

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

Document d'information périodique au 30/09/2025

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

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	15
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS	16
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS	17
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE	18
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT	19
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS	20
INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	21
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	22
SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE	23

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR

Éléments 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	313 089 113,19
b) Avoirs bancaires	42 188 780,32
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	39 640 285,80
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	394 918 179,31
e) Passif	-10 661 947,72
f) Valeur nette d'inventaire	384 256 231,59

* Les montants sont signés

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

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 (EUR)	Nombre de parts	Valeur liquidative (EUR)
FR0013241452	PART CAPI EI	Capitalisable	EUR	4 760 765,52	43,520350	109 391,71
FR0014007LZ3	PART CAPI IC	Capitalisable	EUR	73 144 169,62	665,596	109 892,74
FR0007033477	PART CAPI RC	Capitalisable	EUR	260 477 513,16	109 538,725104	2 377,94
FR001400TCF4	PART CAPI S	Capitalisable	EUR	1 537,71	1,000000	1 537,71
FR0010290924	PART DIST RD	Distribuable	EUR	45 872 245,58	26 101,675551	1 757,44

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

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	81,48	79,28
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	9,31	9,06

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

Eléments du portefeuille titres :	Mouvements (en montant)	
	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	190 048 840,32	189 007 055,72
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	31 457 514,85	27 004 863,01

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	221 506 355,17
Cessions	216 011 918,73

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

	Part	Montant net unitaire	Crédit d'impôt	Montant brut unitaire
Dividendes versés				
27/08/2025	PART DIST RD	45,00	0,00	45,00
Dividendes à verser				

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

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

Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
		Actif net	Total des actifs
Euro	304 481 693,27	79,24	77,10
Franc suisse	8 607 419,92	2,24	2,18
Total	313 089 113,19	81,48	79,28

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

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

Secteur économique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Banques	43,97	42,78
Services aux consommateurs	9,82	9,55
Automobiles et équipementiers	7,69	7,49
Bâtiment et matériaux de construction	3,48	3,38
Boissons	2,43	2,37
Services bancaires invest et de courtage	2,41	2,34
Equipements et services médicaux	2,24	2,18
Ingénierie Industrielle	2,24	2,18
Transport industriel	2,08	2,03
Soins personnels pharmacies et épiceries	1,95	1,90
Distributeurs	1,18	1,15
Logiciels et services informatiques	1,04	1,01
Energie non renouvelable	0,76	0,73
Matériel équipements destinés aux TI	0,19	0,19
Total	81,48	79,28

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

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

Pays	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
France	24,40	23,74
Pays-Bas	12,70	12,35
Allemagne	11,62	11,30
Canada	10,94	10,65
États-Unis	4,75	4,62
Australie	4,36	4,24
Espagne	4,14	4,03
Royaume-Uni	3,50	3,41
Suède	2,19	2,14
Italie	1,94	1,88
Luxembourg	0,94	0,92
Total	81,48	79,28

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

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

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Parts d'OPC	9,31	9,06
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	9,31	9,06
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	9,31	9,06

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

COMMISSION DE PERFORMANCE

PART CAPI EI	30/09/2025
Commission de performance (frais variables)	2 966,93
Pourcentage de commission de performance*	0,06
PART CAPI IC	30/09/2025
Commission de performance (frais variables)	34 155,40
Pourcentage de commission de performance*	0,06
PART CAPI RC	30/09/2025
Commission de performance (frais variables)	169 571,73
Pourcentage de commission de performance*	0,06
PART CAPI S	30/09/2025
Commission de performance (frais variables)	1,03
Pourcentage de commission de performance*	0,07
PART DIST RD	30/09/2025
Commission de performance (frais variables)	3 639,95
Pourcentage de commission de performance*	0,05

*Par rapport à l'actif net moyen

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Obligations			267 606 371,66	69,64
Autres obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			267 606 371,66	69,64
Automobiles et équipementiers			29 564 794,75	7,69
HND 2.85 06/27/28	EUR	7 000	7 075 557,81	1,84
TOYOTA Float 10/16/26	EUR	7 000	7 048 080,67	1,83
VOLKSWAGEN BANK 4,25%23-070126	EUR	71	7 353 295,90	1,91
VW 3 3/4 09/10/26	EUR	5 000	5 073 251,37	1,32
VW Float 06/10/27	EUR	3 000	3 014 609,00	0,79
Banques			158 892 383,33	41,35
ABNANV Float 01/21/28	EUR	70	7 061 022,89	1,84
ABNANV Float 02/25/27	EUR	245	24 595 991,00	6,40
ACAFP 3.4 07/24/26	EUR	4 500 000	4 559 410,00	1,19
ACAFP 4 10/12/26	EUR	50	5 197 020,55	1,35
ANZ Float 10/29/27	EUR	10 000	10 074 954,17	2,62
BFCM 3,40%14-221226 TSR	EUR	4 500	465 221,16	0,12
BFCM 4,25%14-270626	EUR	4 500	460 280,03	0,12
BMO Float 04/12/27	EUR	9 778	9 850 368,06	2,56
BNP 0 1/4 04/13/27	EUR	35	3 465 588,29	0,90
BNS Float 06/10/27	EUR	7 000	7 030 148,22	1,83
BPCE 3,85%14-250626 TSR	EUR	1 000 000	1 007 288,61	0,26
BPCE 3%16-190726 EMTN	EUR	1 000 000	1 007 424,13	0,26
BPCE TV24-080327	EUR	10	1 006 082,00	0,26
CBAAU Float 12/15/27	EUR	6 633	6 664 823,29	1,73
CCDJ Float 01/17/26	EUR	10 000	10 067 040,00	2,62
COMMERZBANK TV24-120327	EUR	16	1 605 209,78	0,42
DB Float 08/18/27	EUR	100	10 043 400,00	2,61
DEUTSCHE BANK TV24-150126	EUR	75	7 555 067,50	1,97
LEASYS Float 01/29/27	EUR	6 500	6 544 607,15	1,70
LLOYDS BANK GRP TV24-050327	EUR	6 500	6 525 558,00	1,70
MIZUHO INTL 0%24-160226	EUR	7 000	6 938 235,50	1,81
RENAUL Float 09/14/26	EUR	30	3 010 459,00	0,78
RY Float 11/04/26	EUR	9 000	9 047 583,00	2,36
SOCIETEGENERALE TV24-190126	EUR	90	9 055 153,00	2,36
TD Float 07/28/28	EUR	6 000	6 054 448,00	1,58
Bâtiment et matériaux de construction			3 435 748,11	0,89
ASSA ABLOY 3,75%23-130926	EUR	3 385	3 435 748,11	0,89
Boissons			9 347 466,15	2,43
HEIANA 2.565 10/03/28	EUR	9 333	9 347 466,15	2,43
Distributeurs			4 539 202,27	1,18
LEASYS 2 7/8 08/17/27	EUR	2 000	2 017 586,58	0,52
LEASYS Float 04/08/26	EUR	2 500	2 521 615,69	0,66
Energie non renouvelable			2 901 949,21	0,76
SNAM TV24-150426	EUR	2 884	2 901 949,21	0,76

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Equipements et services médicaux			8 607 419,92	2,24
TMO 0.832 09/07/26	CHF	1 600	8 607 419,92	2,24
Ingénierie Industrielle			8 615 976,85	2,24
TRATON FIN LUX 3,75%24-270327	EUR	35	3 621 932,33	0,94
VLVY 2 1/2 09/18/26	EUR	5 000	4 994 044,52	1,30
Logiciels et services informatiques			3 997 317,81	1,04
CAPFP 2 1/2 09/25/28	EUR	40	3 997 317,81	1,04
Matériel équipements destinés aux TI			735 382,25	0,19
ASML HLDG 3,5%23-061225	EUR	714	735 382,25	0,19
Services aux consommateurs			27 724 482,99	7,22
ALD 3,875% 22022027	EUR	41	4 275 186,82	1,11
ALDFP Float 10/06/25	EUR	75	7 548 089,38	1,97
ARVAL SERV LEAS 3,375%22-0126	EUR	6	615 478,93	0,16
ARVAL SERV LEAS 4,125%23-0426	EUR	23	2 356 185,22	0,61
ARVAL SERV LEAS 4,25%23-111125	EUR	63	6 547 038,53	1,71
ARVAL SERV LEAS 4% 220926	EUR	63	6 382 504,11	1,66
Services bancaires invest et de courtage			9 244 248,02	2,41
HYNMTR 2 7/8 06/26/28	EUR	2 546	2 573 112,81	0,67
SOCGEN 3 02/12/27	EUR	65	6 671 135,21	1,74
Titres de créances			45 482 741,53	11,84
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé			45 482 741,53	11,84
Banques			10 068 178,95	2,62
ALL.B. BMT07082026	EUR	5 000 000	5 033 101,78	1,31
BMT STELLA 211026	EUR	5 000 000	5 035 077,17	1,31
Bâtiment et matériaux de construction			9 928 969,10	2,59
VICAT NCP02022026	EUR	10 000 000	9 928 969,10	2,59
Services aux consommateurs			9 996 132,38	2,60
ECP SIXT SE	EUR	10 000 000	9 996 132,38	2,60
Soins personnels pharmacies et épiceries			7 492 963,30	1,95
ITMENT NCP15102025	EUR	7 500 000	7 492 963,30	1,95
Transport industriel			7 996 497,80	2,08
STEF NCP07102025	EUR	8 000 000	7 996 497,80	2,08
Parts d'OPC et fonds d'investissements			35 779 659,46	9,31
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne			35 779 659,46	9,31
CM-AM CASH ISR-IC	EUR	18,996	10 495 250,68	2,73
CM-AM DOLLAR CASH-C	USD	31,084	58 617,89	0,02
SLF (F) BOND 6M I CAP	EUR	2 152,004	25 225 790,89	6,56
Total			348 868 772,65	90,79

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

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 CHF EUR 07/09/26	55 868,72	0,00	EUR	8 856 396,46	CHF	-8 800 527,74
Total	55 868,72	0,00		8 856 396,46		-8 800 527,74

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

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

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.

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

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				
SWTNAT1408281.9272/O	5 000 000,00	9 276,48	0,00	5 000 000,00
Sous total		9 276,48	0,00	5 000 000,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		9 276,48	0,00	5 000 000,00

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

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

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.

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

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.

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

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.

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

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.

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

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.

CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM

SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	348 868 772,65
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	55 868,72
Total instruments financiers à terme - actions	0,00
Total instruments financiers à terme - taux	9 276,48
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 (+)	45 984 261,46
Autres passifs (-)	-10 661 947,72
Total = actif net	384 256 231,59