             |
|                                          | I             | Thesaurierung | LU0982874850 | 0.45%             |
|                                          | I             | Ausschüttung  | LU1207304871 | 0.45%             |
|                                          | R2            | Thesaurierung | LU1427870321 | 0.31%             |
|                                          | R2            | Ausschüttung  | LU1427870594 | 0.31%             |
|                                          | V             | Thesaurierung | LU0982874934 | 0.30%             |
| Candriam L Conservative Asset Allocation | Z             | Thesaurierung | LU0982875071 | 0.00%             |
|                                          | C             | Thesaurierung | LU0982875154 | 1.20%             |
|                                          | I             | Thesaurierung | LU0982875311 | 0.40%             |
|                                          | I             | Ausschüttung  | LU1207304798 | 0.40%             |
|                                          | R2            | Thesaurierung | LU1427870164 | 0.30%             |



## Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

### Anhangangabe 3 – Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

| Teilfonds                              | Anteilsklasse | Anteilsart    | ISIN         | Verwaltungsgebühr |
|----------------------------------------|---------------|---------------|--------------|-------------------|
|                                        | R2            | Ausschüttung  | LU1427870248 | 0.30%             |
|                                        | V             | Thesaurierung | LU0982875402 | 0.25%             |
|                                        | Z             | Thesaurierung | LU0982875584 | 0.00%             |
| Candriam L Dynamic Asset Allocation    | C             | Thesaurierung | LU0982876806 | 1.30%             |
|                                        | C             | Ausschüttung  | LU0982876988 | 1.30%             |
|                                        | I             | Thesaurierung | LU0982877101 | 0.50%             |
|                                        | R             | Thesaurierung | LU1427870677 | 0.70%             |
|                                        | V             | Thesaurierung | LU0982877283 | 0.35%             |
|                                        | Z             | Thesaurierung | LU0982877366 | 0.00%             |
| Candriam L Multi-Asset Income          | C             | Thesaurierung | LU0982876392 | 1.10%             |
|                                        | C             | Ausschüttung  | LU0982876475 | 1.10%             |
|                                        | C (q)         | Ausschüttung  | LU1236612575 | 1.10%             |
|                                        | I             | Thesaurierung | LU0982876558 | 0.40%             |
|                                        | R             | Thesaurierung | LU1427871139 | 0.55%             |
|                                        | R2            | Thesaurierung | LU1427871303 | 0.27%             |
|                                        | R2            | Ausschüttung  | LU1427871485 | 0.27%             |
|                                        | V             | Thesaurierung | LU0982876632 | 0.28%             |
|                                        | V (q)         | Ausschüttung  | LU1207305092 | 0.28%             |
|                                        | VB            | Ausschüttung  | LU2895711245 | 0.18%             |
|                                        | Z             | Thesaurierung | LU0982876715 | 0.00%             |
|                                        | Z (q)         | Ausschüttung  | LU1207305175 | 0.00%             |
|                                        | ZB            | Thesaurierung | LU3218667783 | 0.00%             |
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth | C             | Thesaurierung | LU1207305258 | 1.25%             |
|                                        | C             | Ausschüttung  | LU1236612658 | 1.25%             |
|                                        | C (q)         | Ausschüttung  | LU1207305332 | 1.25%             |
|                                        | I             | Thesaurierung | LU1207305415 | 0.50%             |
|                                        | I (q)         | Ausschüttung  | LU1207305506 | 0.50%             |
|                                        | R             | Thesaurierung | LU1427871725 | 0.65%             |
|                                        | R2            | Ausschüttung  | LU1427872293 | 0.32%             |
|                                        | V             | Thesaurierung | LU1207305688 | 0.30%             |
|                                        | Z             | Thesaurierung | LU1207305845 | 0.00%             |
|                                        | Z (q)         | Ausschüttung  | LU1207305928 | 0.00%             |
|                                        | ZB            | Ausschüttung  | LU3218667940 | 0.00%             |

Die nachfolgende Tabelle gibt Auskunft über die jährliche maximale Verwaltungsgebühr derjenigen OGAW, in welche die verschiedenen Teilfonds von Candriam L zum 30. Juni 2026 investiert sind:

| Zielfonds                                                   | Höchstsatz |
|-------------------------------------------------------------|------------|
| CANDRIAM ABSOLUTE RETURN EQUITY MARKET NEUTRAL Z C          | 0.00%      |
| CANDRIAM BONDS CAPITAL SECURITIES Z C                       | 0.00%      |
| CANDRIAM BONDS CREDIT ALPHA Z C                             | 0.00%      |
| CANDRIAM BONDS EMERGING DEBT LOCAL CURRENCIES Z C           | 0.00%      |
| CANDRIAM BONDS EMERGING MARKETS CORPORATE Z C               | 0.00%      |
| CANDRIAM BONDS EURO GOVERNMENT Z C                          | 0.00%      |
| CANDRIAM BONDS EURO HIGH YIELD Z C                          | 0.00%      |
| CANDRIAM BONDS EURO SHORT TERM Z C                          | 0.00%      |
| CANDRIAM BONDS GLOBAL HIGH YIELD Z C                        | 0.00%      |
| CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Z C                            | 0.25%      |
| CANDRIAM EQUITIES L BIOTECHNOLOGY Z C                       | 0.00%      |
| CANDRIAM EQUITIES L EMERGING MARKETS Z C                    | 0.00%      |
| CANDRIAM EQUITIES L GLOBAL DEMOGRAPHY Z C                   | 0.00%      |
| CANDRIAM EQUITIES L RISK ARBITRAGE OPPORTUNITIES Z C        | 0.00%      |
| CANDRIAM EQUITIES L ROBOTICS & INNOVATIVE TECHNOLOGY Z C    | 0.00%      |
| CANDRIAM EQUITIES L US EDGE Z USD C                         | 0.00%      |
| CANDRIAM L ALTERNATIVE MULTI-STRATEGIES Z C                 | 0.00%      |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME & GROWTH Z C                  | 0.00%      |
| CANDRIAM L MULTI-ASSET INCOME Z C                           | 0.00%      |
| CANDRIAM MONÉTAIRE SICAV Z C                                | 0.15%      |
| CANDRIAM MONEY MARKET USD SUSTAINABLE Z C                   | 0.00%      |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EMERGING MARKETS Z C              | 0.00%      |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO CORPORATE Z C                | 0.00%      |
| CANDRIAM SUSTAINABLE BOND EURO Z C                          | 0.00%      |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY EMERGING MARKETS Z C            | 0.00%      |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY QUANT EUROPE Z C                | 0.00%      |
| CANDRIAM SUSTAINABLE EQUITY US Z C                          | 0.00%      |
| CANDRIAM SUSTAINABLE MONEY MARKET EURO Z C                  | 0.00%      |
| CLEOME INDEX EUROPE EQUITIES Z C                            | 0.00%      |
| CLEOME INDEX USA EQUITIES Z C                               | 0.00%      |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE CORPORATE EURO BOND UCITS ETF D | 0.20%      |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE EUROPE EQUITY UCITS ETF C       | 0.15%      |
| INDEXIQ FACTORS SUSTAINABLE JAPAN EQUITY UCITS ETF C        | 0.20%      |
| Ofi Invest Energy Strategic Metals I                        | 0.93%      |

### Anhangangabe 4 – Betriebs- und Verwaltungskosten

Die SICAV trägt die laufenden Betriebs- und Verwaltungskosten, die zur Deckung aller Gemeinkosten und variablen Kosten, der Gebühren, Entgelte und sonstigen Aufwendungen, wie nachstehend definiert („Betriebs- und Verwaltungskosten“), anfallen.



## Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

### Anhangangabe 4 – Betriebs- und Verwaltungskosten (Fortsetzung)

Die Betriebs- und Verwaltungskosten umfassen unter anderem die folgenden Ausgaben:

a) die direkt von der SICAV getätigten Ausgaben, darunter unter anderem die Gebühren und Kosten der Depotbank, die Gebühren und Auslagen der zugelassenen unabhängigen Wirtschaftsprüfer, die Kosten für die Absicherung von Anteilsklassen, einschließlich der von der Verwaltungsgesellschaft in Rechnung gestellten Kosten;

b) die jährlichen Honorare, die die SICAV an unabhängige Verwaltungsratsmitglieder für die von ihnen die SICAV erbrachten Dienste zahlt. Für die Periode zum 30. Juni 2026 beliefen sich die Honorare, die an die unabhängigen Verwaltungsratsmitglieder gezahlt wurden, auf insgesamt EUR 30.000.

c) eine an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlende „Servicegebühr“, die den nach Abzug der vorstehend unter (a) aufgeführten Ausgaben verbleibenden Teil der Betriebs- und Verwaltungskosten abdeckt, das heißt unter anderem die folgenden Kosten und Gebühren: die Gebühren und Kosten der Domizilstelle, der Verwaltungsstelle sowie der Übertragungs- und Registerführungsstelle; die Kosten für die Registrierung und Aufrechterhaltung der Registrierung in allen relevanten Rechtsgebieten (z. B. die von den betreffenden Aufsichtsbehörden erhobenen Gebühren, die Kosten für Übersetzungen und die Vergütungen der Vertreter im Ausland und der lokalen Zahlstellen); die Kosten für die Börsennotierung und deren Aufrechterhaltung; die Kosten für die Veröffentlichung der Anteilspreise; die Kosten für Porto und Telekommunikation; die Kosten für die Erstellung, den Druck, die Übersetzung und die Verteilung der Prospekte, der Basisinformationsblätter, der Mitteilungen an die Anteilinhaber, der Finanzberichte oder aller sonstigen Dokumente für die Anteilinhaber; die Honorare und Kosten für rechtliche Belange; die Gebühren und Kosten für Zugriffe auf kostenpflichtige Informationen oder Daten (Abonnements, Lizenzgebühren und jegliche anderen Kosten); die Kosten für die Verwendung eingetragener Marken durch die SICAV sowie die Kosten und Gebühren, die der Verwaltungsgesellschaft und/oder den von ihr beauftragten Stellen und/oder jeder anderen von der SICAV selbst beauftragten Stelle und/oder unabhängigen Sachverständigen zustehen.

Die Betriebs- und Verwaltungskosten werden als jährlicher Prozentsatz des durchschnittlichen Nettoinventarwerts der einzelnen Anteilsklassen ausgedrückt und sind monatlich zu zahlen.

Sollten am Ende eines bestimmten Zeitraums die tatsächlichen Gebühren und Aufwendungen höher sein als der für eine Anteilsklasse festgelegte Prozentsatz der Betriebs- und Verwaltungskosten, so würde die Verwaltungsgesellschaft die Differenz selbst bezahlen. Sollten hingegen die tatsächlichen Gebühren und Aufwendungen unter dem für eine Anteilsklasse festgelegten Prozentsatz der Betriebs- und Verwaltungskosten liegen, würde die Verwaltungsgesellschaft die Differenz einbehalten.

Die Verwaltungsgesellschaft ist berechtigt, die SICAV anzuweisen, alle oder einen Teil der oben aufgeführten Kosten direkt aus ihrem Vermögen zu begleichen.

In einem solchen Fall würde sich der Betrag der Betriebs- und Verwaltungskosten entsprechend verringern.

Zum 30. Juni 2026 gelten die folgenden Höchstsätze:

| Teilfonds                                | Anteilsklasse | Anteilsart    | ISIN         | Höchstsatz |
|------------------------------------------|---------------|---------------|--------------|------------|
| Candriam L Alternative Multi-Strategies  | C             | Thesaurierung | LU1797471627 | 0.50%      |
|                                          | I             | Thesaurierung | LU1797471890 | 0.40%      |
|                                          | PI            | Thesaurierung | LU1797472195 | 0.40%      |
|                                          | R             | Thesaurierung | LU1797472278 | 0.50%      |
|                                          | S             | Thesaurierung | LU1797472351 | 0.40%      |
|                                          | Z             | Thesaurierung | LU1797472435 | 0.40%      |
|                                          | ZB            | Thesaurierung | LU3218668088 | 0.40%      |
| Candriam L Balanced Asset Allocation     | C             | Ausschüttung  | LU0982874777 | 0.10%      |
|                                          | C             | Thesaurierung | LU0982874694 | 0.10%      |
|                                          | I             | Ausschüttung  | LU1207304871 | 0.05%      |
|                                          | I             | Thesaurierung | LU0982874850 | 0.05%      |
|                                          | R2            | Ausschüttung  | LU1427870594 | 0.10%      |
|                                          | R2            | Thesaurierung | LU1427870321 | 0.10%      |
|                                          | V             | Thesaurierung | LU0982874934 | 0.05%      |
|                                          | Z             | Thesaurierung | LU0982875071 | 0.05%      |
| Candriam L Conservative Asset Allocation | C             | Thesaurierung | LU0982875154 | 0.10%      |
|                                          | I             | Ausschüttung  | LU1207304798 | 0.05%      |
|                                          | I             | Thesaurierung | LU0982875311 | 0.05%      |
|                                          | R2            | Ausschüttung  | LU1427870248 | 0.10%      |
|                                          | R2            | Thesaurierung | LU1427870164 | 0.10%      |
|                                          | V             | Thesaurierung | LU0982875402 | 0.05%      |
|                                          | Z             | Thesaurierung | LU0982875584 | 0.05%      |
| Candriam L Dynamic Asset Allocation      | C             | Ausschüttung  | LU0982876988 | 0.10%      |
|                                          | C             | Thesaurierung | LU0982876806 | 0.10%      |
|                                          | I             | Thesaurierung | LU0982877101 | 0.05%      |
|                                          | R             | Thesaurierung | LU1427870677 | 0.10%      |
|                                          | V             | Thesaurierung | LU0982877283 | 0.05%      |
|                                          | Z             | Thesaurierung | LU0982877366 | 0.05%      |
|                                          | Z             | Ausschüttung  | LU0982876475 | 0.10%      |
| Candriam L Multi-Asset Income            | C             | Thesaurierung | LU0982876392 | 0.10%      |
|                                          | C (q)         | Ausschüttung  | LU1236612575 | 0.10%      |
|                                          | I             | Thesaurierung | LU0982876558 | 0.05%      |
|                                          | R             | Thesaurierung | LU1427871139 | 0.10%      |
|                                          | R2            | Ausschüttung  | LU1427871485 | 0.10%      |
|                                          | R2            | Thesaurierung | LU1427871303 | 0.10%      |
|                                          | V             | Thesaurierung | LU0982876632 | 0.05%      |
|                                          | V (q)         | Ausschüttung  | LU1207305092 | 0.05%      |
|                                          | VB            | Ausschüttung  | LU2895711245 | 0.30%      |
|                                          | Z             | Thesaurierung | LU0982876715 | 0.05%      |
|                                          | Z (q)         | Ausschüttung  | LU1207305175 | 0.05%      |
|                                          | ZB            | Thesaurierung | LU3218667783 | 0.25%      |



## Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

### Anhangangabe 4 – Betriebs- und Verwaltungskosten (Fortsetzung)

| Teilfonds                              | Anteilsklasse | Anteilsart    | ISIN         | Höchstsatz |
|----------------------------------------|---------------|---------------|--------------|------------|
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth | C             | Ausschüttung  | LU1236612658 | 0.10%      |
|                                        | C             | Thesaurierung | LU1207305258 | 0.10%      |
|                                        | C (q)         | Ausschüttung  | LU1207305332 | 0.10%      |
|                                        | I             | Thesaurierung | LU1207305415 | 0.05%      |
|                                        | I (q)         | Ausschüttung  | LU1207305506 | 0.05%      |
|                                        | R             | Thesaurierung | LU1427871725 | 0.10%      |
|                                        | R2            | Ausschüttung  | LU1427872293 | 0.10%      |
|                                        | V             | Thesaurierung | LU1207305688 | 0.05%      |
|                                        | Z             | Thesaurierung | LU1207305845 | 0.05%      |
|                                        | Z (q)         | Ausschüttung  | LU1207305928 | 0.05%      |
|                                        | ZB            | Ausschüttung  | LU3218667940 | 0.25%      |

Die Betriebs- und Verwaltungskosten, die in der Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens der SICAV für die zum 30. Juni 2026 endende Periode dargestellt sind, enthalten Depotgebühren in folgender Höhe:

| Teilfonds                                | Währung | Depotbankgebühren |
|------------------------------------------|---------|-------------------|
| Candriam L Alternative Multi-Strategies  | EUR     | 1,088             |
| Candriam L Balanced Asset Allocation     | EUR     | 4,265             |
| Candriam L Conservative Asset Allocation | EUR     | 3,918             |
| Candriam L Dynamic Asset Allocation      | EUR     | 150               |
| Candriam L Multi-Asset Income            | EUR     | 9,254             |
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth   | EUR     | 2,566             |

### Anhangangabe 5 – Performancegebühren

Die Verwaltungsgesellschaft erhält für einige Anteilsklassen von Candriam L Multi-Asset Income, Candriam L Multi-Asset Income & Growth und Candriam L Alternative Multi-Strategies eine Performancegebühr, die einer High-Water-Mark und einer Hurdle-Rate unterliegt und auf das Nettovermögen des Teilfonds erhoben wird.

Die Methode zur Berechnung der Performance-Provision wird in den verschiedenen technischen Spezifikationen, die dem geltenden Prospekt der SICAV beigefügt sind, detailliert beschrieben.

#### Candriam L Alternative Multi-Strategies

| Anteilsklasse | Klassentyp    | Währung | Performancegebührensatz | Höhe der für die Periode in Rechnung gestellten Performancegebühr in EUR | % des NIW der Anteilsklasse, der für die Periode als Performancegebühr erhoben wurde |
|---------------|---------------|---------|-------------------------|--------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------|
| C             | Thesaurierung | EUR     | 20.00%                  | 15                                                                       | 1.20%                                                                                |
| I             | Thesaurierung | EUR     | 20.00%                  | 15,044                                                                   | 0.70%                                                                                |
| PI            | Thesaurierung | EUR     | 20.00%                  | 166,886                                                                  | 1.27%                                                                                |
| R             | Thesaurierung | EUR     | 20.00%                  | 17                                                                       | 1.29%                                                                                |
| Z             | Thesaurierung | EUR     | 20.00%                  | 164,935                                                                  | 1.24%                                                                                |
| ZB            | Thesaurierung | EUR     | 20.00%                  | 346,323                                                                  | 1.35%                                                                                |

Die in der Periode zum 30. Juni 2026 in Rechnung gestellte Performancegebühr belief sich auf EUR 693.220.

#### Candriam L Multi-Asset Income

| Anteilsklasse | Klassentyp    | Währung | Performancegebührensatz | Höhe der für die Periode in Rechnung gestellten Performancegebühr in EUR | % des NIW der Anteilsklasse, der für die Periode als Performancegebühr erhoben wurde |
|---------------|---------------|---------|-------------------------|--------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------|
| I             | Thesaurierung | EUR     | 20.00%                  | 10,218                                                                   | 0.17%                                                                                |
| V             | Thesaurierung | EUR     | 20.00%                  | 25                                                                       | 0.85%                                                                                |
| V (q)         | Ausschüttung  | EUR     | 20.00%                  | 3                                                                        | 0.19%                                                                                |

Die in der Periode zum 30. Juni 2026 in Rechnung gestellte Performancegebühr belief sich auf EUR 10.246.

#### Candriam L Multi-Asset Income & Growth

| Anteilsklasse | Klassentyp    | Währung | Performancegebührensatz | Höhe der für die Periode in Rechnung gestellten Performancegebühr in EUR | % des NIW der Anteilsklasse, der für die Periode als Performancegebühr erhoben wurde |
|---------------|---------------|---------|-------------------------|--------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------|
| I             | Thesaurierung | EUR     | 20.00%                  | 5,562                                                                    | 0.54%                                                                                |
| I (q)         | Ausschüttung  | EUR     | 20.00%                  | 9                                                                        | 0.55%                                                                                |
| V             | Thesaurierung | EUR     | 20.00%                  | 124,581                                                                  | 0.56%                                                                                |

Die in der Periode zum 30. Juni 2026 in Rechnung gestellte Performancegebühr belief sich auf EUR 130.152.

### Anhangangabe 6 – Zeichnungssteuer

Die SICAV unterliegt dem luxemburgischen Steuerrecht.

Aufgrund der geltenden Gesetze und Vorschriften unterliegt die SICAV in Luxemburg einer jährlichen Steuer in Höhe von 0,05% des Nettoinventarwerts der SICAV; dieser Satz wird für die institutionellen Anlegern vorbehaltenen Klassen auf 0,01 % reduziert. Diese Steuer ist vierteljährlich auf der Grundlage des Nettovermögens der SICAV zu zahlen, das am Ende des Quartals berechnet wird, auf das sich die Steuer bezieht.

## Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

### Anhangangabe 6 – Zeichnungssteuer (Fortsetzung)

Die belgische Regierung hat ein Gesetz erlassen, wonach der Nettoinventarwert der in Belgien registrierten ausländischen Anlagefonds einmal pro Jahr besteuert wird. Diese jährliche Steuer wird auf die Nettobeträge berechnet, die von belgischen Finanzintermediären als in Belgien investiert gelten. In Ermangelung einer ausreichenden Erklärung in Bezug auf diese Zahlen ist die Steuerbehörde berechtigt, die Steuer auf das gesamte Vermögen dieser Teilfonds zu berechnen. Mit dem belgischen Gesetz vom 17. Juni 2013, das steuerliche und finanzielle Bestimmungen sowie Bestimmungen zur nachhaltigen Entwicklung enthält, wurde der Satz der jährlichen Steuer für Organismen für gemeinsame Anlagen mit Wirkung vom 1. Januar 2014 auf 0,0925 % festgelegt.

Die SICAV hat vorsorglich bei der belgischen Steuerbehörde und beim Gericht erster Instanz in Brüssel eine Klage auf Rückerstattung der Steuer eingereicht.

Zum jetzigen Zeitpunkt ist es nicht möglich, dem Ausgang des Rechtsstreits oder einer eventuellen Erstattung zugunsten der SICAV vorzugreifen. In einem ähnlichen Fall legte der belgische Staat beim Kassationsgerichtshof Berufung gegen die zugunsten des Klägers ergangenen Urteile des Berufungsgerichts ein.

Die Verwaltungsgesellschaft wurde unterrichtet, dass der Kassationsgerichtshof am 25. März 2022 zu Ungunsten des Klägers entschieden hat. Der Kassationsgerichtshof (französischsprachige Kammer) ist der Ansicht, dass das Berufungsgericht in Brüssel die belgische Zeichnungssteuer zu Unrecht als unter das Doppelbesteuerungsabkommen zwischen Belgien und Luxemburg fallende Vermögenssteuer bezeichnete (diesem Abkommen gemäß ist ausschließlich Luxemburg berechtigt, luxemburgische SICAVs zu besteuern, nicht aber Belgien, was den Anspruch auf Rückerstattung der belgischen Zeichnungssteuer begründet).

Der Fall wurde an das Berufungsgericht Lüttich zurückverwiesen, das sich dem Urteil des Kassationsgerichts vom 6. November 2024 und 17. September 2025 anschloss und die Rückzahlung an die SICAV ablehnte. Der Kläger legte beim Kassationsgericht Berufung gegen das Urteil des Berufungsgerichts vom 6. November 2024 zugunsten des belgischen Staates ein, auch wenn die Chancen auf eine Änderung des Urteils durch das Kassationsgericht gering sind.

In einer anderen Entscheidung des Kassationsgerichtshofs (flämischsprachige Kammer) vom 21. April 2022 wird zwar nicht bestritten, dass es sich bei der belgischen Zeichnungssteuer um eine Vermögenssteuer handelt, aber die Auffassung vertreten, dass eine in Belgien erhobene Vermögenssteuer nicht unter das Doppelbesteuerungsabkommen zwischen Belgien und Luxemburg fällt (anders als bei dem Abkommen mit den Niederlanden). Der Fall wurde an das Berufungsgericht in Gent zurückverwiesen. Der Beschluss wurde am 5. November 2024 erlassen. Überraschenderweise bestätigt es die ursprüngliche positive Entscheidung des Brüsseler Berufungsgerichts gegen den Standpunkt des Kassationsgerichtshofs. Der belgische Staat hat dieses neue Urteil jedoch angefochten und hält an seinem Standpunkt fest. Vier weitere Urteile des Brüsseler Berufungsgerichts vom 25. April 2023 wurden ebenfalls vor dem Kassationsgerichtshof angefochten.

Die Aussichten auf eine Rückerstattung halten sich daher in Grenzen, und eine Rückerstattung wird in jedem Fall nicht kurzfristig möglich sein.

### Anhangangabe 7 – Dividenden

Die SICAV hat in der Periode zum 30. Juni 2026 die folgenden Dividenden ausgeschüttet:

| Teilfonds                                | Anteilsklasse | Währung | Ausschüttung | Ex-Tag     |
|------------------------------------------|---------------|---------|--------------|------------|
| Candriam L Balanced Asset Allocation     | C             | EUR     | 4.18         | 30/04/2026 |
|                                          | I             | EUR     | 40.24        | 30/04/2026 |
|                                          | R2            | EUR     | 4.03         | 30/04/2026 |
| Candriam L Conservative Asset Allocation | I             | EUR     | 41.78        | 30/04/2026 |
| Candriam L Multi-Asset Income            | C             | EUR     | 1.46         | 30/04/2026 |
|                                          | C (q)         | EUR     | 0.38         | 15/01/2026 |
|                                          | C (q)         | EUR     | 0.38         | 15/01/2026 |
|                                          | R2            | EUR     | 1.55         | 30/04/2026 |
|                                          | V (q)         | EUR     | 3.95         | 15/01/2026 |
|                                          | V (q)         | EUR     | 3.99         | 15/04/2026 |
|                                          | VB            | EUR     | 15.00        | 30/04/2026 |
|                                          | Z (q)         | EUR     | 4.16         | 15/01/2026 |
|                                          | Z (q)         | EUR     | 4.20         | 15/04/2026 |
|                                          | Z (q)         | EUR     | 4.20         | 15/04/2026 |
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth   | C             | EUR     | 3.53         | 30/04/2026 |
|                                          | C (q)         | EUR     | 0.95         | 15/01/2026 |
|                                          | C (q)         | EUR     | 0.97         | 15/04/2026 |
|                                          | I (q)         | EUR     | 9.84         | 15/01/2026 |
|                                          | I (q)         | EUR     | 9.99         | 15/04/2026 |
|                                          | R2            | EUR     | 3.99         | 30/04/2026 |
|                                          | Z (q)         | EUR     | 10.43        | 15/01/2026 |
|                                          | Z (q)         | EUR     | 10.62        | 15/04/2026 |

### Anhangangabe 8 – Swing Pricing

Für einige der Teilfonds der SICAV wurde die folgende Maßnahme vorgesehen:

An den Bewertungstagen, an denen die Differenz zwischen dem Betrag der Zeichnungen und dem Betrag der Rücknahmen in einem Teilfonds (d. h. die Nettotransaktionen) einen zuvor vom Verwaltungsrat festgelegten Schwellenwert überschreitet (Partial Swing Pricing), behält sich der Verwaltungsrat das Recht vor, den Nettoinventarwert zu ermitteln, indem er zu den Vermögenswerten (im Falle von Nettozeichnungen) einen pauschalen Prozentsatz an Gebühren und Kosten hinzufügt bzw. von den Vermögenswerten (im Falle von Nettorücknahmen) abzieht, der den Marktgepflogenheiten beim Kauf oder Verkauf von Wertpapieren für die Teilfonds Candriam L Multi-Asset Income und Candriam L Multi-Asset Income & Growth entspricht.

Zum 30. Juni 2026 wurde kein Swing Pricing angewandt.

Der Swing-Faktor ist der Betrag, um den der Nettoinventarwert schwankt, wenn der Swing-Pricing-Prozess ausgelöst wird, nachdem die Nettozeichnungen oder -rücknahmen die Swing-Schwelle überschritten haben. Zu den Faktoren, die bei der Festlegung des Schwingungsfaktors zu berücksichtigen sind, gehören:

Für die Equity-Methode:

- Vom Teilfonds gezahlte Netto-Maklerprovisionen
- Steuern (z. B. Stempelsteuer und Umsatzsteuer)



## Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

### Anhangangabe 8 – Swing Pricing (Fortsetzung)

| Teilfonds                              | Maximaler Swing-Faktor<br>Mittelzufluss (in %) | Maximaler Swing-Faktor<br>Mittelabfluss (in %) |
|----------------------------------------|------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| Candriam L Multi-Asset Income          | 0.04                                           | 0.03                                           |
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth | 0.05                                           | 0.03                                           |

### Anhangangabe 9 – Guthaben bei Banken und Brokern

Die Guthaben bei Kreditinstituten und Brokern in der Nettovermögensaufstellung umfassen die Kassenkonten und die Guthaben bei Brokern für Terminkontrakte und börsennotierte Optionen.

Der in der Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2026 enthaltene Teil der Guthaben bei Banken und Brokern stellt sich wie folgt dar:

| Teilfonds                                | Währung | Barmittel bei Brokern |
|------------------------------------------|---------|-----------------------|
| Candriam L Alternative Multi-Strategies  | EUR     | 2,296,649             |
| Candriam L Balanced Asset Allocation     | EUR     | 2,165,926             |
| Candriam L Conservative Asset Allocation | EUR     | 1,452,406             |
| Candriam L Dynamic Asset Allocation      | EUR     | 78,272                |
| Candriam L Multi-Asset Income            | EUR     | 3,692,499             |
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth   | EUR     | 2,123,689             |

### Anhangangabe 10 – Sicherheiten

Im Zusammenhang mit den außerbörslichen Derivaten wurden Barsicherheiten in folgender Höhe von Citigroup Global Markets Europe AG - Deutschland - LC, JP Morgan AG - Deutschland - LC, Morgan Stanley and Co Int - UK - SB, Natixis S.A., Nomura Financial Products Europe GMBH - DE - LC und Société Générale SA und UBS Europe SE gestellt bzw. empfangen:

| Teilfonds                                | Währung | Verbuchte Barsicherheiten | Gehaltene Barsicherheiten |
|------------------------------------------|---------|---------------------------|---------------------------|
| Candriam L Alternative Multi-Strategies  | EUR     | (11,860,000)              | 0                         |
| Candriam L Conservative Asset Allocation | EUR     | (370,000)                 | 0                         |
| Candriam L Multi-Asset Income            | EUR     | (790,000)                 | 0                         |
| Candriam L Multi-Asset Income & Growth   | EUR     | (20,000)                  | 0                         |

### Anhangangabe 11 – Änderungen der Portfoliozusammensetzung

Eine Liste der Transaktionen (Verkäufe und Käufe) in den Anlageportfolios ist kostenlos am Gesellschaftssitz der SICAV erhältlich.

### Anhangangabe 12 – Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Es gibt keine Ereignisse nach dem Bilanzstichtag.

## Zusätzliche ungeprüfte Angaben

### **Globale Risikoexposition**

#### **Risikomanagement – Berechnung des Gesamtrisikos**

Für alle Teilfonds außer Candriam L Alternative Multi-Strategies, Candriam L Multi-Asset Income und Candriam L Multi-Asset Income & Growth verwendet die SICAV den Commitment-Ansatz gemäß CSSF-Rundschreiben 11/512.

Die SICAV verwendet den absoluten „Value at Risk“-Ansatz (VaR), die historische Methode zur Berechnung des Gesamtrisikos der Teilfonds Candriam L Alternative Multi-Strategies, Candriam L Multi-Asset Income und Candriam L Multi-Asset Income & Growth. Dieser Ansatz misst den maximalen potenziellen Verlust bei einem gegebenen Konfidenzniveau (Wahrscheinlichkeit) über einen definierten Zeitraum unter normalen Marktumständen. Diese Berechnungen werden auf der Basis der folgenden Parameter ausgeführt: Konfidenzintervall von 99 %, Haltefrist von einem Tag (umgewandelt in eine Haltefrist von 20 Tagen) und historische Daten von drei Jahren.

## Zusätzliche ungeprüfte Angaben

### 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 österreichischen Sparkassen AG

Am Belvedere 1,

A-1100 Wien

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

#### Informationen für Anleger in der Bundesrepublik Deutschland

**Für die folgenden Teilfonds ist keine Anzeige nach § 310 Kapitalanlagegesetzbuch erstattet worden und Anteile dieser Teilfonds dürfen in der Bundesrepublik Deutschland nicht vertrieben werden:**

- Candriam L Balanced Asset Allocation
- Candriam L Conservative Asset Allocation
- Candriam L Dynamic Asset Allocation

**Unberührt bleibt eine etwaige im Rahmen des § 355 Absatz 4 Kapitalanlagegesetzbuch fortbestehende Berechtigung zu Tätigkeiten, die nach dem Investmentgesetz nicht als öffentlicher Vertrieb gelten.**

Einrichtung gemäß Art. 92 Abs. 1 der Richtlinie 2009/65/EG in der Fassung der Richtlinie (EU) 2021/2261 beziehungsweise § 306a KAGB

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

- Bei dieser Einrichtung können Aufträge zur Zeichnung, Rücknahme und zum Umtausch von Anteilen des OGAW nach Maßgabe der in den Verkaufsunterlagen genannten Voraussetzungen eingereicht werden.
- Sämtliche für einen Anteilinhaber bestimmte Zahlungen, einschließlich der Rücknahmeerlöse und etwaiger Ausschüttungen, können auf seinen Wunsch hin über diese Einrichtung geleitet werden.
- Bei dieser Einrichtung können Informationen darüber eingeholt werden, wie die genannten Aufträge erteilt werden können und wie Rücknahmeerlöse ausgezahlt werden.
- Diese Einrichtung erleichtert den Zugang zu Verfahren und Vorkehrungen gemäß Artikel 15 der Richtlinie 2009/65/EG in der Fassung der Richtlinie (EU) 2021/2261 beziehungsweise § 28 Abs. 2 Nr. 1 KAGB in Bezug auf die Wahrnehmung von Anlegerrechten (Anlegerbeschwerden) und informiert darüber.
- 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.
- Die Einrichtung versorgt die Anleger mit relevanten Informationen in Bezug auf die Aufgaben, die die Einrichtung erfüllt, auf einem dauerhaften Datenträger.
- 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 per Einschreiben an ihre im Anteilinhaberregister eingetragene Anschrift übersandt oder über jedes andere Kommunikationsmittel (einschließlich E-Mail) zugestellt. Bei Anteilhabern, die keine E-Mail-Adresse mitgeteilt haben, wird unterstellt, dass sie jegliche Kommunikation auf elektronischem Weg abgelehnt haben. 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.