

CM-AM GREEN BONDS

Document d'information périodique au 30/09/2025

CM-AM GREEN BONDS

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 GREEN BONDS

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	47 208 723,19
b) Avoirs bancaires	2 544 419,31
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	92 873,00
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	49 846 015,50
e) Passif	-24 898,27
f) Valeur nette d'inventaire	49 821 117,23

* Les montants sont signés

CM-AM GREEN BONDS

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)
FR0013246550	PART CAPI IC	Capitalisable	EUR	46 065 623,96	495,137	93 036,11
FR0013246543	PART CAPI RC	Capitalisable	EUR	2 826 739,82	30 674,225542	92,15
FR001400MRQ4	PART CAPI S	Capitalisable	EUR	928 753,45	8 931,294	103,98

CM-AM GREEN BONDS

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	94,76	94,71
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	0,00	0,00

CM-AM GREEN BONDS

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	3 492 113,00	6 400 000,00
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	0,00	0,00

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	3 492 113,00
Cessions	6 400 000,00

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Pas de distribution sur la période.

CM-AM GREEN BONDS

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

Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
		Actif net	Total des actifs
Euro	47 208 723,19	94,76	94,71
Total	47 208 723,19	94,76	94,71

CM-AM GREEN BONDS

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

Secteur économique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Souverains	32,40	32,38
Banques	16,85	16,84
Entité non garantie par Etat	9,87	9,87
Supranational	6,95	6,95
Gaz eau et services multiples aux collectivités	6,36	6,35
Entités garanties par Etat	4,94	4,94
Sociétés de placement immobilier	3,55	3,55
Chimie	2,62	2,62
Equipements et services médicaux	2,56	2,56
Collectivités Territoriales	2,54	2,53
Transport industriel	1,97	1,97
Electricité	1,52	1,52
Matériaux industriels	1,45	1,45
Matériel équipements destinés aux TI	1,18	1,18
Total	94,76	94,71

CM-AM GREEN BONDS

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

Pays	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
France	31,52	31,50
Espagne	20,35	20,34
Belgique	14,66	14,65
Pays-Bas	13,68	13,67
Irlande	7,25	7,25
Allemagne	5,47	5,47
Finlande	1,45	1,45
Danemark	0,38	0,38
Total	94,76	94,71

CM-AM GREEN BONDS

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

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Parts d'OPC	0,00	0,00
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	0,00	0,00
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	0,00	0,00

CM-AM GREEN BONDS

COMMISSION DE PERFORMANCE

PART CAPI IC	30/09/2025
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance*	0,00

PART CAPI RC	30/09/2025
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance*	0,00

PART CAPI S	30/09/2025
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance*	0,00

*Par rapport à l'actif net moyen

CM-AM GREEN BONDS

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instrument	Devise	Quantité	Montant	%AN
Obligations			47 208 723,19	94,76
Autres obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			47 208 723,19	94,76
Banques			8 394 333,32	16,85
ABN AMRO 0,5%21-230929	EUR	12	1 095 963,95	2,20
BBVA 4,375%22-141029	EUR	15	1 657 292,47	3,33
BFCM 0,1%20-081027	EUR	4	382 145,42	0,77
BFCM 0,25%290628	EUR	10	940 250,68	1,89
BPCE TV22-140128 EMTN	EUR	5	489 192,67	0,98
CAIXABANK TV21-090229	EUR	13	1 242 434,93	2,49
NRW.BANK 0,5%17-130927	EUR	1 500	1 450 710,41	2,91
SANTANDER 0,625%29	EUR	12	1 136 342,79	2,28
Chimie			1 305 322,60	2,62
AIR LIQUIDE FINANC 0,375%21-31	EUR	15	1 305 322,60	2,62
Collectivités Territoriales			1 262 993,63	2,54
SGP 1,125%18-221028	EUR	13	1 262 993,63	2,54
Electricité			758 331,50	1,52
ORSTED 1,5%17-261129	EUR	200	189 651,95	0,38
TENNET 1,75%15-040627	EUR	570	568 679,55	1,14
Entité non garantie par Etat			4 919 214,32	9,87
ILE-DE-FR MOBIL 0,675%21-1136	EUR	15	1 091 189,79	2,19
RATP 0,875%17-250527	EUR	20	1 960 772,88	3,93
SNCF RESEAU 1,875%17-300334	EUR	5	442 917,40	0,89
SNCF RESEAU 1%16-091131	EUR	16	1 424 334,25	2,86
Entités garanties par Etat			2 460 509,46	4,94
ICO 0%20-300426	EUR	1 035	1 022 714,55	2,05
ICO 3,05%23-311027	EUR	167	174 631,35	0,35
SFIL	EUR	15	1 263 163,56	2,54
Equipements et services médicaux			1 274 983,64	2,56
IBERDROLA FINANZAS 32	EUR	14	1 274 983,64	2,56
Gaz eau et services multiples aux collectivités			3 166 631,97	6,36
ALLIANDER 0,875%16-220426 MTN	EUR	19	1 893 212,31	3,80
E.ON SE 011032	EUR	1 500	1 273 419,66	2,56
Matériaux industriels			721 028,38	1,45
STORA ENSO 0,625%20-021230	EUR	800	721 028,38	1,45
Matériel équipements destinés aux TI			588 406,11	1,18
ASML HLDG 2,25%22-170532	EUR	600	588 406,11	1,18
Sociétés de placement immobilier			1 770 535,48	3,55
ICADE 1,5%17-130927	EUR	18	1 770 535,48	3,55
Souverains			16 140 562,89	32,40
BELGIUM 1,25%18-220433	EUR	430 000 000	3 841 672,42	7,71
IRELAND 1,35%18-180331	EUR	380 000 000	3 612 862,49	7,25
NETHERLANDS 0,5%19-150140	EUR	3 800 000	2 667 264,25	5,35
OAT 1,75%17-25062039	EUR	1 800 000	1 418 843,84	2,85
OATEI 0,10%22-250738 INDX	EUR	2 000 000	1 950 546,19	3,92

CM-AM GREEN BONDS

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
SPAIN 1%21-300742	EUR	4 000	2 649 373,70	5,32
Supranational			3 463 195,64	6,95
EUROPEAN UNION 0,4%21-040237	EUR	4 700 000	3 463 195,64	6,95
Transport industriel			982 674,25	1,97
ADIF 0,95%19-300427	EUR	10	982 674,25	1,97
Total			47 208 723,19	94,76

CM-AM GREEN BONDS

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 GREEN BONDS

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 GREEN BONDS

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				
BUND-EUX 1225	-27,00	0,00	15 390,00	-3 471 390,00
Sous total		0,00	15 390,00	-3 471 390,00
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	15 390,00	-3 471 390,00

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

CM-AM GREEN BONDS

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 GREEN BONDS

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 GREEN BONDS

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 GREEN BONDS

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 GREEN BONDS

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 GREEN BONDS

SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	47 208 723,19
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	-15 390,00
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 (+)	2 637 292,31
Autres passifs (-)	-9 508,27
Total = actif net	49 821 117,23