

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

Informationsdokument vom 30.09.2024

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

Inhalt

VERMÖGENSAUFSTELLUNG IN EUR	3
ANZAHL DER ANTEILE IM UMLAUF UND NETTOINVENTARWERT PRO ANTEIL	4
BESTANDTEILE DES WERTPAPIERPORTFOLIOS IN EUR	5
VERÄNDERUNG DES WERTPAPIERBESTANDS IM BERICHTSZEITRAUM IN EUR	6
AUSSCHÜTTUNGEN IM BERICHTSZEITRAUM	7
VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH WÄHRUNG	8
VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH WIRTSCHAFTSSEKTOR	9
VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH DEM SITZLAND DES EMITTENTEN	10
AUFSCHLÜSSELUNG DER SONSTIGEN VERMÖGENSWERTE E) DES WERTPAPIERPORTFOLIOS NACH ART	11
AN DIE WERTENTWICKLUNG GEBUNDENE GEBÜHREN	12
AUFSTELLUNG DER ZULÄSSIGEN AKTIVA UND PASSIVA (OHNE TFI)	13
AUFSTELLUNG DER DEISEN-TERMINGESCHÄFTE	18
TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – AKTIEN	19
TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – ZINSSÄTZE	20
TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – DEISEN	21
TERMINFINANZINSTRUMENTE – KREDITRISIKO	22
TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – SONSTIGE ENGAGEMENTS	23
AUFSTELLUNG DER DEISEN-TERMINGESCHÄFTE (ZUR ABSICHERUNG EINER ANTEILSKLASSE VERWENDET)	24
TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – DEISEN (ZUR ABSICHERUNG EINER ANTEILSKLASSE VERWENDET)	25
ZUSAMMENFASSENDE AUFSTELLUNG	26

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

VERMÖGENSAUFSTELLUNG IN EUR

Bestandteile der Vermögensaufstellung	Betrag zum Abschluss des Berichtszeitraums *
a) Zulässige Finanzwerte gemäß Artikel L. 214-20 Absatz I, Satz 1 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes	154 609 995,77
b) Bankguthaben	728 362,60
c) Sonstige Aktiva des OGAW	8 514 823,78
d) Vom OGAW gehaltene Vermögenswerte insgesamt	163 853 182,15
e) Passiva	-63 742,79
f) Nettoinventarwert	163 789 439,36

* Negative Beträge sind mit einem Minuszeichen gekennzeichnet

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

ANZAHL DER ANTEILE IM UMLAUF UND NETTOINVENTARWERT PRO ANTEIL

ISIN-Code der Anteilsklasse	Bezeichnung der Anteilsklasse	Verwendung der ausschüttungs-fähigen Beträge	Währung der Anteils-klasse	Nettovermögen der Anteilsklasse (EUR)	Anzahl Anteile	Nettoinventar-wert (EUR)
FR0014003BE8	ANTEILSKLASSE THES. IC	Thesaurierbar	EUR	34 908 151,20	283,819	122 994,41
FR0011829134	ANTEILSKLASSE THES. RC	Thesaurierbar	EUR	87 935 103,95	701 838,783	125,29
FR0013295383	ANTEILSKLASSE THES. S	Thesaurierbar	EUR	37 341 821,62	296 031,776	126,14
FR0011859230	ANTEILSKLASSE AUSSCH. RD	Ausschüttbar	EUR	3 604 362,59	40 979,297	87,95

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

BESTANDTEILE DES WERTPAPIERPORTFOLIOS IN EUR

Bestandteile des Wertpapierbestands :	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
a) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Währungs- und Finanzgesetzbuchs regulierten Markt gehandelt werden	94,40	94,36
b) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist und in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Unterzeichnerstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum liegt, gehandelt werden	0,00	0,00
c) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die zum amtlichen Handel an einer Wertpapierbörse eines Drittstaats zugelassen sind oder an einem anderen organisierten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt eines Drittstaats gehandelt werden, sofern die betreffende Börse oder der betreffende Markt nicht auf einer von der AMF veröffentlichten Liste steht oder die Auswahl dieser Börse oder dieses Markts per Gesetz oder im Reglement oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist	0,00	0,00
d) Neu emittierte Finanztitel, die in Abschnitt I, Absatz 4 des Artikels R. 214-11 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) genannt sind	0,00	0,00
e) Sonstige Aktiva	4,42	4,42

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

VERÄNDERUNG DES WERTPAPIERBESTANDS IM BERICHTSZEITRAUM IN EUR

Bestandteile des Wertpapierbestands :	Veränderung (Betrag)	
	Käufe	Veräußerungen
a) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Währungs- und Finanzgesetzbuchs regulierten Markt gehandelt werden	61 002 893,21	39 858 453,05
b) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist und in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Unterzeichnerstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum liegt, gehandelt werden	0,00	0,00
c) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die zum amtlichen Handel an einer Wertpapierbörse eines Drittstaats zugelassen sind oder an einem anderen organisierten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt eines Drittstaats gehandelt werden, sofern die betreffende Börse oder der betreffende Markt nicht auf einer von der AMF veröffentlichten Liste steht oder die Auswahl dieser Börse oder dieses Markts per Gesetz oder im Reglement oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist	0,00	0,00
d) Neu emittierte Finanztitel, die in Abschnitt I, Absatz 4 des Artikels R. 214-11 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) genannt sind	0,00	0,00
e) Sonstige Aktiva	3 999 980,26	6 781 480,18

Veränderung im Berichtszeitraum	Veränderung (Betrag)
Käufe	65 002 873,47
Veräußerungen	46 639 933,23

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

AUSSCHÜTTUNGEN IM BERICHTSZEITRAUM

	Anteilsklasse	Nettobetrag je Anteil	Steuerguthaben	Bruttobetrag je Anteil
Ausgeschüttete Dividenden				
07/08/2024	ANTEILSKLASSE AUSSCH. RD	2,85	0,00	2,85
Auszuschüttende Dividenden				

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH WÄHRUNG

		Prozentsatz	
Währung	Betrag (EUR)	Nettovermögen	Gesamtvermögen
Euro	154 609 995,77	94,40	94,36
Summe	154 609 995,77	94,40	94,36

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH WIRTSCHAFTSSEKTOR

Wirtschaftssektor	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
Automobil und Zulieferer	13,08	13,08
Festnetztelefonie	11,07	11,07
Strom	5,81	5,81
Reise und Freizeit	5,77	5,77
Banken	5,57	5,56
Einzelhandel	4,49	4,49
Pharmazeutische u. Biotechnologie-Industrie	4,23	4,22
Allgemeine Finanzen	3,53	3,53
Produkte für den Hausgebrauch	3,21	3,21
Industrieller Transport	3,10	3,10
Andere Anlageinstrumente als Aktien	2,88	2,88
Unterstützungsdienste für Unternehmen	2,76	2,76
Gas, Wasser und sonstige Versorgungsdienste	2,32	2,31
Inv. Immobilien und Dienstl.	2,28	2,28
EDV-Geräte und -Ausrüstung	2,26	2,26
Elektronik / Elektrische Geräte	2,22	2,22
	2,21	2,20
Industriemetalle	2,04	2,04
Gesundheitseinrichtungen und -dienste	1,71	1,71
Medien	1,64	1,64
Nahrungsmittel	1,53	1,53
Ausrüstg. Dienstleistg./Vertr. Erdölprod.	1,45	1,45
Allgemeine Industrie	1,34	1,34
Chemie	1,05	1,05
Mobiltelefonie	0,97	0,97
Bau / Grundstoffe	0,96	0,96
Erdölgesellschaften	0,80	0,80
IMMOBILIENINVESTMENTGES.	0,71	0,71
Freizeitartikel	0,67	0,67
Getränke	0,64	0,64
Forstwirtschaft und Papier	0,61	0,61
Ausschüttung	0,60	0,60
Haushaltsgeräte / -produkte	0,48	0,48
Anlageinstrum. in Aktien	0,41	0,41
Summe	94,40	94,36

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH DEM SITZLAND DES EMITTENTEN

Land	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
Frankreich	29,92	29,90
Niederlande	13,37	13,36
Deutschland	11,70	11,70
Italien	11,59	11,58
USA	7,60	7,60
Vereinigtes Königreich	4,38	4,38
Spanien	3,89	3,89
Schweden	3,64	3,64
Dänemark	1,63	1,63
Japan	1,33	1,33
Luxemburg	1,07	1,07
Portugal	0,99	0,99
Irland	0,96	0,96
Britische Jungferninseln	0,64	0,64
Belgien	0,61	0,61
Österreich	0,60	0,60
Türkei	0,48	0,48
Summe	94,40	94,36

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

AUFSCHLÜSSELUNG DER SONSTIGEN VERMÖGENSWERTE E) DES WERTPAPIERPORTFOLIOS NACH ART

Art des Wertpapiers	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
OGA-Anteile	4,42	4,42
Summe OGAW und vergleichbare Titel aus anderen EU-Mitgliedstaaten	4,42	4,42
Summe AIF und vergleichbare Titel aus anderen EU-Mitgliedstaaten	0,00	0,00
Sonstige OGA und Investmentfonds	0,00	0,00
Sonstige Aktiva	0,00	0,00
Summe	4,42	4,42

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

AN DIE WERTENTWICKLUNG GEBUNDENE GEBÜHREN

ANTEILSKLASSE THES. IC	30.09.2024
An die Wertentwicklung gebundene Gebühren (variable Kosten)	0,00
Prozentualer Anteil der an die Wertentwicklung gebundenen	0,00

ANTEILSKLASSE THES. RC	30.09.2024
An die Wertentwicklung gebundene Gebühren (variable Kosten)	0,00
Prozentualer Anteil der an die Wertentwicklung gebundenen	0,00

ANTEILSKLASSE THES. S	30.09.2024
An die Wertentwicklung gebundene Gebühren (variable Kosten)	0,00
Prozentualer Anteil der an die Wertentwicklung gebundenen	0,00

ANTEILSKLASSE AUSSCH. RD	30.09.2024
An die Wertentwicklung gebundene Gebühren (variable Kosten)	0,00
Prozentualer Anteil der an die Wertentwicklung gebundenen	0,00

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

AUFSTELLUNG DER ZULÄSSIGEN AKTIVA UND PASSIVA (OHNE TFI)

Instrumente	Währung	Menge	Betrag	%NV
Anleihen			154 609 995,77	94,40
In Aktien wandelbare Anleihen, die an einem geregelten Markt gehandelt werden			2 512 959,93	1,54
Festnetztelefonie			2 512 959,93	1,54
KPN 4 7/8 PERP	EUR	1 500	1 545 929,79	0,95
TELEFO 2 7/8 PERP	EUR	10	967 030,14	0,59
Sonstige an einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelte Anleihen und ähnliche Wertpapiere			152 097 035,84	92,86
Nahrungsmittel			2 503 703,32	1,53
BEL 4,375%24-110429	EUR	5	523 808,08	0,32
TEREOS 5 7/8 04/30/30	EUR	400	409 818,01	0,25
TEREOS FINANCE 7,25%23-150428	EUR	500	535 450,56	0,33
TEREOS FINANCE 7,5%20-301025	EUR	1 000	1 034 626,67	0,63
Freizeitartikel			1 094 766,41	0,67
DOMETIC GROUP 3%19-080526	EUR	1 100	1 094 766,41	0,67
Automobil und Zulieferer			21 424 025,24	13,08
CIE PLASTIC 4,875%13032029	EUR	7	718 363,11	0,44
FORD MOTOR 4,867% 030827	EUR	1 000	1 042 160,55	0,64
FORD MOTOR CRED 3,25%20-150925	EUR	800	800 922,96	0,49
FORVIA 2,75%21-150227	EUR	1 300	1 260 965,69	0,77
FORVIA 3,125%19-150626	EUR	500	496 854,10	0,30
FORVIA 5,125%24-150629	EUR	1 000	1 011 892,64	0,62
3,25%18-300426	EUR	600	600 337,33	0,37
JAGUAR LAND 6,875%19-151126	EUR	1 500	1 625 224,79	0,99
MAHLE 2,375%14052028	EUR	8	700 235,73	0,43
NISSAN MOTOR 2,652%20-170326	EUR	1 000	1 002 418,85	0,61
RENAULT 1,25%19-240625	EUR	10	986 644,66	0,60
RENAULT 2,5%21-020627	EUR	16	1 571 001,86	0,96
SCHAEFFLER 4,5%24-280330	EUR	20	2 022 116,16	1,23
VALEO 28MAY2027 EUR	EUR	18	1 891 425,70	1,15
VOLVO CAR 4,25%22-310528	EUR	700	716 294,85	0,44
VW INTL FINANCE TV18-PERP.	EUR	4	395 900,44	0,24
VW INTL FINANCE TV20-PERP.	EUR	8	801 272,22	0,49
ZF EU FINANCE 4,75%24-310129	EUR	15	1 505 619,67	0,92
ZF FIN 2,75%20-250527	EUR	13	1 246 601,88	0,76
ZF FIN 5,75%23-030826	EUR	10	1 027 772,05	0,63
Banken			9 116 221,26	5,57
BANCO BPM TV20-140930 EMTN	EUR	1 000	1 011 095,75	0,62
BANCO SABADEL TV33	EUR	10	1 079 126,03	0,66
COMMERZBANK TV23-051033	EUR	10	1 162 966,72	0,71
DEUTSCHE BANK TV22-240632	EUR	15	1 515 733,36	0,92
INTESA SANPAOLO TV23-200234	EUR	1 500	1 679 709,59	1,03
RENAUL 5 1/2 10/09/34	EUR	10	1 035 753,22	0,63
UNICREDIT TV24-160434	EUR	1 500	1 631 836,59	1,00
Getränke			1 043 590,42	0,64
PICSUR 6 3/8 07/01/29	EUR	1 000	1 043 590,42	0,64

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

AUFSTELLUNG DER ZULÄSSIGEN AKTIVA UND PASSIVA (OHNE TFI)

Instrumente	Währung	Menge	Betrag	%NV
Chemie			1 713 865,41	1,05
GRUENENTHAL 4,125%21-150528	EUR	200	203 479,58	0,12
INEOS FIN 2 2,5%21-150126	EUR	500	500 783,61	0,31
THE CHEMOURS 4%18-150526	EUR	1 000	1 009 602,22	0,62
Einzelhandel			7 352 527,46	4,49
CECGR 6 1/4 07/15/29	EUR	1 000	1 012 957,56	0,62
ELIOR 3,75%21-150726	EUR	700	699 405,58	0,43
ELO 6%23-220329	EUR	20	1 923 000,82	1,17
FNAC DARTY 6%24-010429	EUR	1 100	1 149 307,32	0,70
VERISURE 3,25% 15 02 2027	EUR	1 000	986 853,06	0,60
VERISURE HOLD 7,125%23-010228	EUR	1 500	1 581 003,12	0,97
Erdölgesellschaften			1 317 349,11	0,80
BP CAPITAL MARKETS TV20-PERP.	EUR	500	499 681,10	0,30
NC5	EUR	400	402 461,08	0,25
REPSOL INTL FIN TV20-PERP.	EUR	400	415 206,93	0,25
Bau / Grundstoffe			1 568 227,60	0,96
IPGIM 5 3/8 06/20/29	EUR	1 500	1 568 227,60	0,96
			3 613 059,19	2,21
BERFRA 6 1/2 07/18/30	EUR	700	739 753,39	0,45
OPTICS 3 5/8 05/25/26	EUR	1 000	1 007 396,30	0,62
OPTICS 6 7/8 02/15/28	EUR	469	515 223,42	0,31
OPTICS 7 7/8 07/31/28	EUR	1 181	1 350 686,08	0,83
Ausschüttung			980 581,81	0,60
SAPPI PAP HOLD 3,625%21-150328	EUR	1 000	980 581,81	0,60
Strom			9 514 969,43	5,81
EDF TV13-PERPETUEL EMTN	EUR	25	2 599 884,77	1,59
EDF TV20-PERP.	EUR	2	365 368,77	0,22
EDF TV22-PERP.	EUR	5	1 160 050,33	0,71
EDP-ENERGIAS TV23-230483	EUR	15	1 622 545,73	0,99
ORSTED TV22-PERP.	EUR	1 000	1 070 899,34	0,65
TENN 4 5/8 PERP	EUR	1 000	1 025 801,37	0,63
TENNET TV20-PERP.	EUR	700	704 754,91	0,43
TERNA TVPERP	EUR	1 000	965 664,21	0,59
Elektronik / Elektrische Geräte			3 642 281,16	2,22
ALOPF 5.868 PERP	EUR	15	1 557 849,12	0,95
BELDEN 3,375 0727	EUR	1 000	997 958,75	0,61
NEXANS 050428	EUR	10	1 086 473,29	0,66
Haushaltsgeräte / -produkte			792 320,44	0,48
ARCELIK 3%21-270526	EUR	800	792 320,44	0,48
Gesundheitseinrichtungen und -dienste			2 805 614,29	1,71
AVANTOR FDG 2,625%20-011125	EUR	800	802 000,33	0,49
CAB 3,375%21-010228	EUR	1 000	932 078,75	0,57
EUROFINS SCIENTIFIC TV23-PERP.	EUR	1 000	1 071 535,21	0,65
Ausrüstg. Dienstleistg./Vertr. Erdölprod.			2 370 922,74	1,45
SPMIM 4 7/8 05/30/30	EUR	1 500	1 559 782,81	0,95

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

AUFSTELLUNG DER ZULÄSSIGEN AKTIVA UND PASSIVA (OHNE TFI)

Instrumente	Währung	Menge	Betrag	%NV
SRGIM 4 1/2 PERP	EUR	8	811 139,93	0,50
Allgemeine Finanzen			5 784 770,35	3,53
AVIS BUDGET 7% 280229	EUR	1 000	1 006 792,22	0,61
BANIJAY GROUP 6,5% 01032026	EUR	500	504 553,61	0,31
CROWN EURO.HOLDINGS 5%23-0528	EUR	1 500	1 594 841,67	0,97
EC FINANCE 3%15102026	EUR	1 000	986 826,67	0,60
PAPREC HOLDING 6,5%23-171127	EUR	600	650 367,00	0,40
PHARGR 4 7/8 07/10/29	EUR	10	1 041 389,18	0,64
Gas, Wasser und sonstige Versorgungsdienste			3 791 367,74	2,31
HLD INF MET ENV 4,5%06042027	EUR	700	723 819,95	0,44
NATURGY FIN 2,374%21-PERP.	EUR	10	980 421,83	0,60
2,25%20-PERP.	EUR	10	985 711,23	0,60
TV23-PERP.	EUR	10	1 101 414,73	0,67
Forstwirtschaft und Papier			1 006 854,95	0,61
PROGROUP 5,125%24-120429	EUR	1 000	1 006 854,95	0,61
Pharmazeutische u. Biotechnologie-Industrie			6 922 523,81	4,23
ALMIRALL 2,125%21-300926	EUR	800	782 466,78	0,48
CHEPLAPHARM ARZ 4,375%20-0128	EUR	1 000	991 567,64	0,60
7,5%22-210826	EUR	1 500	1 600 345,00	0,98
ORGANON FIN.2,875%21-300428	EUR	1 500	1 459 228,33	0,89
TEVA PHARMAC 1,875%15-310327	EUR	1 000	960 303,42	0,59
TEVA PHARMAC 7,375%23-150929	EUR	1 000	1 128 612,64	0,69
Allgemeine Industrie			2 189 941,89	1,34
ABERTIS 3,248% PERP	EUR	15	1 511 823,36	0,92
BALL 1,5%150327	EUR	700	678 118,53	0,42
Andere Anlageinstrumente als Aktien			4 721 679,35	2,88
CIRSA FIN INTL 4,5%21-150327	EUR	1 000	997 435,00	0,61
CIRSA FIN INTL 6,5%24-150329	EUR	700	754 328,94	0,46
DUFY ONE 2%19-150227	EUR	2 000	1 934 922,22	1,18
Q-PARK HLDG I 5,125%24-010329	EUR	1 000	1 034 993,19	0,63
Anlageinstrum. in Aktien			667 357,06	0,41
NOMAD FOODS 2,5%21-240628	EUR	700	667 357,06	0,41
Inv. Immobilien und Dienstl.			3 728 228,92	2,28
ILIAD 5,125%21-151026	EUR	1 000	1 036 484,31	0,63
ILIAD HOLDING 5,625% 151028	EUR	1 000	1 044 023,75	0,64
KAPLA HLD 3,375%19-151226	EUR	600	602 094,75	0,37
TECHEM VER 675 5,375%24-150729	EUR	1 000	1 045 626,11	0,64
EDV-Geräte und -Ausrüstung			3 698 934,69	2,26
E.KABEL HESSEN 14,5%00-10	EUR	100	10,00	0,00
EUTELSAT 1,5%20-131028	EUR	7	567 538,43	0,35
EUTELSAT SA 9.75% 13/04/2029	EUR	500	539 885,82	0,33
INFINEON TECHNOLOG TV19-PERP.	EUR	5	501 321,99	0,31
INFINEON TECHNOLOG TV19-PERP.	EUR	5	504 676,58	0,31
TELEFON ERICSSON 5,375%23-0528	EUR	1 000	1 085 574,79	0,66
VERISURE MID 5,25%21-150229	EUR	500	499 927,08	0,30

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

AUFSTELLUNG DER ZULÄSSIGEN AKTIVA UND PASSIVA (OHNE TFI)

Instrumente	Währung	Menge	Betrag	%NV
Medien			2 685 447,30	1,64
BANIJAY ENTERT 7%23-010529	EUR	1 000	1 083 331,11	0,66
BERTELSMANN TV15-230475 JR SUB	EUR	6	599 768,55	0,37
VERTICAL MIDCO 4,375%20-150727	EUR	1 000	1 002 347,64	0,61
Industriemetalle			3 340 626,89	2,04
ERAMET 7%23-220528	EUR	12	1 259 060,22	0,77
OI 5 1/4 06/01/29	EUR	2 000	2 081 566,67	1,27
Produkte für den Hausgebrauch			5 260 859,13	3,21
COTY 5,75%23-150928	EUR	1 500	1 570 387,92	0,96
LEVI STRAUSS 3,375%17-150327	EUR	1 000	998 123,75	0,61
MARCOLIN 6,125%21-151126	EUR	700	720 036,21	0,44
ONTEX GROUP 3,5%21-150726	EUR	1 000	1 000 606,11	0,61
WEPA HYGIENE 2,875%19-151227	EUR	1 000	971 705,14	0,59
Unterstützungsdienste für Unternehmen			4 523 837,48	2,76
ELIS 4,125%22-240527	EUR	5	518 267,40	0,32
IQVIA 1,75%21-150326	EUR	1 000	980 116,39	0,60
IQVIA 2,25%21-150329	EUR	1 000	939 022,50	0,57
LOXAM 6,375%23-150528	EUR	1 500	1 597 440,63	0,97
NEXI 1,625%21-300426	EUR	500	488 990,56	0,30
IMMOBILIENINVESTMENTGES.			1 162 011,91	0,71
URW TV23-PERP.	EUR	10	1 162 011,91	0,71
Festnetztelefonie			15 622 796,76	9,54
EIRCOM 5 3/4 12/15/29	EUR	1 500	1 572 140,42	0,96
ILIAD 5,375%23-150229	EUR	20	2 179 834,92	1,33
INWIT 1,875%20-080726	EUR	800	785 150,25	0,48
LORCAT 5 3/4 04/30/29	EUR	2 000	2 097 450,56	1,28
LORCA TELE BNDC 4%20-180927	EUR	1 000	996 878,89	0,61
SOFTBANK GROUP 2,875%21-060127	EUR	1 200	1 179 549,67	0,72
TELECOM ITALIA 6,875%23-150228	EUR	331	361 997,29	0,22
TELECOM ITALIA 7,875%23-310728	EUR	2 250	2 572 267,50	1,57
TELEFO 2.376 PERP	EUR	25	2 304 246,78	1,41
VIRGIN MEDIA 3,75%20-150730	EUR	700	636 531,58	0,39
VODAFONE GROUP TV20-270880	EUR	1 000	936 748,90	0,57
Mobiltelefonie			1 594 240,52	0,97
TDCDC 5.186 08/02/29	EUR	1 500	1 594 240,52	0,97
Industrieller Transport			5 083 404,47	3,10
CMACG 5 1/2 07/15/29	EUR	1 000	1 040 049,15	0,63
GETLINK 3,5%20-301025	EUR	1 000	1 008 354,44	0,62
LA POSTE TV18-PERP.	EUR	10	1 007 089,48	0,61
MUNDYS 1,875%21-120228	EUR	1 000	958 196,48	0,59
MUNDYS SA 4,75%29	EUR	1 000	1 069 714,92	0,65
Reise und Freizeit			9 458 127,33	5,77
ACCOR TV23-PERP.	EUR	12	1 372 309,97	0,84
AFFP 4 5/8 05/23/29	EUR	10	1 033 726,03	0,63
AIR FRANCE-KLM 8,125%23-310528	EUR	5	579 781,37	0,35

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

AUFSTELLUNG DER ZULÄSSIGEN AKTIVA UND PASSIVA (OHNE TFI)

Instrumente	Währung	Menge	Betrag	%NV
CCL 5 3/4 01/15/30	EUR	700	767 967,63	0,47
DT LUFTHANSA 3%20-290526	EUR	10	1 006 656,16	0,61
INTER GAME TECH 3,5%19-150626	EUR	400	403 457,11	0,25
C. AIR GP 3,75%21-250329	EUR	3	309 324,99	0,19
LOTTOMATICA 7,125%23-010628	EUR	1 000	1 079 477,92	0,66
NH HOTEL GROUP 4% 020726	EUR	800	810 912,00	0,49
PLAYTECH PLC 5,875%280628	EUR	1 000	1 049 259,84	0,64
TUIGR 5 7/8 03/15/29	EUR	1 000	1 045 254,31	0,64
Anteile von OGA und Investmentfonds			7 243 976,28	4,42
OGAW und vergleichbare Titel aus anderen EU-Mitgliedstaaten			7 243 976,28	4,42
UNION PLUS	EUR	36,034	7 243 976,28	4,42
Summe			161 853 972,05	98,82

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

AUFSTELLUNG DER DEISEN-TERMINGESCHÄFTE

Bezeichnung d. Instruments	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)			
	Aktiva	Passiva	Fremdwährungs- forderungen (+)		Zu liefernde Währungen (-)	
			Währung	Betrag (*)	Währung	Betrag (*)
Summe	0,00	0,00		0,00		0,00

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – AKTIEN

Termin-Finanzinstrumente – Aktien				
Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	
Futures				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Optionen				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Sonstige Instrumente				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Summe		0,00	0,00	0,00

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – ZINSSÄTZE

Termin-Finanzinstrumente – Zinssätze				
Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	
Futures				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Optionen				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Sonstige Instrumente				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Summe		0,00	0,00	0,00

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – DEISEN

Termin-Finanzinstrumente – Devisen				
Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
Futures				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Optionen				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Sonstige Instrumente				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Summe		0,00	0,00	0,00

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

TERMINFINANZINSTRUMENTE – KREDITRISIKO

Terminfinanzinstrumente – Kreditrisiko				
Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	
Futures				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Optionen				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Sonstige Instrumente				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Summe		0,00	0,00	0,00

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – SONSTIGE ENGAGEMENTS

Termin-Finanzinstrumente – Sonstige Engagements				
Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
Futures				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Optionen				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Sonstige Instrumente				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Summe		0,00	0,00	0,00

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

AUFSTELLUNG DER DEISEN-TERMINGESCHÄFTE (ZUR ABSICHERUNG EINER ANTEILSKLASSE VERWENDET)

Bezeichnung d. Instruments	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)				Abgesicherte Anteilsklasse
	Aktiva	Passiva	Fremdwährungs-forderungen (+)		Zu liefernde Währungen (-)		
			Währung	Betrag (*)	Währung	Betrag (*)	
Summe	0,00	0,00		0,00		0,00	

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – DEVISEN (ZUR ABSICHERUNG EINER ANTEILSKLASSE VERWENDET)

Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)	Abgesicherte Anteilsklasse
		Aktiva	Passiva	+/-	
Futures					
Untersumme		0,00	0,00	0,00	
Optionen					
Untersumme		0,00	0,00	0,00	
Swaps					
Untersumme		0,00	0,00	0,00	
Sonstige Instrumente					
Untersumme		0,00	0,00	0,00	
Summe		0,00	0,00	0,00	

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

ZUSAMMENFASSENDE AUFSTELLUNG

	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert
Summe Aufstellung der zulässigen Aktiva und Passiva (ohne TFI)	161 853 972,05
Aufstellung der TFI (ohne TFI, die zur Absicherung ausgegebener Anteile verwendet werden):	
Summe Devisen-Termingeschäfte	0,00
Summe Termin-Finanzinstrumente – Aktien	0,00
Summe Termin-Finanzinstrumente – Zinssätze	0,00
Summe Termin-Finanzinstrumente – Devisen	0,00
Summe Termin-Finanzinstrumente – Anleihen	0,00
Summe Termin-Finanzinstrumente – Sonstige Engagements	0,00
Aufstellung der Termin-Finanzinstrumente, die zur Absicherung ausgegebener Anteile verwendet werden	0,00
Sonstige Aktiva (+)	1 999 210,10
Sonstige Passiva (-)	-63 742,79
Summe = Nettovermögen	163 789 439,36