CM-AM GREEN BONDS

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	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

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	43 809 693,77
b) Avoirs bancaires	954 563,78
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	3 860 971,33
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	48 625 228,88
e) Passif	-8 723,42
f) Valeur nette d'inventaire	48 616 505,46

* 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
FR0013246550	PART CAPI IC	Capitalisable	EUR	45 384 532,79	496,297	91 446,31
FR0013246543	PART CAPI RC	Capitalisable	EUR	2 685 389,01	29 682,549699	90,47
FR001400MRQ4	PART CAPI S	Capitalisable	EUR	546 583,66	5 350,790	102,15

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	90,11	90,10
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	7,92	7,92

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	1 732 828,13	3 735 000,00
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	2 500 361,92	0,00

Mouvements intervenus au cours de la période	**Mouvements (en montant)**
Acquisitions	4 233 190,05
Cessions	3 735 000,00

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Pas de distribution sur la période.

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

		Pourcentage	
Devise	**En montant (EUR)**	**Actif net**	**Total des actifs**
Euro	43 809 693,77	90,11	90,10
Total	**43 809 693,77**	**90,11**	**90,10**

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

	Pourcentage	
Secteur économique	**Actif net**	**Total des actifs**
Souverains	31,38	31,38
Banques	17,18	17,18
Entité non garantie par Etat	10,51	10,50
Supranational	6,72	6,72
Entités garanties par Etat	4,98	4,98
Societés de placement immobilier	3,63	3,63
Chimie	3,32	3,32
Collectivités Territoriales	2,57	2,57
Equipements et services médicaux	2,54	2,54
Gaz eau et services multiples aux collectivités	2,53	2,53
Transport industriel	2,04	2,04
Electricité	1,56	1,56
Matériel équipements destinés aux TI	1,15	1,15
Total	**90,11**	**90,10**

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

	Pourcentage	
Pays	**Actif net**	**Total des actifs**
France	32,67	32,66
Espagne	20,29	20,29
Pays-Bas	9,71	9,71
Belgique	7,54	7,54
Irlande	7,25	7,25
Luxembourg	6,72	6,72
Allemagne	5,54	5,54
Danemark	0,39	0,39
Total	**90,11**	**90,10**

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

	Pourcentage	
Nature d'actifs	**Actif net**	**Total des actifs**
Parts d'OPC	**7,92**	**7,92**
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	7,92	7,92
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	**7,92**	**7,92**

COMMISSION DE PERFORMANCE

PART CAPI IC	30/09/2026
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance*	0,00

PART CAPI RC	30/09/2026
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance*	0,00

PART CAPI S	30/09/2026
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance*	0,00

*Par rapport à l'actif net moyen

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Obligations			**43 809 693,77**	**90,11**
Autres obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			**43 809 693,77**	**90,11**
Banques			8 354 328,32	17,18
ABN AMRO 0,5%21-230929	EUR	12	1 085 163,95	2,23
BBVA 4,375%22-141029	EUR	15	1 589 192,47	3,27
BFCM 0,1%20-081027	EUR	4	387 349,42	0,80
BFCM 0,25%290628	EUR	10	942 800,68	1,94
BPCE TV22-140128 EMTN	EUR	5	498 022,67	1,02
CAIXABANK TV21-090229	EUR	13	1 250 585,93	2,57
NRWBK 0 1/2 09/13/27	EUR	1 500	1 462 350,41	3,01
SANTANDER 0,625%29	EUR	12	1 138 862,79	2,34
Chimie			1 616 567,63	3,32
AIR LIQUIDE FINANC 0,375%21-31	EUR	19	1 616 567,63	3,32
Collectivités Territoriales			1 248 940,63	2,57
SGP 1,125%18-221028	EUR	13	1 248 940,63	2,57
Electricité			757 074,70	1,56
ORSTED 1 1/2 11/26/29	EUR	200	188 531,95	0,39
TENNET 1,75%15-040627	EUR	570	568 542,75	1,17
Entité non garantie par Etat			5 107 444,26	10,51
ILE-DE-FR MOBIL 0,675%21-1136	EUR	20	1 340 119,73	2,76
RATP 0,875%17-250527	EUR	20	1 977 832,88	4,07
SNCF RESEAU 1,875%17-300334	EUR	5	416 437,40	0,86
SNCF RESEAU 1%16-091131	EUR	16	1 373 054,25	2,82
Entités garanties par Etat			2 420 611,89	4,98
ICO 3,05%23-311027	EUR	1 167	1 197 933,33	2,46
SFIL	EUR	15	1 222 678,56	2,52
Equipements et services médicaux			1 232 563,64	2,54
IBESM 1 3/8 03/11/32	EUR	14	1 232 563,64	2,54
Gaz eau et services multiples aux collectivités			1 232 409,66	2,53
EOANGR 0.6 10/01/32	EUR	1 500	1 232 409,66	2,53
Matériel équipements destinés aux TI			559 372,11	1,15
ASML 2 1/4 05/17/32	EUR	600	559 372,11	1,15
Societés de placement immobilier			1 763 983,48	3,63
ICADE 1,5%17-130927	EUR	18	1 763 983,48	3,63
Souverains			15 257 481,56	31,38
BELGIUM 1,25%18-220433	EUR	430 000 000	3 668 597,42	7,54
FRTR 0.1 07/25/38	EUR	2 000 000	1 831 415,86	3,77
IRISH 1.35 03/18/31	EUR	380 000 000	3 523 904,49	7,25
NETHERLANDS 0,5%19-150140	EUR	3 800 000	2 507 056,25	5,15
OAT 1,75%17-25062039	EUR	1 800 000	1 262 693,84	2,60
SPAIN 1%21-300742	EUR	4 000	2 463 813,70	5,07
Supranational			3 266 641,64	6,72
EU 0.4 02/04/37	EUR	4 700 000	3 266 641,64	6,72

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Transport industriel			992 274,25	2,04
ADIF 0,95%19-300427	EUR	10	992 274,25	2,04
Parts d'OPC et fonds d'investissements			**3 851 971,33**	**7,93**
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne			**3 851 971,33**	**7,93**
CM-AM CASH ISR-IC	EUR	6,82	3 851 971,33	7,93
Total			**47 661 665,10**	**98,04**

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.

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				
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 – 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)	47 661 665,10
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	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 (+)	963 563,78
Autres passifs (-)	-8 723,42
Total = actif net	**48 616 505,46**