

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

Document d'information périodique au 30/09/2025

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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 CONVERTIBLES EUROPE

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	77 549 715,68
b) Avoirs bancaires	4 031 173,49
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	7 335 099,37
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	88 915 988,54
e) Passif	-395 735,39
f) Valeur nette d'inventaire	88 520 253,15

* Les montants sont signés

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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)
FR0013384617	PART CAPI IC	Capitalisable	EUR	23 639 464,95	2 031 192,702	11,63
FR0013384591	PART CAPI RC	Capitalisable	EUR	40 883 081,99	2 326 375,837982	17,57
FR0013481082	PART CAPI S	Capitalisable	EUR	10 663 450,41	286 885,220	37,16
FR0013481074	PART DIST RD	Distribuable	EUR	13 334 255,80	440 819,243571	30,24

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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	86,63	86,25
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	0,98	0,97
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	8,24	8,20

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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	65 810 509,29	86 093 811,06
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	2 811 623,22	4 025 651,01
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	4 549 350,74	7 627 093,69

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	73 171 483,25
Cessions	97 746 555,76

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

	Part	Montant net unitaire	Crédit d'impôt	Montant brut unitaire
Dividendes versés				
20/08/2025	PART DIST RD	0,40	0,01	0,41
Dividendes à verser				

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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

Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
		Actif net	Total des actifs
Euro	72 926 910,61	82,38	82,02
US DOLLAR	3 742 899,97	4,23	4,21
Franc suisse	503 780,37	0,57	0,57
Livre sterling	376 124,73	0,43	0,42
Total	77 549 715,68	87,61	87,22

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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

Secteur économique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Matériel équipements destinés aux TI	12,77	12,71
Aérospatial et défense	12,53	12,48
Services appui à industrie	9,69	9,65
Investissement immobilier et services	8,77	8,73
Équipements et services médicaux	7,23	7,19
Services bancaires invest et de courtage	6,61	6,58
Fournisseurs de services de télécommunications	5,94	5,92
Services aux consommateurs	5,17	5,14
Automobiles et équipementiers	4,58	4,56
Voyages et Loisirs	2,49	2,47
Boissons	1,97	1,97
Distributeurs	1,72	1,72
Energies renouvelables	1,53	1,52
Articles personnels	1,41	1,40
Bâtiment et matériaux de construction	1,17	1,17
Banques	1,07	1,07
Logiciels et services informatiques	0,96	0,96
Electricité	0,47	0,46
Assurance - Non vie	0,45	0,45
Energie non renouvelable	0,27	0,27
Industries généralistes	0,27	0,27
Ingénierie Industrielle	0,18	0,18
Transport industriel	0,15	0,14
Pharmacie/biotechnologie/Producteurs de Marijuana	0,12	0,12
Gaz eau et services multiples aux collectivités	0,09	0,09
Total	87,61	87,22

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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

Pays	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Allemagne	26,79	26,67
France	23,96	23,86
Pays-Bas	12,98	12,92
Italie	11,70	11,65
Espagne	10,09	10,04
États-Unis	0,91	0,91
Suisse	0,57	0,57
Royaume-Uni	0,43	0,42
Belgique	0,12	0,12
Irlande	0,06	0,06
Total	87,61	87,22

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Parts d'OPC	8,24	8,20
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	8,24	8,20
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	8,24	8,20

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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

PART DIST RD	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 CONVERTIBLES EUROPE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Actions et valeurs assimilées			9 454 567,65	10,68
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			9 454 567,65	10,68
Aérospatial et défense			2 046 845,31	2,31
AIRBUS	EUR	2 064	407 433,60	0,46
LEONARDO	EUR	7 834	423 192,68	0,48
RHEINMETALL ORD.	EUR	123	244 093,50	0,28
ROLLS ROYCE HOLDINGS	GBP	27 575	376 124,73	0,42
SAFRAN PROV.ECHANGE	EUR	856	256 885,60	0,29
THALES	EUR	1 272	339 115,20	0,38
Articles personnels			1 246 141,70	1,41
CIE FIN.RICHEMONT NOM.	CHF	2 584	419 003,12	0,47
HERMES INTERNATIONAL	EUR	186	387 438,00	0,44
LVMH MOET HENNESSY VUITTON	EUR	693	360 706,50	0,41
MONCLER	EUR	1 584	78 994,08	0,09
Assurance - Non vie			395 865,95	0,45
ALLIANZ	EUR	117	41 815,80	0,05
AXA	EUR	408	16 581,12	0,02
MUNCHENER RUCKVERSICHERUNGS	EUR	309	167 910,60	0,19
SWISS RE NOM.	CHF	539	84 777,25	0,09
UNIPOL GRUPPO	EUR	4 643	84 781,18	0,10
Automobiles et équipementiers			655 664,18	0,74
FERRARI NV	EUR	913	375 790,80	0,42
PIRELLI SPECIALI	EUR	48 304	279 873,38	0,32
Banques			949 836,74	1,07
BANCO BPM	EUR	4 000	50 900,00	0,06
BANCO SANTANDER	EUR	20 684	183 549,82	0,21
CAIXABANK	EUR	5 000	44 730,00	0,05
COMMERZBANK	EUR	2 952	94 729,68	0,10
ING GROEP	EUR	5 534	122 163,05	0,14
INTESA SANPAOLO	EUR	30 551	171 513,31	0,19
SOCIETE GENERALE	EUR	5 008	282 250,88	0,32
Distributeurs			80 608,75	0,09
AMAZON COM	USD	431	80 608,75	0,09
Energie non renouvelable			238 518,08	0,27
GAZTRANSPORT TECHNIGAZ	EUR	1 016	160 121,60	0,18
TECHNIP ENERGIES	EUR	1 956	78 396,48	0,09
Energies renouvelables			381 516,45	0,43
ABENGOA CL.B	EUR	487 051	3 165,83	0,00
NORDEX	EUR	7 637	166 486,60	0,19
SIEMENS ENERGY AG	EUR	2 131	211 864,02	0,24
Equipements et services médicaux			388 182,00	0,44
ESSILORLUXOTTICA	EUR	587	162 012,00	0,18
QIAGEN N.V.	EUR	6 000	226 170,00	0,26

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Fournisseurs de services de télécommunications			263 848,93	0,30
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	EUR	7 687	222 999,87	0,25
NETFLIX	USD	40	40 849,06	0,05
Gaz eau et services multiples aux collectivités			78 350,00	0,09
ITALGAS SPA	EUR	10 000	78 350,00	0,09
Industries généralistes			237 761,15	0,27
EATON CORPORATION PLC	USD	180	57 380,75	0,07
SIEMENS	EUR	787	180 380,40	0,20
Ingénierie Industrielle			162 560,00	0,18
EXAIL TECHNOLOGIES	EUR	1 600	162 560,00	0,18
Logiciels et services informatiques			852 289,00	0,96
ALPHABET CL.C	USD	1 152	238 986,03	0,27
INDRA SISTEMAS S.A	EUR	4 184	159 410,40	0,18
META PLATFORMS CLA	USD	127	79 443,15	0,09
MICROSOFT	USD	280	123 531,52	0,14
SAP	EUR	1 101	250 917,90	0,28
Matériel équipements destinés aux TI			1 052 284,72	1,19
APPLE	USD	100	21 689,10	0,03
ASM INTERNATIONAL	EUR	50	25 540,00	0,03
ASML HOLDING	EUR	709	587 122,90	0,66
BROADCOM INC	USD	428	120 273,83	0,14
NEXANS	EUR	915	115 290,00	0,13
NVIDIA CORP	USD	267	42 433,44	0,05
PRYSMIAN	EUR	989	83 254,02	0,09
QUALCOMM	USD	400	56 681,43	0,06
Pharmacie/biotechnologie/Producteurs de Marijuana			105 750,00	0,12
UCB	EUR	450	105 750,00	0,12
Services bancaires invest et de courtage			190 463,50	0,22
DEUTSCHE BOERSE	EUR	835	190 463,50	0,22
Transport industriel			128 081,19	0,14
IVECO GROUP	EUR	6 978	128 081,19	0,14
Obligations			68 095 148,03	76,93
Obligations convertibles en actions négociées sur un marché réglementé			67 790 253,20	76,58
Aérospatial et défense			9 047 372,67	10,22
MTU 0,05%19-180327 CONV.	EUR	40	4 562 924,93	5,15
RHMGR 2 1/4 02/07/30	EUR	7	4 484 447,74	5,07
Automobiles et équipementiers			3 091 230,00	3,49
PCIM 0 12/22/25	EUR	30	3 091 230,00	3,49
Bâtiment et matériaux de construction			1 039 765,98	1,17
DGFP 0.7 02/18/30	EUR	10	1 039 765,98	1,17
Boissons			1 746 988,97	1,97
DAV CAM MIL 2,375%24-170129 CV	EUR	18	1 746 988,97	1,97
Distributeurs			1 445 139,04	1,63
ZALANDO 0,625%20-0827 CONV.T.B	EUR	15	1 445 139,04	1,63

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Electricité			412 082,87	0,47
IBESM 1 1/2 03/27/30	EUR	4	412 082,87	0,47
Energies renouvelables			971 359,24	1,10
ABENGOA 2 1,5%19-261024	EUR	165 622	3,31	0,00
NORDEX 4,25%23-140430 CV	EUR	6	971 355,93	1,10
Equipements et services médicaux			6 008 591,35	6,79
IBESM 0.8 12/07/27	EUR	25	3 127 568,44	3,54
QGEN 2 09/04/32	USD	2	338 373,27	0,38
QGEN 2 1/2 09/10/31	USD	3	521 988,65	0,59
QIAGEN 17122027	USD	12	2 020 660,99	2,28
Fournisseurs de services de télécommunications			4 996 202,83	5,64
CELLNEX 0,75%20-201131 CV	EUR	28	2 544 592,82	2,87
CELLNEX TELECOM 2,125%23-30 CV	EUR	23	2 451 610,01	2,77
Investissement immobilier et services			7 766 179,66	8,77
ANNGR 0 05/20/30	EUR	8	790 776,00	0,89
ANNGR 0 7/8 05/20/32	EUR	4	400 119,97	0,45
LEGGR 1 09/04/30	EUR	25	2 449 958,70	2,77
LEG IMMOBILIEN AG 0,4% 300628	EUR	20	1 850 457,39	2,09
TAG IMMOBIL.0,625%20-0826 CV	EUR	20	1 960 622,83	2,21
TEGGR 0 5/8 03/11/31	EUR	3	314 244,77	0,36
Matériel équipements destinés aux TI			10 250 731,00	11,58
BE SEMICONDUCTOR INDUS 1,87%060429	EUR	5	661 610,04	0,75
LRFP 1 1/2 06/23/33	EUR	23	2 510 471,49	2,84
SOITEC 0%20-011025 CONV.REGS	EUR	3 000	522 879,00	0,59
SUFP 1.97 11/27/30	EUR	13	1 675 520,83	1,89
SUFP 1 1/4 09/23/33	EUR	6	606 840,46	0,68
SUFP 1 5/8 06/28/31	EUR	40	4 273 409,18	4,83
Services appui à industrie			8 579 718,16	9,69
ELISGP 2 1/4 09/22/29	EUR	6	943 125,86	1,07
NEXI 0%24022028	EUR	45	4 125 510,00	4,66
NEXI 1,75%20-240427 CV	EUR	18	1 764 932,56	1,99
SPIEFP 2 01/17/28	EUR	12	1 746 149,74	1,97
Services aux consommateurs			4 572 639,41	5,17
DEHEHO 1 01/23/27	EUR	10	962 669,35	1,09
DEHEHO 3 1/4 02/21/30	EUR	27	2 674 779,95	3,02
DELIVERY 1,50%20-150128 CONV.	EUR	10	935 190,11	1,06
Services bancaires invest et de courtage			5 662 466,02	6,40
ENXFP 1 1/2 05/30/32	EUR	18	1 792 251,20	2,03
MWDP 2 5/8 03/27/26	EUR	30	3 053 377,40	3,45
ORPAR 2%24-070231 EXCH	EUR	2	194 087,26	0,22
SIMONGLBDEV 3,5%23-141126 EXCH	EUR	5	622 750,16	0,70
Voyages et Loisirs			2 199 786,00	2,49
ACFP 0.7 12/07/27	EUR	30 000	1 612 110,00	1,82
LHAGR 0 09/10/32	EUR	6	587 676,00	0,67

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Autres obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			304 894,83	0,35
Automobiles et équipementiers			304 066,72	0,35
OPMFP 4.2955 02/05/31	EUR	3	304 066,72	0,35
Energies renouvelables			828,11	0,00
ABENGOA ABEN.2 1,5%19-24 INDEX	EUR	165 622	828,11	0,00
Parts d'OPC et fonds d'investissements			7 294 615,64	8,24
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne			7 294 615,64	8,24
CM-AM CONVICTS USA-ICEURACC	EUR	1,698	264 899,34	0,30
CM-AM DOLLAR CASH-C	USD	1 495,242	2 819 626,49	3,19
CM-AM HIGH YIELD SHORT DUR-S	EUR	17 133,956	2 286 526,43	2,58
CM-AM OBL CR 29 IC EUR C.	EUR	17,681	1 923 563,38	2,17
Total			84 844 331,32	95,85

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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 CONVERTIBLES EUROPE

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 CONVERTIBLES EUROPE

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.

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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 CONVERTIBLES EUROPE

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 CONVERTIBLES EUROPE

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 CONVERTIBLES EUROPE

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 CONVERTIBLES EUROPE

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 CONVERTIBLES EUROPE

SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	84 844 331,32
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 (+)	4 071 657,22
Autres passifs (-)	-395 735,39
Total = actif net	88 520 253,15