

CANDRIAM MM MULTI STRATEGIES

DOCUMENT D'INFORMATION PÉRIODIQUE 28/06/2024

ETAT DU PATRIMOINE EN EUR

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique (*)
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-24-55 du code monétaire et financier	0,00
b) Avoirs bancaires	56 781,56
c) Autres actifs détenus par l'OPC	5 457 842,38
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	5 514 623,94
e) Passif	-15 607,58
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	5 499 016,36

(*) Les montants sont signés

NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART

Part	Type de part	Actif net de la part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
CANDRIAM MM MULTI STRATEGIES C EUR en EUR	C	98 827,84	64,624	1 529,27
CANDRIAM MM MULTI STRATEGIES F EUR en EUR	C	4 445 212,93	7 721,491	575,69
CANDRIAM MM MULTI STRATEGIES M EUR en EUR	C	954 975,59	514,700	1 855,40

ELEMENT DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier. Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	0,00	0,00
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts du fonds d'investissement à vocation générale.	0,00	0,00
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4 ° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	99,25	98,97

(*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine

(**) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

REPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
NEANT				

(*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine
(**) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

REPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR PAYS DE RESIDENCE DE L'EMETTEUR

Pays	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
NEANT		

(*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine
(**) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

REPARTITION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE

Nature d'actifs	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	62,15	61,98
Autres OPC et fonds d'investissements	37,10	36,99
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	0,00	0,00
Autres	0,00	0,00
TOTAL	99,25	98,97

(*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine

(**) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE EN EUR

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.		
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts du fonds d'investissement à vocation générale.	0,00	0,00
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4 ° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	7 732 522,60	15 461 229,25

INFORMATION SUR LES FRAIS DE GESTION VARIABLES

	28/06/2024
Part CANDRIAM MM MULTI STRATEGIES C EUR	
Frais de gestion variables provisionnés	126,51
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,01
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Part CANDRIAM MM MULTI STRATEGIES F EUR	
Frais de gestion variables provisionnés	3 543,02
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,08
Frais de gestion variables acquis	123,78
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Part CANDRIAM MM MULTI STRATEGIES I EUR	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Part CANDRIAM MM MULTI STRATEGIES M EUR	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00

« Le montant des frais de gestion variables affiché ci-dessus correspond à la somme des provisions et reprises de provisions ayant impacté l'actif net au cours de la période sous revue. »

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TITRES D'OPC			5 457 842,38	99,25
OPCVM			3 417 889,47	62,15
Gestion collective			3 417 889,47	62,15
Alpine Merger Arbitrage Fund A EUR Acc	EUR	0,004	0,39	0,00
BLACKROCK STRATEGIC FUNDS SICAV BLACKROCK EMERGING COMPANIES	EUR	2 692,51	340 037,09	6,18
FRANKLIN K2 ACTUSRAY EUROPEAN ALPHA UCITS FUND EO PF EUR	EUR	26 537,423	313 544,96	5,70
FRANKLIN K2 ELECTRON GLOBAL UCITS FUND I PF H1 CAP	EUR	23 628	364 761,98	6,63
HELIUM FD PERFORMANCE CLASSE E EUR	EUR	364,816	450 344,92	8,19
KLS Arete Macro Fund Class I EUR ACC	EUR	3 321,279	408 168,58	7,42
MAGA SMALLER COS UCITS FD-EU	EUR	2 782,854	478 984,83	8,71
Pictet TR - Mandarin HI EUR	EUR	2 092,031	319 390,37	5,81
RMM COURT TERME C	EUR	49	201 827,57	3,67
SCHRODER GAIA CONT T EQ-EEUR	EUR	3 475,54	540 828,78	9,84
Autres OPC et fonds d'investissement			2 039 952,91	37,10
Gestion collective			2 039 952,91	37,10
BLACKROCK EUROPEAN HEDGE I EUR	EUR	988,474	528 398,66	9,62
DISCUS FEEDER-D-STD LEV-EUR-FD	EUR	108,4835	297 586,51	5,41
GEMSSTOCK FD CLASS D EUR R S1	EUR	2 065,63	358 382,55	6,52
LYNX 1.5 B NEW ORIG SIE D	EUR	60,293	181 683,36	3,30
MAPLE LEAF OFFS.PRIV.INV CL-C- RES S.1	USD	118,1956	0,00	0,00
MASSAR MACR COM TRB SBT2 0816	USD	156,455372	303 717,94	5,52
ORSAY MERGER ARB EUR 3	EUR	154,26	370 183,89	6,73
Total			5 457 842,38	99,25

(*) Le secteur d'activité représente l'activité principale de l'émetteur de l'instrument financier ; il est issu de sources fiables reconnues au plan international (GICS et NACE principalement).

Inventaire des opérations à terme de devises

Type d'opération	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)			
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)	
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)
A/EUR/USD/20240830	0,00	-4 954,93	EUR	302 952,70	USD	-307 907,63
A/USD/EUR/20240830	0,00	-0,38	USD	5 579,98	EUR	-5 580,36
Total	0,00	-4 955,31		308 532,68		-313 487,99

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions exprimé dans la devise de comptabilisation.

Inventaire des instruments financiers à terme

Inventaire des instruments financiers à terme - actions

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - taux d'intérêts

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - de change

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - sur risque de crédit

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - autres expositions

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme ou des opérations à terme de devises utilisés en couverture d'une catégorie de part

L'OPC sous revue n'est pas concerné par cette rubrique.

Synthèse de l'inventaire

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	5 457 842,38
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	-4 955,31
Total instruments financiers à terme - actions	0,00
Total instruments financiers à terme - taux	0,00
Total instruments financiers à terme - change	0,00
Total instruments financiers à terme - crédit	0,00
Total instruments financiers à terme - autres expositions	0,00
Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises	0,00
Autres actifs (+)	56 781,56
Autres passifs (-)	-10 652,27
Passifs de financement (-)	0,00
Total = actif net	5 499 016,36

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part CANDRIAM MM MULTI STRATEGIES C EUR	EUR	64,624	1 529,27
Part CANDRIAM MM MULTI STRATEGIES F EUR	EUR	7 721,491	575,69
Part CANDRIAM MM MULTI STRATEGIES M EUR	EUR	514,700	1 855,40