

CM-AM OBLI MOYEN TERME

Document d'information périodique au 30/06/2026

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	17
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS	18
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS	19
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE	20
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT	21
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS	22
INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	23
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	24
SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE	25

CM-AM OBLI MOYEN TERME

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	1 208 349 450,77
b) Avoirs bancaires	20 473 541,65
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	102 847 090,24
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	1 331 670 082,66
e) Passif	-2 489 239,26
f) Valeur nette d'inventaire	1 329 180 843,40

* Les montants sont signés

CM-AM OBLI MOYEN TERME

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
FR0014012C20	PART CAPI F	Capitalisable	EUR	2 356 942,17	23 365,921	100,87
FR0012008746	PART CAPI IC	Capitalisable	EUR	277 176 820,18	257,283	1 077 322,71
FR0010291591	PART CAPI RC	Capitalisable	EUR	1 033 353 587,58	2 955 171,147	349,67
FR0013295409	PART CAPI S	Capitalisable	EUR	16 293 493,47	46 199,980	352,67

CM-AM OBLI MOYEN TERME

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	90,91	90,74
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	7,52	7,51

CM-AM OBLI MOYEN TERME

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	625 255 334,92	654 851 990,07
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	251 264 909,76	259 998 248,25

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	876 520 244,68
Cessions	914 850 238,32

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Pas de distribution sur la période.

CM-AM OBLI MOYEN TERME

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

Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
		Actif net	Total des actifs
Euro	1 208 349 450,77	90,91	90,74
Total	1 208 349 450,77	90,91	90,74

CM-AM OBLI MOYEN TERME

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

Secteur économique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Souverains	54,47	54,37
Banques	13,57	13,55
Supranational	3,29	3,28
Automobiles et équipementiers	2,43	2,43
Services bancaires invest et de courtage	1,91	1,90
Entités garanties par Etat	1,90	1,89
Voyages et Loisirs	1,63	1,63
Logiciels et services informatiques	1,45	1,45
Fournisseurs de services de télécommunications	1,18	1,18
Electricité	0,98	0,98
Transport industriel	0,77	0,77
Distributeurs	0,75	0,74
Services appui à industrie	0,69	0,69
Sociétés de placement immobilier	0,63	0,63
Energie non renouvelable	0,62	0,62
Agro-alimentaire	0,53	0,53
Soins personnels pharmacies et épiceries	0,53	0,53
Médias	0,46	0,46
Electricité	0,45	0,45
Services financiers et de crédit	0,45	0,45
Instruments de placement hors actions	0,44	0,44
Investissement immobilier et services	0,35	0,34
Pharmacie/biotechnologie/Producteurs de Marijuana	0,31	0,31
Assurance vie	0,28	0,28
Chimie	0,23	0,23
Equipements de loisirs	0,23	0,23
Industries généralistes	0,23	0,23
Services aux consommateurs	0,15	0,15
Total	90,91	90,74

CM-AM OBLI MOYEN TERME

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

Pays	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Allemagne	22,64	22,60
France	18,93	18,90
Italie	14,34	14,31
Espagne	7,28	7,27
États-Unis	6,84	6,83
Pays-Bas	6,49	6,48
Finlande	2,54	2,54
Royaume-Uni	2,24	2,23
Luxembourg	2,17	2,16
Japon	1,64	1,63
Suisse	1,36	1,35
Canada	1,29	1,29
Belgique	1,26	1,26
Autriche	1,08	1,08
Portugal	0,33	0,33
Suède	0,29	0,29
Irlande	0,19	0,19
Total	90,91	90,74

CM-AM OBLI MOYEN TERME

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

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Parts d'OPC	7,52	7,51
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	7,52	7,51
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	7,52	7,51

CM-AM OBLI MOYEN TERME

COMMISSION DE PERFORMANCE

PART CAPI F	30/06/2026
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance*	0,00

PART CAPI IC	30/06/2026
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance*	0,00

PART CAPI RC	30/06/2026
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance*	0,00

PART CAPI S	30/06/2026
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance*	0,00

*Par rapport à l'actif net moyen

CM-AM OBLI MOYEN TERME

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Obligations			1 208 349 450,77	90,91
Obligations convertibles en actions négociées sur un marché réglementé			4 021 632,33	0,30
Electricité			4 021 632,33	0,30
EDF 4 3/8 PERP	EUR	40	4 021 632,33	0,30
Autres obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			1 204 327 818,44	90,61
Agro-alimentaire			7 017 779,86	0,53
GIS 3.6 04/17/32	EUR	3 000	3 024 737,67	0,23
GIS 4 3/4 07/16/56	EUR	4 000	3 993 042,19	0,30
Assurance vie			3 766 059,25	0,28
POSIM 3 12/03/30	EUR	3 750	3 766 059,25	0,28
Automobiles et équipementiers			32 359 570,68	2,43
ALV 3 10/29/30	EUR	3 000	3 003 957,53	0,22
BMW 3 5/8 05/19/32	EUR	5 000	5 041 549,32	0,38
HNDA 3.95 03/19/32	EUR	4 000	4 068 612,05	0,31
PORSCHE A HLDG 4,125%24-270932	EUR	6 000	6 216 406,85	0,47
RENAUL 3 7/8 09/30/30	EUR	50	5 143 676,03	0,39
STLA 6 1/4 PERP	EUR	4 000	3 934 118,90	0,29
TOYOTA 3 1/8 04/20/32	EUR	5 000	4 951 250,00	0,37
Banques			180 400 365,02	13,57
ACAFP 4 3/8 04/15/36	EUR	48	4 944 380,71	0,37
AIB 3 3/4 12/02/36	EUR	2 500	2 530 452,05	0,19
BAC 2.984 10/30/31	EUR	5 000	5 024 397,95	0,38
BACR 4.973 05/31/36	EUR	5 000	5 234 499,45	0,39
BBVASM 4 3/8 08/29/36	EUR	20	2 120 915,89	0,16
BFCM 3 1/2 07/21/33	EUR	100	10 044 042,47	0,76
BFCM 4 01/15/35	EUR	50	5 122 104,79	0,39
BMO 3 1/4 01/09/32	EUR	5 000	5 050 165,75	0,38
BNP 3.494 09/17/33	EUR	60	6 097 554,58	0,46
BNP 3.583 01/15/31	EUR	65	6 648 535,51	0,50
BNP 4.414 05/27/41	EUR	35	3 570 887,37	0,27
BPCEGP 4 01/16/37	EUR	30	3 046 624,11	0,23
BPCEGP 4 1/8 03/08/33	EUR	50	5 161 397,95	0,39
C 2.928 10/22/30	EUR	5 000	5 049 677,26	0,38
CAIXABANK TV24-090232	EUR	40	4 188 963,84	0,31
CCBGBB 3 7/8 04/14/32	EUR	70	7 168 048,90	0,54
CCDJ 3 1/4 03/28/31	EUR	8 000	8 010 223,56	0,60
CDEP 3 7/8 07/12/31	EUR	56	5 966 398,79	0,45
CM 3 1/4 07/16/31	EUR	5 000	5 128 617,12	0,39
CMARK 4.251 06/09/37	EUR	40	4 050 274,85	0,30
CMZB 3 5/8 01/14/32	EUR	50	5 115 571,23	0,38
DB 3 3/8 02/13/31	EUR	70	7 069 599,18	0,53
DEKABANK 3,25%24-080229	EUR	45	4 596 983,63	0,35
FRLBP 4 06/03/34	EUR	80	8 055 424,66	0,61
HSBC 3.445 09/25/30	EUR	5 000	5 155 736,99	0,39

CM-AM OBLI MOYEN TERME

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
HSBC 3.608 12/01/33	EUR	5 000	5 086 074,52	0,38
INTNED 3 1/2 09/03/30	EUR	50	5 179 644,52	0,39
ISPIM 3 3/4 06/22/34	EUR	6 000	6 021 044,38	0,45
MIZUHO 3.295 05/13/33	EUR	5 000	4 964 518,49	0,37
MUFG 3.197 06/10/31	EUR	4 000	3 987 027,84	0,30
RENAUL 4 08/19/31	EUR	29	2 923 300,51	0,22
RY 3 3/4 08/03/34	EUR	4 000	4 042 561,10	0,30
SANTAN 4 1/4 04/22/38	EUR	40	4 087 028,49	0,31
USB 4.009 05/21/32	EUR	5 000	5 148 765,48	0,39
VW 7 7/8 PERP	EUR	40	4 808 921,10	0,36
Chimie			3 064 932,00	0,23
ROQFRE 3.774 11/25/31	EUR	30	3 064 932,00	0,23
Distributeurs			9 915 835,94	0,75
AMZN 3.35 03/16/32	EUR	9 000	9 096 770,96	0,69
VERISR 4 1/8 01/02/32	EUR	813	819 064,98	0,06
Electricité			5 966 210,14	0,45
ENEXIS 3 02/25/32	EUR	6 000	5 966 210,14	0,45
ENELIM 3 1/2 05/26/30	EUR	4 000	4 053 431,78	0,30
ENELIM 4 1/8 PERP	EUR	3 000	3 024 867,95	0,23
NEE 3.996 05/15/56	EUR	2 000	1 984 570,03	0,15
Energie non renouvelable			8 291 040,00	0,62
SAGESS 3,5%23-251129	EUR	80	8 291 040,00	0,62
Entités garanties par Etat			25 224 839,04	1,90
KFW 2 3/8 10/04/29	EUR	25 000	25 224 839,04	1,90
Equipements de loisirs			3 009 184,93	0,23
PHIANA 3 1/4 05/23/30	EUR	3 000	3 009 184,93	0,23
Fournisseurs de services de télécommunications			15 715 979,93	1,18
NTT 3.224 03/04/32	EUR	7 680	7 660 181,39	0,58
TELEFO 4.381 PERP	EUR	30	3 041 683,48	0,23
TMUS 3.2 02/19/32	EUR	3 000	2 998 740,82	0,22
VZ 4.2462 08/15/56	EUR	2 000	2 015 374,24	0,15
Industries généralistes			3 043 264,52	0,23
BDX 3.855 05/20/33	EUR	3 000	3 043 264,52	0,23
Instruments de placement hors actions			5 885 496,16	0,44
MORGAN STANLEY TV22-070532	EUR	6 000	5 885 496,16	0,44
Investissement immobilier et services			4 582 254,08	0,35
GFCFP 3 1/4 06/03/31	EUR	46	4 582 254,08	0,35
Logiciels et services informatiques			19 264 323,21	1,45
CAPFP 3 1/8 09/25/31	EUR	50	5 012 613,01	0,38
DSYFP 3 3/8 06/16/31	EUR	42	4 223 601,70	0,32
EQIX 3 1/4 03/15/31	EUR	6 000	5 989 712,88	0,45
GOOGL 3.2 05/11/30	EUR	4 000	4 038 395,62	0,30
Médias			6 145 111,39	0,46
INFLN 3 1/4 10/23/30	EUR	5 000	5 080 741,78	0,38
RELLN 3 1/4 05/22/29	EUR	1 057	1 064 369,61	0,08

CM-AM OBLI MOYEN TERME

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Pharmacie/biotechnologie/Producteurs de Marijuana			4 073 681,10	0,31
IPNFP 3 7/8 03/25/32	EUR	40	4 073 681,10	0,31
Services appui à industrie			9 120 893,83	0,69
EDENFP 3 3/4 01/15/33	EUR	60	6 115 381,64	0,46
SPIEFP 3 7/8 05/18/31	EUR	30	3 005 512,19	0,23
Services aux consommateurs			2 033 442,74	0,15
AMCR 3.2 11/17/29	EUR	2 000	2 033 442,74	0,15
Services bancaires invest et de courtage			25 340 827,01	1,91
GS 3.5094 08/17/33	EUR	5 000	5 033 949,86	0,38
MBGGR 3.6 05/13/32	EUR	2 925	2 950 744,41	0,22
NOMURA 4.217 04/08/33	EUR	5 000	5 149 702,06	0,39
RBOSGR 3 1/4 05/28/31	EUR	40	3 983 785,75	0,30
SOCGEN 3 3/4 09/02/33	EUR	50	5 136 509,59	0,39
SOCGEN 3 5/8 11/13/30	EUR	30	3 086 135,34	0,23
Services financiers et de crédit			6 036 686,14	0,45
AXP 3.433 05/20/32	EUR	6 000	6 036 686,14	0,45
Sociétés de placement immobilier			8 344 667,94	0,63
URWFP 3 1/2 09/11/29	EUR	40	4 142 687,12	0,31
URWFP 4 7/8 PERP	EUR	40	4 201 980,82	0,32
Soins personnels pharmacies et épiceries			7 067 433,70	0,53
CAFP 2 7/8 05/07/29	EUR	40	3 987 203,84	0,30
CAFP 3 5/8 10/17/32	EUR	30	3 080 229,86	0,23
Souverains			724 009 807,38	54,47
0.5PCT DSL 2022 PER 15-07-2032	EUR	15 000 000	13 226 878,77	1,00
ALLEMAGNE 0%21-150831	EUR	6 700 000 000	58 771 730,00	4,42
AUSTRIA 0%20-200230	EUR	8 000	7 272 320,00	0,55
AUSTRIA 0%21-200231	EUR	8 000	7 062 880,00	0,53
BELGIUM 1%15-220631	EUR	500 000 000	4 573 719,86	0,34
BGB 2.6 10/22/30	EUR	500 000 000	5 047 409,59	0,38
BTPS 2.7 10/01/30	EUR	60 000	59 853 414,00	4,50
BTPS 3.35 07/01/29	EUR	30 000	30 478 530,00	2,29
BTPS 3 1/4 03/05/30	EUR	15 000	15 452 617,50	1,16
BTPS 3 10/01/29	EUR	30 000	30 390 030,00	2,29
BTPS 4 10/30/31	EUR	30 000	31 636 356,00	2,38
DBR 1.7 08/15/32	EUR	4 000 000 000	38 496 427,40	2,90
DBR 2.1 11/15/29	EUR	8 500 000 000	84 925 654,11	6,39
DBR 2.4 11/15/30	EUR	7 000 000 000	70 544 427,39	5,31
FRTR 1 1/2 05/25/31	EUR	40 000 000	37 431 665,76	2,82
NETHER 0 07/15/30	EUR	15 000 000	13 514 850,00	1,02
NETHER 0 07/15/31	EUR	15 000 000	13 133 400,00	0,99
OAT 0%22-250532	EUR	32 000 000	26 721 280,00	2,01
OAT 2,50%14-25052030	EUR	45 000 000	44 552 373,30	3,35
PAYS-BAS 0,25%19-150729 DSL	EUR	10 000 000	9 356 709,59	0,70
PGB 0.3 10/17/31	EUR	500 000 000	4 412 052,74	0,33
RFGB 0 3/4 04/15/31	EUR	15 000	13 685 441,10	1,03

CM-AM OBLI MOYEN TERME

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
RFGB 2 1/2 04/15/30	EUR	10 000	9 984 324,66	0,75
RFGB 2 7/8 04/15/29	EUR	10 000	10 131 138,36	0,76
SPAIN 0,5%20-300430	EUR	40 000	36 884 120,55	2,78
SPGB 0.8 07/30/29	EUR	10 000	9 529 363,01	0,72
SPGB 3.1 07/30/31	EUR	16 000	16 672 830,68	1,25
SPGB 3 01/31/33	EUR	20 000	20 267 863,01	1,52
Supranational			43 738 779,45	3,29
EU 3 1/8 12/04/30	EUR	15 000 000	15 490 191,78	1,16
EUR FIN STAB 2,625%24-160729	EUR	10 000	10 230 831,51	0,77
EUROFIMA BASEL 0,1%20-200530	EUR	20 000	18 017 756,16	1,36
Transport industriel			10 193 299,31	0,77
DSVDC 3 1/4 11/06/30	EUR	5 000	5 108 758,90	0,39
LA POSTE 2,625%22-140928	EUR	50	5 084 540,41	0,38
Voyages et Loisirs			21 653 183,93	1,63
BKNG 3 1/2 05/11/30	EUR	2 500	2 530 340,75	0,19
BKNG 3 1/8 05/09/31	EUR	2 000	1 991 646,58	0,15
FDJFP 3 11/21/30	EUR	70	7 018 331,37	0,53
IAGLN 3.352 09/11/30	EUR	2 000	2 041 659,34	0,15
IHGLN 3 3/8 09/10/30	EUR	3 000	3 066 442,19	0,23
MCD 3 1/2 05/15/33	EUR	5 000	5 004 763,70	0,38
Parts d'OPC et fonds d'investissements			100 016 924,18	7,52
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne			100 016 924,18	7,52
CM-AM HIGH YIELD 2028-IC	EUR	5 000	5 319 500,00	0,40
CM-AM INFLATION-IC	EUR	140	15 092 527,80	1,13
CM AM OBLI CRSOVR 2029-IC	EUR	90	9 944 136,00	0,75
CM-AM OBLIE FLEXIBLE-IC	EUR	60	6 487 304,56	0,49
CM-AM OBLI SOUVERAINS-C	EUR	2 850	12 748 306,50	0,96
LA FRANCIASE OBLIGAT EUROP-T	EUR	95 000	9 715 650,00	0,73
UNION PLUS	EUR	194	40 709 499,32	3,06
Total			1 308 366 374,95	98,43

CM-AM OBLI MOYEN TERME

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 (*)
Total	0,00	0,00		0,00		0,00

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

CM-AM OBLI MOYEN TERME

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 OBLI MOYEN TERME

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				
BOBL-EUX 0926	-600,00	0,00	416 000,00	-69 228 000,00
EURO-BUND FUTURE Sep26	-267,00	0,00	273 610,00	-33 999 780,00
SCHATZ-EUX 0926	1 320,00	363 000,00	0,00	139 867 200,00
Sous total		363 000,00	689 610,00	36 639 420,00
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		363 000,00	689 610,00	36 639 420,00

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

CM-AM OBLI MOYEN TERME

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 OBLI MOYEN TERME

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 OBLI MOYEN TERME

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 OBLI MOYEN TERME

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 OBLI MOYEN TERME

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 OBLI MOYEN TERME

SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	1 308 366 374,95
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	0,00
Total instruments financiers à terme - actions	0,00
Total instruments financiers à terme - taux	-326 610,00
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 (+)	22 940 707,71
Autres passifs (-)	-1 799 629,26
Total = actif net	1 329 180 843,40