

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

Document d'information périodique au 30/09/2025

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

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	18
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS	19
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS	20
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE	21
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT	22
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS	23
INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	24
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	25
SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE	26

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

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	355 688 750,48
b) Avoirs bancaires	26 048 838,39
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	11 775 490,35
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	393 513 079,22
e) Passif	-21 876 835,05
f) Valeur nette d'inventaire	371 636 244,17

* Les montants sont signés

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

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)
FR0014003BE8	PART CAPI IC	Capitalisable	EUR	45 369 980,65	348,801	130 074,11
FR0011829134	PART CAPI RC	Capitalisable	EUR	188 783 311,78	1 425 451,966	132,43
FR0013295383	PART CAPI S	Capitalisable	EUR	131 087 469,23	982 377,506	133,43
FR0011859230	PART DIST RD	Distribuable	EUR	6 395 482,51	71 414,597	89,55

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

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	95,71	90,39
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	1,33	1,25

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

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	201 963 617,08	104 303 503,28
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	3 500 033,32	9 979 390,40

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	205 463 650,40
Cessions	114 282 893,68

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

	Part	Montant net unitaire	Crédit d'impôt	Montant brut unitaire
Dividendes versés				
08/08/2025	PART DIST RD	3,40	0,00	3,40
Dividendes à verser				

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

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

Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
		Actif net	Total des actifs
Euro	355 688 750,48	95,71	90,39
Total	355 688 750,48	95,71	90,39

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

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

Secteur économique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Fournisseurs de services de télécommunications	15,50	14,64
Automobiles et équipementiers	9,14	8,63
Services bancaires invest et de courtage	7,28	6,87
Electricité	5,42	5,12
Voyages et Loisirs	5,04	4,76
Investissement immobilier et services	4,97	4,70
Pharmacie/biotechnologie/Producteurs de Marijuana	4,31	4,07
Services appui à industrie	3,82	3,61
Distributeurs	3,64	3,44
Instruments de placement hors actions	3,23	3,05
Transport industriel	3,14	2,96
Sociétés de placement immobilier	2,96	2,79
Matériel équipements destinés aux TI	2,80	2,64
Services aux consommateurs	2,49	2,36
Médias	2,38	2,25
Gaz eau et services multiples aux collectivités	2,21	2,09
Soins personnels pharmacies et épiceries	1,98	1,87
Chimie	1,74	1,65
Banques	1,69	1,60
Equipements et services médicaux	1,43	1,35
Logiciels et services informatiques	1,43	1,35
Équipement électronique et électrique	1,37	1,29
Industries généralistes	1,30	1,23
Métaux industriels et extraction	0,98	0,92
Prestataires de soins de santé	0,85	0,80
Bâtiment et matériaux de construction	0,80	0,76
Boissons	0,70	0,66
Agro-alimentaire	0,61	0,58
Énergie non renouvelable	0,57	0,54
Articles personnels	0,49	0,46
Equipements de loisirs	0,43	0,41
Matériaux industriels	0,43	0,40
Equipements de télécommunications	0,29	0,27
Instruments de placement en actions	0,29	0,27
Matériels et équipements informatiques	0,00	0,00
Total	95,71	90,39

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

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

Pays	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
France	27,40	25,87
Pays-Bas	15,44	14,58
Italie	10,51	9,92
Allemagne	8,59	8,11
États-Unis	6,52	6,16
Luxembourg	5,84	5,51
Suède	5,09	4,80
Royaume-Uni	4,29	4,06
Espagne	2,88	2,72
Portugal	1,92	1,82
Irlande	1,70	1,60
Danemark	1,65	1,55
Japon	0,91	0,86
Belgique	0,76	0,72
Israël	0,76	0,72
Îles Vierges Britanniques	0,50	0,48
Autriche	0,48	0,46
Chypre	0,47	0,45
Total	95,71	90,39

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

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

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Parts d'OPC	1,33	1,25
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	1,33	1,25
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	1,33	1,25

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

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 HIGH YIELD SHORT DURATION

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Obligations			355 688 750,48	95,71
Obligations convertibles en actions négociées sur un marché réglementé			11 175 649,65	3,01
Automobiles et équipementiers			2 042 855,35	0,55
IHOVER 6 3/4 11/15/29	EUR	1 881 000	2 042 855,35	0,55
Fournisseurs de services de télécommunications			9 132 794,30	2,46
BRITEL 5 1/8 10/03/54	EUR	3 089	3 388 631,73	0,91
KPN 4 7/8 PERP	EUR	2 630	2 757 291,64	0,74
TELEFO 6.135 PERP	EUR	27	2 986 870,93	0,81
Autres obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			341 650 102,20	91,93
Agro-alimentaire			2 284 718,28	0,61
BEL 4,375%24-110429	EUR	9	946 706,55	0,25
TEREOS 5 7/8 04/30/30	EUR	568	583 714,04	0,16
TEREOS FINANCE 7,25%23-150428	EUR	710	754 297,69	0,20
Articles personnels			1 827 345,90	0,49
LEVI 4 08/15/30	EUR	1 786	1 827 345,90	0,49
Automobiles et équipementiers			31 938 073,14	8,59
EOFP 5 5/8 06/15/30	EUR	3 241	3 411 991,11	0,92
F 4.066 08/21/30	EUR	2 446	2 467 692,80	0,66
FORVIA 2,75%21-150227	EUR	261	262 684,39	0,07
GESTAMP AUTOM. 3,25%18-300426	EUR	852	864 824,49	0,23
GESTSM 4 3/8 10/15/30	EUR	3 800	3 818 924,00	1,03
OPMFP 4.2955 02/05/31	EUR	25	2 533 889,32	0,68
RENAUL 3 7/8 09/30/30	EUR	52	5 199 024,11	1,40
SCHAEFFLER 4,5%24-280330	EUR	46	4 785 325,18	1,29
SCHAEFFLER 4,75%24-140829	EUR	12	1 241 888,05	0,33
VALEO 28MAY2027 EUR	EUR	15	1 579 623,08	0,43
VOVCAB 4.2 06/10/29	EUR	3 418	3 493 701,21	0,94
ZF FIN 2,75%20-250527	EUR	23	2 278 505,40	0,61
Banques			6 293 394,76	1,69
RENAUL 5 1/2 10/09/34	EUR	16	1 770 728,33	0,47
VW 7 1/2 PERP	EUR	28	3 082 414,90	0,83
VW INTL FINANCE TV18-PERP.	EUR	14	1 440 251,53	0,39
Bâtiment et matériaux de construction			2 989 293,23	0,80
IPGIM 4 7/8 04/30/30	EUR	2 796	2 989 293,23	0,80
Boissons			2 600 035,83	0,70
PICSUR 6 3/8 07/01/29	EUR	2 446	2 600 035,83	0,70
Chimie			6 476 889,46	1,74
CE 5 04/15/31	EUR	2 700	2 766 825,00	0,74
GRUENENTHAL 6,75%23-150530	EUR	2 716	2 933 599,13	0,79
YULCLN 7 3/8 05/02/29	EUR	810	776 465,33	0,21
Distributeurs			13 526 646,59	3,64
CEETRU 5 7/8 04/17/28	EUR	22	2 333 630,41	0,63
ELO 6%23-220329	EUR	20	2 148 560,82	0,58
SAPSJ 3 5/8 03/15/28	EUR	1 791	1 794 352,40	0,48

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
VERISR 5 1/2 05/15/30	EUR	4 246	4 504 456,38	1,21
VERISR 7 1/8 02/01/28	EUR	2 630	2 745 646,58	0,74
Electricité			20 141 663,66	5,42
EDF TV22-PERP.	EUR	16	3 716 780,27	1,00
EDP-ENERGIAS TV23-230483	EUR	26	2 827 440,59	0,76
EDPPL 4 5/8 09/16/54	EUR	41	4 324 321,11	1,16
ENEL TV23-PERP.	EUR	2 123	2 311 147,24	0,62
ORSTED TV22-PERP.	EUR	3 338	3 576 009,46	0,96
TENN 4 5/8 PERP	EUR	1 791	1 872 689,96	0,51
TERNA TVPERP	EUR	1 519	1 513 275,03	0,41
Energie non renouvelable			2 129 666,30	0,57
SRGIM 4 1/2 PERP	EUR	20	2 129 666,30	0,57
Equipement électronique et électrique			5 074 792,33	1,37
ALOPF 5.868 PERP	EUR	23	2 457 195,99	0,66
BDC 3 7/8 03/15/28	EUR	2 606	2 617 596,34	0,71
Equipements de loisirs			1 615 545,76	0,43
DOMSS 2 09/29/28	EUR	1 680	1 615 545,76	0,43
Equipements de télécommunications			1 081 414,79	0,29
TELEFON ERICSSON 5,375%23-0528	EUR	1 000	1 081 414,79	0,29
Equipements et services médicaux			5 298 799,63	1,43
AVANTOR FDG 3,875%20-150728	EUR	2 003	2 020 142,06	0,55
EUROFINS SCIENTIFIC TV23-PERP.	EUR	3 030	3 278 657,57	0,88
Fournisseurs de services de télécommunications			48 462 247,18	13,04
FIBCOF 4 3/4 06/30/30	EUR	7 446	7 660 618,20	2,06
ILDFP 4 1/4 01/09/32	EUR	30	3 028 674,25	0,82
ILDFP 5 5/8 02/15/30	EUR	20	2 223 142,19	0,60
ILIAD 5,375%23-150229	EUR	25	2 726 006,51	0,73
INWIT 1,875%20-080726	EUR	743	742 738,32	0,20
LORCAT 5 3/4 04/30/29	EUR	4 056	4 240 001,57	1,14
LORCA TELE BNDC 4%20-180927	EUR	1 791	1 795 851,62	0,48
SOFTBK 5 1/4 10/10/29	EUR	3 250	3 395 659,58	0,91
TDCDC 5.186 08/02/29	EUR	2 393	2 538 343,67	0,68
TELECOM ITALIA 7,875%23-310728	EUR	5 477	6 188 188,45	1,67
TELEFO 2.376 PERP	EUR	79	7 572 929,83	2,04
TITANL 3 1/2 02/15/28	EUR	2 372	2 398 569,65	0,65
VODAFONE GROUP TV20-270880	EUR	4 089	3 951 523,34	1,06
Gaz eau et services multiples aux collectivités			8 231 437,71	2,21
SAUR 3 7/8 01/31/31	EUR	2 600	2 584 153,78	0,69
VEOLIA ENVIRON. TV23-PERP.	EUR	51	5 647 283,93	1,52
Industries généralistes			4 823 257,57	1,30
ABESM 4.87 PERP	EUR	38	4 031 456,96	1,09
BALL 1,5%150327	EUR	800	791 800,61	0,21
Instruments de placement en actions			1 075 005,12	0,29
IGBOND 2 1/2 06/24/28	EUR	1 094	1 075 005,12	0,29

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Instruments de placement hors actions			12 001 070,39	3,23
DUFY ONE 3,375%21-150428	EUR	3 500	3 558 121,88	0,96
OPALBD 5 1/2 03/31/32	EUR	2 800	2 903 531,56	0,78
SAZKAG 7 1/4 04/30/30	EUR	1 663	1 597 947,18	0,43
ZIGGO 5 1/4 01/15/33	EUR	3 928	3 941 469,77	1,06
Investissement immobilier et services			18 486 398,95	4,97
AAFFP 6 07/25/29	EUR	2 321	2 453 057,16	0,66
ARNDTN 3 1/4 01/02/31	EUR	18	1 753 938,00	0,47
GYCGR 4 3/8 01/09/30	EUR	38	4 066 849,53	1,09
GYCGR 6 1/8 PERP	EUR	1 300	1 389 491,47	0,37
HEIBOS 3 7/8 11/05/29	EUR	3 185	3 338 836,81	0,90
TECHEM VER 675 5,375%24-150729	EUR	2 687	2 843 449,08	0,77
ZF EU FINANCE 4,75%24-310129	EUR	26	2 640 776,90	0,71
Logiciels et services informatiques			5 301 394,71	1,43
ALMAIN 5 10/30/30	EUR	2 850	2 960 754,17	0,80
IGT 4 1/4 03/15/30	EUR	2 295	2 340 640,54	0,63
Matériaux industriels			1 582 683,02	0,43
PROGROUP 5,125%24-120429	EUR	1 519	1 582 683,02	0,43
Matériel équipements destinés aux TI			7 536 498,37	2,03
EUTELSAT SA 9.75% 13/04/2029	EUR	500	563 600,42	0,15
INFINEON TECHNOLOG TV19-PERP.	EUR	5	513 176,99	0,14
PRYIM 5 1/4 PERP	EUR	4 010	4 212 028,19	1,13
RXLFP 4 09/15/30	EUR	2 211	2 247 692,77	0,61
Matériels et équipements informatiques			10,00	0,00
E.KABEL HESSEN 14,5%00-10	EUR	100	10,00	0,00
Médias			8 853 038,19	2,38
ASMDEE 5 3/4 12/15/29	EUR	3 730	2 123 514,41	0,57
BANIJAY ENTERT 7%23-010529	EUR	2 630	2 814 050,32	0,76
BERTELSMANN TV15-230475 JR SUB	EUR	9	917 364,82	0,25
VERTICAL MIDCO 4,375%20-150727	EUR	2 964	2 998 108,64	0,80
Métaux industriels et extraction			3 631 764,34	0,98
OI 5 1/4 06/01/29	EUR	3 466	3 631 764,34	0,98
Pharmacie/biotechnologie/Producteurs de Marijuana			16 004 966,15	4,31
OGN 2 7/8 04/30/28	EUR	2 630	2 597 016,88	0,70
SAZGR 5 5/8 02/21/30	EUR	3 845	3 969 616,45	1,07
TEVA PHARMAC 7,375%23-150929	EUR	5 846	6 624 234,95	1,78
TEVA PHARMA IND 4,375%21-0530	EUR	2 700	2 814 097,87	0,76
Prestataires de soins de santé			3 150 294,25	0,85
CLARFP 7 7/8 06/27/30	EUR	30	3 150 294,25	0,85
Services appui à industrie			14 196 121,50	3,82
ELIS 4,125%22-240527	EUR	9	932 665,32	0,25
IQVIA 2,25%21-150329	EUR	3 219	3 120 313,51	0,84
IQVIA 2,875%20-150628	EUR	2 241	2 238 030,99	0,60
ROSINI 6 3/4 12/31/29	EUR	3 539	3 801 239,90	1,02
SPIEFP 3 3/4 05/28/30	EUR	40	4 103 871,78	1,11

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Services aux consommateurs			9 270 661,86	2,49
BELRON 4 5/8 10/15/29	EUR	3 421	3 589 911,40	0,96
QPARKH 4 1/4 09/01/30	EUR	2 000	2 040 519,44	0,55
QPARKH 5 1/8 02/15/30	EUR	1 713	1 781 131,48	0,48
Q-PARK HLDG I 5,125%24-010329	EUR	1 791	1 859 099,54	0,50
Services bancaires invest et de courtage			27 036 335,88	7,28
ACCINV 5 3/8 05/15/30	EUR	3 260	3 425 867,89	0,92
AVIS BUDGET 7% 280229	EUR	1 519	1 576 603,86	0,42
CCK 3 3/4 09/30/31	EUR	7 100	7 092 616,00	1,91
EIRCOM 5 3/4 12/15/29	EUR	3 455	3 670 005,61	0,99
EMPARQ 1 7/8 02/01/28	EUR	1 094	1 066 920,31	0,29
MATTER 3 7/8 10/15/30	EUR	4 723	4 712 125,95	1,27
PHARGR 4 7/8 07/10/29	EUR	31	3 291 949,45	0,89
PLD 4 05/05/34	EUR	275	286 354,30	0,08
SPMIM 4 7/8 05/30/30	EUR	1 770	1 913 892,51	0,51
Sociétés de placement immobilier			10 994 739,48	2,96
ALTAFP 5 1/2 10/02/31	EUR	25	2 665 200,00	0,72
ARNDTN 5 PERP	EUR	3 348	3 231 204,79	0,87
MERYFP 4 09/10/31	EUR	22	2 263 538,11	0,61
URWFP 4 7/8 PERP	EUR	27	2 834 796,58	0,76
Soins personnels pharmacies et épiceries			7 341 227,25	1,98
COTY 5,75%23-150928	EUR	2 630	2 716 987,98	0,73
ONTEX 5 1/4 04/15/30	EUR	2 725	2 829 504,79	0,76
WEPAHY 2 7/8 12/15/27	EUR	1 791	1 794 734,48	0,49
Transport industriel			11 665 522,25	3,14
ATLIM 3.7 09/29/31	EUR	3 908	3 905 397,70	1,05
CMACG 5 01/15/31	EUR	2 800	2 890 377,78	0,78
GETFP 4 1/8 04/15/30	EUR	4 661	4 869 746,77	1,31
Voyages et Loisirs			18 727 148,37	5,04
ACCOR TV23-PERP.	EUR	16	1 815 634,63	0,49
ACFP 4 7/8 PERP	EUR	5	515 326,30	0,14
BERFRA 6 1/2 07/18/30	EUR	1 979	1 975 004,62	0,53
CCL 5 3/4 01/15/30	EUR	700	785 021,23	0,21
ELIOR 5 5/8 03/15/30	EUR	2 992	3 078 128,46	0,83
FLTR 5 04/29/29	EUR	2 500	2 644 436,11	0,71
LHAGR 5 1/4 01/15/55	EUR	20	2 141 534,52	0,58
LTCMIM 4 7/8 01/31/31	EUR	1 933	2 029 133,73	0,55
PLAYTECH PLC 5,875%280628	EUR	1 791	1 873 224,52	0,50
TUIGR 5 7/8 03/15/29	EUR	1 791	1 869 704,25	0,50
Autres obligations et valeurs assimilées non négociées sur un marché réglementé			2 862 998,63	0,77
Matériel équipements destinés aux TI			2 862 998,63	0,77
NEXANS 4,25%24-110330	EUR	27	2 862 998,63	0,77
Parts d'OPC et fonds d'investissements			4 927 162,27	1,32

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne			4 927 162,27	1,32
UNION PLUS	EUR	23,858	4 927 162,27	1,32
Total			360 615 912,75	97,03

CM-AM HIGH YIELD SHORT DURATION

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 HIGH YIELD SHORT DURATION

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 HIGH YIELD SHORT DURATION

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 HIGH YIELD SHORT DURATION

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 HIGH YIELD SHORT DURATION

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 HIGH YIELD SHORT DURATION

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 HIGH YIELD SHORT DURATION

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 HIGH YIELD SHORT DURATION

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 HIGH YIELD SHORT DURATION

SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	360 615 912,75
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 (+)	32 897 166,47
Autres passifs (-)	-21 876 835,05
Total = actif net	371 636 244,17