CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

Document d'information périodique au 30/09/2026

Sommaire

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR 3

NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART OU ACTION 4

ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR 5

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR 6

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE 7

RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR DEVISE 8

RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR SECTEUR ÉCONOMIQUE 9

RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR 10

VENTILATION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE 11

COMMISSION DE PERFORMANCE 12

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT) 13

INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE 16

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS 17

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS 18

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE 19

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT 20

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS 21

INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART) 22

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART) 23

SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE 24

ÉTAT 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. 214-20 du code monétaire et financier	375 182 968,66
b) Avoirs bancaires	26 764 907,48
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	45 280 178,50
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	447 228 054,64
e) Passif	-1 776 879,58
f) Valeur nette d'inventaire	445 451 175,06

* Les montants sont signés

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

Code ISIN de la part	Libellé de la part	Affectation des sommes distribuables	Devise de la part	Actif net de la part en devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative en devise de la part
FR0013241452	PART CAPI EI	Capitalisable	EUR	3 842 549,23	34,361474	111 827,25
FR0014007LZ3	PART CAPI IC	Capitalisable	EUR	210 285 711,57	1 871,878	112 339,43
FR0007033477	PART CAPI RC	Capitalisable	EUR	223 924 785,72	92 116,273323	2 430,89
FR001400TCF4	PART CAPI S	Capitalisable	EUR	1 572,35	1,000000	1 572,35
FR0010290924	PART DIST RD	Distribuable	EUR	7 396 556,19	4 226,208817	1 750,16

ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR

Eléments du portefeuille titres :	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) Titres financiers éligibles et 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	84,23	83,89
b) Titres financiers éligibles et 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) Titres financiers éligibles et 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 de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières	0,00	0,00
d) Titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
e) Autres actifs	9,04	9,00

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

	Mouvements (en montant)	
Eléments du portefeuille titres :	**Acquisitions**	**Cessions**
a) Titres financiers éligibles et 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	1 630 173 394,09	1 598 688 445,23
b) Titres financiers éligibles et 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) Titres financiers éligibles et 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 de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières	0,00	0,00
d) Titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
e) Autres actifs	73 000 894,03	64 171 267,36

Mouvements intervenus au cours de la période	**Mouvements (en montant)**
Acquisitions	1 703 174 288,12
Cessions	1 662 859 712,59

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

	Part	Montant net unitaire	Crédit d'impôt	Montant brut unitaire
Dividendes versés				
27/08/2026		-	null	null
27/08/2026	PART DIST RD	46,37	0,00	46,37
Dividendes à verser				

RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR DEVISE

		Pourcentage	
Devise	**En montant (EUR)**	**Actif net**	**Total des actifs**
Euro	362 868 248,77	81,46	81,14
US DOLLAR	12 314 719,89	2,77	2,75
Total	**375 182 968,66**	**84,23**	**83,89**

RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR SECTEUR ÉCONOMIQUE

	Pourcentage	
Secteur économique	**Actif net**	**Total des actifs**
Banques	41,54	41,37
Automobiles et équipementiers	7,32	7,29
Distributeurs	4,96	4,94
Services bancaires invest et de courtage	4,40	4,38
Fournisseurs de services de télécommunications	4,21	4,19
Ingénierie Industrielle	3,51	3,49
Transport industriel	3,37	3,35
Bâtiment et matériaux de construction	2,23	2,22
Boissons	2,11	2,10
Instruments de placement hors actions	1,79	1,78
Logiciels et services informatiques	1,78	1,77
Equipements et services médicaux	1,68	1,68
Produits ménagers et constr individuelle	1,36	1,36
Services appui à industrie	1,35	1,35
Services aux consommateurs	0,94	0,94
Pharmacie/biotechnologie/Producteurs de Marijuana	0,90	0,90
Investissement immobilier et services	0,66	0,66
Chimie	0,12	0,12
Total	**84,23**	**83,89**

RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR

	Pourcentage	
Pays	**Actif net**	**Total des actifs**
France	19,11	19,03
Canada	10,53	10,49
États-Unis	10,07	10,03
Pays-Bas	7,62	7,59
Italie	7,20	7,17
Allemagne	6,36	6,34
Luxembourg	6,30	6,28
Royaume-Uni	5,59	5,57
Australie	3,76	3,74
Suède	2,61	2,59
Danemark	2,04	2,04
Japon	1,30	1,29
Suisse	1,11	1,10
Espagne	0,63	0,63
Total	**84,23**	**83,89**

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

	Pourcentage	
Nature d'actifs	**Actif net**	**Total des actifs**
Parts d'OPC	**9,04**	**9,00**
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	9,04	9,00
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	0,00	0,00
Autres OPC et fonds d'investissements	0,00	0,00
Autres actifs	**0,00**	**0,00**
Total	**9,04**	**9,00**

COMMISSION DE PERFORMANCE

PART CAPI EI	30/09/2026
Commission de performance (frais variables)	1 142,87
Pourcentage de commission de performance*	0,03

PART CAPI IC	30/09/2026
Commission de performance (frais variables)	15 045,39
Pourcentage de commission de performance*	0,01

PART CAPI RC	30/09/2026
Commission de performance (frais variables)	85 993,53
Pourcentage de commission de performance*	0,04

PART CAPI S	30/09/2026
Commission de performance (frais variables)	0,54
Pourcentage de commission de performance*	0,03

PART DIST RD	30/09/2026
Commission de performance (frais variables)	2 355,83
Pourcentage de commission de performance*	0,03

*Par rapport à l'actif net moyen

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Obligations			**318 729 873,25**	**71,55**
Autres obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			**318 729 873,25**	**71,55**
Automobiles et équipementiers			32 603 664,29	7,32
BMW 2 5/8 01/27/29	EUR	7 000	6 929 409,31	1,55
CONGR 2 7/8 06/09/29	EUR	6 200	6 083 428,96	1,37
HNDA 2.85 06/27/28	EUR	7 000	6 933 597,81	1,56
PCAR 3 1/2 09/09/29	EUR	2 625	2 602 255,63	0,58
TOYOTA Float 10/16/26	EUR	7 000	7 043 281,75	1,58
VW Float 06/10/27	EUR	3 000	3 011 690,83	0,68
Banques			174 965 000,18	39,28
ABNANV Float 01/21/28	EUR	70	7 060 678,14	1,59
ACAFP 2 05/02/27	EUR	388	5 792 967,37	1,30
ANZ Float 10/29/27	EUR	10 000	10 077 775,00	2,26
BACR 3.32 06/17/29	EUR	8 000	7 945 940,82	1,78
BBVASM Float 01/15/29	EUR	28	2 825 064,59	0,63
BFCM 3,40%14-221226 TSR	EUR	4 500	461 972,16	0,10
BMO Float 03/24/29	EUR	6 000	6 014 304,00	1,35
BMO Float 04/12/27	EUR	9 778	9 853 759,94	2,21
BNP 4 5/8 03/13/27	USD	5 000	4 403 370,80	0,99
BNS Float 06/10/27	EUR	7 000	7 027 329,17	1,58
BPCEGP Float 03/08/27	EUR	10	1 004 202,67	0,23
CBAAU Float 12/15/27	EUR	6 633	6 659 509,71	1,49
DEKA 3 5/8 09/14/29	EUR	94	9 320 924,11	2,09
HSBC 3 1/8 06/07/28	EUR	8 000	8 004 936,99	1,80
JPM Float 02/18/29	EUR	10 625	10 677 885,94	2,40
LEASYS Float 01/29/27	EUR	6 500	6 543 710,69	1,47
NDB 2 3/4 10/02/28	EUR	100	9 921 400,00	2,23
NWG 3 1/8 06/30/29	EUR	5 000	4 931 539,73	1,11
NYKRE 4 07/17/28	EUR	9 000	9 107 985,21	2,04
SG 1,375%17-130128 EMTN	EUR	129	12 676 312,23	2,85
SWEDA 2 7/8 04/30/29	EUR	8 700	8 588 978,47	1,93
TD Float 07/28/28	EUR	6 000	6 068 968,00	1,36
TD Float 09/10/29	EUR	10 000	10 023 563,89	2,25
UCGIM 3.3 07/16/29	EUR	10 000	9 971 920,55	2,24
Boissons			9 380 315,75	2,11
HEIANA 2.565 10/03/28	EUR	9 333	9 380 315,75	2,11
Chimie			529 888,10	0,12
AKZANA 3 5/8 06/16/29	EUR	531	529 888,10	0,12
Distributeurs			22 088 499,98	4,96
LEASYS 2 7/8 08/17/27	EUR	2 000	1 997 286,58	0,45
LEASYS 3 7/8 03/01/28	EUR	4 900	5 012 726,18	1,13
LEASYS Float 07/27/28	EUR	10 000	10 077 853,89	2,26
LEASYS Float 09/22/27	EUR	5 000	5 000 633,33	1,12

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Fournisseurs de services de télécommunications			10 846 464,89	2,43
NTT Float 06/20/28	EUR	5 769	5 777 838,27	1,29
ORAFP 3 5/8 09/15/29	EUR	51	5 068 626,62	1,14
Ingénierie Industrielle			15 623 620,68	3,51
TRAGR Float 05/07/27	EUR	40	4 020 340,44	0,90
TRAGR Float 09/18/27	EUR	50	5 011 190,83	1,13
TRATON FIN LUX 3,75%24-270327	EUR	35	3 575 907,33	0,80
VLVY Float 01/09/28	EUR	3 000	3 016 182,08	0,68
Instruments de placement hors actions			7 974 952,67	1,79
MS Float 04/05/28	EUR	3 000	3 035 196,67	0,68
ZKB 2.02 04/13/28	EUR	4 930	4 939 756,00	1,11
Investissement immobilier et services			2 954 179,73	0,66
AROUNDTOWN 0,375%21-150427	EUR	30	2 954 179,73	0,66
Logiciels et services informatiques			7 923 064,48	1,78
CAPFP 2 1/2 09/25/28	EUR	40	3 904 757,81	0,88
IBM Float 02/03/28	EUR	4 000	4 018 306,67	0,90
Pharmacie/biotechnologie/Producteurs de Marijuana			4 010 008,33	0,90
GSK Float 03/07/28	EUR	4 000	4 010 008,33	0,90
Services appui à industrie			6 034 738,33	1,35
FIS Float 03/10/28	EUR	6 000	6 034 738,33	1,35
Services aux consommateurs			4 209 422,82	0,94
AYVFP 3 7/8 02/22/27	EUR	41	4 209 422,82	0,94
Services bancaires invest et de courtage			19 586 053,02	4,40
C Float 05/29/28	EUR	50	5 018 531,11	1,13
ENXFP 2 5/8 11/26/28	EUR	3 000	2 993 683,56	0,67
GS Float 02/17/29	EUR	9 000	9 049 761,50	2,03
HYNMTR 2 7/8 06/26/28	EUR	2 546	2 524 076,85	0,57
Titres de créances			**56 453 095,41**	**12,67**
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé			**56 453 095,41**	**12,67**
Banques			10 056 487,56	2,26
3CIF BMT03022028	EUR	10 000 000	10 056 487,56	2,26
Bâtiment et matériaux de construction			9 941 123,69	2,23
VICAT NCP09122026	EUR	10 000 000	9 941 123,69	2,23
Equipements et services médicaux			7 494 801,27	1,68
EUROFI NCP09102026	EUR	7 500 000	7 494 801,27	1,68
Fournisseurs de services de télécommunications			7 911 349,09	1,78
USCP TELUS CORP 26	USD	9 000 000	7 911 349,09	1,78
Produits ménagers et constr individuelle			6 059 331,80	1,36
SEB BMT13102027	EUR	6 000 000	6 059 331,80	1,36
Transport industriel			14 990 002,00	3,36
STEF NCP09102026	EUR	15 000 000	14 990 002,00	3,36
Parts d'OPC et fonds d'investissements			**40 247 198,69**	**9,04**
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne			**40 247 198,69**	**9,04**
CM-AM CASH ISR-IC	EUR	35,603	20 107 372,09	4,51

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
CM-AM DOLLAR CASH-C	USD	32,151	65 164,98	0,02
SLF (F) BOND 6M I CAP	EUR	1 677,332	20 074 661,62	4,51
Total			**415 430 167,35**	**93,26**

INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE

Libellé instrument	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)			
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)	
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)
V USD EUR 15/03/27	0,00	128 284,71	EUR	4 346 612,35	USD	-4 474 897,06
V USD EUR 19/10/26	0,00	332 809,15	EUR	7 590 015,05	USD	-7 922 824,20
Total	**0,00**	**461 093,86**		**11 936 627,40**		**-12 397 721,26**

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

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS

Instruments financiers à terme – actions				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		**0,00**	**0,00**	**0,00**
Options				
Sous total		**0,00**	**0,00**	**0,00**
Swaps				
Sous total		**0,00**	**0,00**	**0,00**
Autres instruments				
Sous total		**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.

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS

Instruments financiers à terme – taux d'intérêts				
Libellé instrument	**Quantité/Nominal**	**Valeur actuelle présentée au bilan**		**Montant de l'exposition en Euro (*)**
		Actif	**Passif**	**+/-**
Futures				
Sous total		**0,00**	**0,00**	**0,00**
Options				
Sous total		**0,00**	**0,00**	**0,00**
Swaps				
SWTBBV0709292.9174/O	5 000 000,00	38 817,36	0,00	5 000 000,00
SWTCA 0203272.5332/O	25 000 000,00	5 824,79	0,00	25 000 000,00
SWTCA 2711262.3952/O	100 000 000,00	3 799,53	0,00	100 000 000,00
SWTNAT0809292.9079/O	10 000 000,00	80 511,70	0,00	10 000 000,00
SWTNAT1408281.9272/O	5 000 000,00	113 578,89	0,00	5 000 000,00
SWTNOM2411281.9748/O	10 000 000,00	255 396,62	0,00	10 000 000,00
SWTSG 1907282.08140/	4 000 000,00	75 855,93	0,00	4 000 000,00
SWTSG 3011262.4089/O	100 000 000,00	3 443,18	0,00	100 000 000,00
SWTUBM0807282.4209/O	10 000 000,00	120 610,07	0,00	10 000 000,00
Sous total		**697 838,07**	**0,00**	**269 000 000,00**
Autres instruments				
Sous total		**0,00**	**0,00**	**0,00**
Total		**697 838,07**	**0,00**	**269 000 000,00**

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

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE

Instruments financiers à terme – de change				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		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.

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT

Instruments financiers à terme – sur risque de crédit				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		**0,00**	**0,00**	**0,00**
Options				
Sous total		**0,00**	**0,00**	**0,00**
Swaps				
Sous total		**0,00**	**0,00**	**0,00**
Autres instruments				
Sous total		**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.

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS

Instruments financiers à terme – autres expositions				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		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 OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)

Libellé instrument	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)				Classe de part couverte
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)		
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)	
Total	**0,00**	**0,00**		**0,00**		**0,00**	

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

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)

Libellé instrument	Quantité/ Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)	Classe de part couverte
		Actif	Passif	+/-	
Futures					
Sous total		**0,00**	**0,00**	**0,00**	
Options					
Sous total		**0,00**	**0,00**	**0,00**	
Swaps					
Sous total		**0,00**	**0,00**	**0,00**	
Autres instruments					
Sous total		**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.

SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	415 430 167,35
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	-461 093,86
Total instruments financiers à terme - actions	0,00
Total instruments financiers à terme - taux	697 838,07
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 (+)	31 100 049,22
Autres passifs (-)	-1 315 785,72
Total = actif net	**445 451 175,06**