

CM-AM OBLIGATIONS ISR

Document d'information périodique au 30/06/2026

CM-AM OBLIGATIONS ISR

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	19
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS	20
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS	21
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE	22
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT	23
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS	24
INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	25
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	26
SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE	27

CM-AM OBLIGATIONS ISR

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	151 553 558,01
b) Avoirs bancaires	5 027 452,32
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	23 261,30
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	156 604 271,63
e) Passif	-40 232,73
f) Valeur nette d'inventaire	156 564 038,90

* Les montants sont signés

CM-AM OBLIGATIONS ISR

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
FR0007084611	PART CAPI ES	Capitalisable	EUR	141 992 428,88	90 670,203	1 566,03
FR001400ENT4	PART CAPI IC	Capitalisable	EUR	266 496,33	2,489	107 069,63
FR001400ENU2	PART CAPI RC	Capitalisable	EUR	14 305 113,69	8 397,74629	1 703,44

CM-AM OBLIGATIONS ISR

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	96,80	96,77
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 OBLIGATIONS ISR

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	24 896 514,41	12 377 437,33
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	24 896 514,41
Cessions	12 377 437,33

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Pas de distribution sur la période.

CM-AM OBLIGATIONS ISR

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

Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
		Actif net	Total des actifs
Euro	151 553 558,01	96,80	96,77
Total	151 553 558,01	96,80	96,77

CM-AM OBLIGATIONS ISR

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

Secteur économique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Banques	21,15	21,15
Souverains	13,65	13,65
Services bancaires invest et de courtage	6,09	6,09
Entités garanties par Etat	5,09	5,09
Supranational	4,69	4,69
Automobiles et équipementiers	4,61	4,61
Fournisseurs de services de télécommunications	4,43	4,43
Distributeurs	3,75	3,75
Matériel équipements destinés aux TI	3,07	3,07
Pharmacie/biotechnologie/Producteurs de Marijuana	2,95	2,95
Transport industriel	2,75	2,75
Electricité	2,25	2,25
Gaz eau et services multiples aux collectivités	1,86	1,85
Bâtiment et matériaux de construction	1,68	1,68
Agro-alimentaire	1,50	1,50
Equipements et services médicaux	1,50	1,50
Sociétés de placement immobilier	1,50	1,50
Chimie	1,39	1,39
Assurance - Non vie	1,38	1,38
Industries généralistes	1,33	1,33
Electricité	1,27	1,27
Instruments de placement hors actions	1,25	1,24
Logiciels et services informatiques	1,18	1,18
Boissons	1,08	1,08
Investissement immobilier et services	0,95	0,95
Soins personnels pharmacies et épiceries	0,85	0,84
Médias	0,77	0,77
Aérospatial et défense	0,59	0,59
Equipements de loisirs	0,56	0,56
Ingénierie Industrielle	0,35	0,35
Produits ménagers et constr individuelle	0,33	0,33
Assurance vie	0,32	0,32
Equipelement électronique et électrique	0,31	0,31
Services aux consommateurs	0,19	0,19
Collectivités Territoriales	0,18	0,18
Total	96,80	96,77

CM-AM OBLIGATIONS ISR

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

Pays	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
France	26,54	26,53
Allemagne	15,59	15,59
Pays-Bas	15,02	15,02
Espagne	14,26	14,25
Luxembourg	5,54	5,54
Finlande	5,13	5,12
Italie	4,20	4,20
Belgique	2,99	2,99
Danemark	2,38	2,38
États-Unis	0,79	0,79
Royaume-Uni	0,79	0,79
Norvège	0,78	0,78
Suisse	0,72	0,72
Portugal	0,65	0,65
Irlande	0,56	0,56
Suède	0,48	0,48
Autriche	0,38	0,38
Total	96,80	96,77

CM-AM OBLIGATIONS ISR

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 OBLIGATIONS ISR

COMMISSION DE PERFORMANCE

PART CAPI ES	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

*Par rapport à l'actif net moyen

CM-AM OBLIGATIONS ISR

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Obligations			151 553 558,01	96,80
Obligations convertibles en actions négociées sur un marché réglementé			3 458 160,00	2,21
Souverains			3 458 160,00	2,21
DBR 0 02/15/32	EUR	400 000 000	3 458 160,00	2,21
Autres obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			147 290 649,41	94,08
Aérospatial et défense			923 733,56	0,59
AIRBUS 1,375%16-130531	EUR	1 000	923 733,56	0,59
Agro-alimentaire			2 341 712,55	1,50
BNFP 0.52 11/09/30	EUR	3	270 056,38	0,17
BNFP 3.2 09/12/31	EUR	3	307 235,30	0,20
BNFP 3.438 04/07/33	EUR	2	200 978,10	0,13
CARLSBERG BREW 4%23-051028	EUR	542	569 186,20	0,36
DANONE 0,571%20-170327	EUR	7	690 790,72	0,44
DANONE 3,071%22-070932 EMTN	EUR	3	303 465,85	0,20
Assurance - Non vie			2 161 684,00	1,38
ALLIANZ FINANCE II 0%21-221126	EUR	7	693 042,00	0,44
ALVGR 3 1/4 12/04/29	EUR	4	412 531,45	0,26
AXASA 3 3/4 10/12/30	EUR	1 000	1 056 110,55	0,68
Assurance vie			502 141,23	0,32
POSIM 3 12/03/30	EUR	500	502 141,23	0,32
Automobiles et équipementiers			7 219 203,24	4,61
BMW 0 3/4 07/13/26	EUR	800	805 371,18	0,51
BMW 3 1/4 11/17/28	EUR	1 184	1 214 834,12	0,78
MBGGR 1 3/8 05/11/28	EUR	1 500	1 464 343,36	0,93
MLFP 3 1/8 05/16/31	EUR	10	997 103,97	0,64
STELLANTIS 0,625%21-300327	EUR	917	902 721,93	0,58
STELLANTIS 0,75%21-180129	EUR	160	149 462,47	0,10
STELLANTIS 4,375%23-140330	EUR	320	328 487,98	0,21
VOLKSWAGEN LEASING 0,375%21-26	EUR	520	521 271,44	0,33
VW 3 7/8 09/10/30	EUR	800	835 606,79	0,53
Banques			33 117 747,29	21,15
ABN AMRO 0,5%21-230929	EUR	6	554 029,81	0,35
ABNANV 3 1/8 01/21/30	EUR	14	1 425 115,81	0,91
ACAFP 3 1/8 01/26/29	EUR	4	405 996,71	0,26
AIB 3 3/4 12/02/36	EUR	454	459 530,09	0,29
BACR 3.32 06/17/29	EUR	1 227	1 234 919,53	0,79
BAMIIM 3 3/8 01/21/30	EUR	900	917 576,51	0,59
BANQUE POSTALE 1,375%19-240429	EUR	15	1 434 418,97	0,92
BBVA 0,875%22-140129	EUR	16	1 556 578,19	0,99
BBVASM 4 5/8 01/13/31	EUR	4	427 280,44	0,27
BFCM 0,1%20-081027	EUR	3	290 229,45	0,19
BFCM 4,375%24-110134 EMTN	EUR	10	1 041 326,44	0,67
BFCM 4 01/15/35	EUR	6	614 652,58	0,39
BKIR 3 5/8 05/19/32	EUR	405	410 609,19	0,26

CM-AM OBLIGATIONS ISR

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
BNP 4.1986 07/16/35	EUR	5	527 252,79	0,34
BNPP TV21-30052028 EMTN	EUR	2	195 924,41	0,13
BPCEGP 4 1/4 07/16/35	EUR	1	105 629,99	0,07
BPCE TV22-140128 EMTN	EUR	9	891 553,56	0,57
BSTLAF 2 7/8 01/19/29	EUR	2	200 957,56	0,13
CABKSM 3 5/8 09/19/32	EUR	5	517 952,05	0,33
CAIXABANK 07092029 EMTN	EUR	3	315 400,93	0,20
CAIXABANK TV22-210128 EMTN	EUR	5	495 601,99	0,32
CCBGBB 3 3/8 02/20/31	EUR	18	1 815 327,86	1,16
CCBGBB 3 7/8 04/14/32	EUR	2	204 801,40	0,13
CMZB 3 1/8 06/06/30	EUR	5	498 518,01	0,32
COOP RABOBANK 4%23-100130	EUR	15	1 570 018,36	1,00
CREDIT AGRICO.TV21-210929 EMTN	EUR	3	283 944,12	0,18
CREDIT AGRICOLE 0,125%20-1227	EUR	5	481 741,03	0,31
CREDIT AGRICOLE 0,375%21-0428	EUR	4	382 132,00	0,24
DANBNK 3 1/2 05/26/33	EUR	750	754 145,96	0,48
DB 1 3/8 02/17/32	EUR	4	366 074,25	0,23
DB 5 3/8 01/11/29	EUR	3	317 309,63	0,20
DEUTSCHE BANK 4%22-291127	EUR	4	415 340,66	0,27
DNB BK ASA TV21-230229	EUR	1 000	956 593,56	0,61
DNBNO 3 3/4 07/02/35	EUR	260	261 115,40	0,17
FRLBP 1 02/09/28	EUR	3	297 806,34	0,19
ING GROEP TV21-090632	EUR	1	98 316,14	0,06
INTESA SANPAOLO 1%19-191126	EUR	700	700 234,07	0,45
INTESA SANPAOLO 4,875%23-0530	EUR	1 500	1 600 240,07	1,02
INTNED 3 08/17/31	EUR	7	708 805,42	0,45
INTNED 3 1/2 09/03/30	EUR	10	1 035 928,90	0,66
KBC GROUP TV22-231127	EUR	5	516 509,86	0,33
NDAFH 3 10/28/31	EUR	100	100 836,14	0,06
NORDEA BK 0,5%21-021128	EUR	540	511 706,74	0,33
NORDEA BK 1,125%22-160227	EUR	700	696 585,25	0,44
SABSM 5 1/2 09/08/29	EUR	7	764 892,40	0,49
SANTAN 4 1/4 04/22/38	EUR	5	510 878,56	0,33
SANTANDER 0,625%29	EUR	8	762 413,59	0,49
SOCIETEGENERALE 0,25%21-080727	EUR	3	293 327,67	0,19
SOCIETE GENERALE TV21-021227	EUR	7	696 598,10	0,44
UCGIM 3.1 06/10/31	EUR	714	711 385,68	0,45
UNICREDIT 2,125%16-241026	EUR	100	101 338,30	0,06
UNICREDIT MTN 0729	EUR	400	385 665,70	0,25
UNICREDIT TV23-170129	EUR	281	294 679,12	0,19
Bâtiment et matériaux de construction			2 629 058,63	1,68
CIE DE SAINT-GOBAI 3,375%24-30	EUR	4	405 787,84	0,26
FERSM 3 1/4 01/16/30	EUR	419	424 932,98	0,27
SGOFP 3 1/4 08/09/29	EUR	10	1 032 876,44	0,66
VINCI 1,75%18-260930	EUR	8	765 461,37	0,49

CM-AM OBLIGATIONS ISR

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Boissons			1 690 750,20	1,08
PERNOD RICARD 0,125%21-041029	EUR	8	729 910,47	0,47
PERNOD RICARD 1,375%22-070429	EUR	10	960 839,73	0,61
Chimie			2 173 534,58	1,39
AKEFP 3 1/2 09/09/33	EUR	1	101 291,36	0,06
AKEFP 3 1/2 09/12/34	EUR	4	402 506,36	0,26
AKZANA 3 5/8 06/16/29	EUR	141	142 126,45	0,09
AKZO NOBEL 2%22-280332	EUR	1 000	923 480,27	0,59
LIN 3.2 05/13/30	EUR	6	604 130,14	0,39
Collectivités Territoriales			285 453,00	0,18
REGION ILE DE FR 0%21-200428	EUR	3	285 453,00	0,18
Distributeurs			5 871 576,26	3,75
KERING 0,75%20-130528	EUR	10	962 157,40	0,62
KERING 3,25%23-270229	EUR	7	711 039,10	0,45
KERING 3,375%24-110332 EMTN	EUR	2	200 733,73	0,13
OBL 2.4 04/18/30	EUR	400 000 000	3 997 646,03	2,55
Electricité			1 988 736,71	1,27
ENEXIS 3 02/25/32	EUR	2 000	1 988 736,71	1,27
EDPPL 3 7/8 06/26/28	EUR	10	1 017 286,99	0,65
RED ELEC FINANC 1,25%18-130327	EUR	15	1 490 552,05	0,95
TERNA 0,375%29	EUR	396	366 067,34	0,23
TRNIM 3 1/8 02/17/32	EUR	650	650 336,84	0,42
Entités garanties par Etat			7 967 532,06	5,09
BNG 0 01/20/31	EUR	1 500	1 319 985,00	0,84
CADES 0%21-250531	EUR	13	1 123 811,00	0,72
ICO 3,05%23-311027	EUR	250	256 539,76	0,16
KRED WIEDERAUFBAU 0,75%19-0129	EUR	5 500	5 267 196,30	3,37
Equipement électronique et électrique			485 897,19	0,31
ALSTOM 0,125%21-270727	EUR	5	485 897,19	0,31
Equipements de loisirs			870 855,61	0,56
PHIANA 3 1/4 05/23/30	EUR	206	206 630,70	0,13
ROYAL PHILIPS 1,875%22-050527	EUR	667	664 224,91	0,43
Equipements et services médicaux			2 349 265,66	1,50
EFFP 2 5/8 01/10/30	EUR	9	898 093,60	0,57
IBESM 3 09/30/31	EUR	4	405 181,10	0,26
IBESM 3 5/8 07/18/34	EUR	10	1 045 990,96	0,67
Fournisseurs de services de télécommunications			6 942 040,46	4,43
CLNXSM 3 01/19/31	EUR	4	398 151,78	0,25
DT 2 12/01/29	EUR	1 500	1 477 291,85	0,94
DT 3 1/4 06/04/35	EUR	250	246 228,29	0,16
KPN 0 7/8 12/14/32	EUR	9	772 267,07	0,49
ORAFP 0 09/04/26	EUR	2	199 108,00	0,13
ORAFP 1 1/4 07/07/27	EUR	3	299 384,63	0,19
ORAFP 3 1/2 05/19/35	EUR	3	297 533,75	0,19
ORAFP 3 1/4 01/17/35	EUR	4	393 576,33	0,25

CM-AM OBLIGATIONS ISR

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
PROXBB 3 3/4 04/08/35	EUR	5	501 936,44	0,32
PROXIMUS 4,125%23-171133	EUR	10	1 057 234,11	0,68
TELEFO 1.201 08/21/27	EUR	3	297 883,44	0,19
TELEFO 2.318 10/17/28	EUR	10	1 001 444,77	0,64
Gaz eau et services multiples aux collectivités			2 903 931,03	1,86
ENGIE 3,875%23-061233	EUR	15	1 566 348,29	1,00
NTGYSM 0 3/4 11/28/29	EUR	10	929 138,36	0,60
VIEFP 3.69 04/10/31	EUR	4	408 444,38	0,26
Industries généralistes			2 083 056,91	1,33
DGFP 3 1/8 03/06/33	EUR	5	493 326,37	0,31
SIEGR 0 1/8 09/05/29	EUR	1 500	1 390 076,10	0,89
SIEGR 3 1/8 05/27/33	EUR	2	199 654,44	0,13
Ingénierie Industrielle			542 162,92	0,35
DTRGR 3 3/8 09/23/30	EUR	3	309 349,60	0,20
VOLVO TREASURY 2%22-190827	EUR	231	232 813,32	0,15
Instruments de placement hors actions			1 949 708,73	1,25
ESSITY CAPITAL 0,25%21-150929	EUR	889	816 454,31	0,52
ZKB 3.08 05/18/29	EUR	1 125	1 133 254,42	0,73
Investissement immobilier et services			1 492 232,51	0,95
GFCFP 3 1/4 06/03/31	EUR	14	1 394 599,07	0,89
VONOVIA 0,375%21-160627	EUR	1	97 633,44	0,06
Logiciels et services informatiques			1 844 235,60	1,18
CAPFP 3 1/8 09/25/31	EUR	4	401 009,04	0,26
DSYFP 3 3/8 06/16/31	EUR	8	804 495,56	0,51
IBM 09022030	EUR	688	638 731,00	0,41
Matériel équipements destinés aux TI			4 811 456,99	3,07
ASML 0 5/8 05/07/29	EUR	1 000	940 358,90	0,60
INFINEON TECHNOLOG 1,625%20-29	EUR	10	959 456,16	0,61
LRFP 0 3/8 10/06/31	EUR	10	868 793,70	0,56
LRFP 3 1/2 06/26/34	EUR	4	401 654,14	0,26
LRFP 3 5/8 03/19/35	EUR	3	304 850,42	0,19
SCHNEID.EL.3,25%23-120628 EMTN	EUR	3	302 508,25	0,19
SCHNEIDER EL 3,125%23-131029	EUR	3	307 974,45	0,20
SCHNEIDER ELECT.3,5%22-091132	EUR	7	725 860,97	0,46
Médias			1 202 671,61	0,77
PUBFP 2 7/8 06/12/29	EUR	10	995 235,34	0,64
RELLN 3 1/4 05/22/29	EUR	206	207 436,27	0,13
Pharmacie/biotechnologie/Producteurs de Marijuana			4 622 669,70	2,95
NOVNVX 3.1 01/13/32	EUR	1 333	1 337 114,40	0,85
NOVOB 2 1/2 02/20/29	EUR	750	749 573,32	0,48
NOVOB 2 7/8 08/27/30	EUR	278	282 948,13	0,18
NOVOB 3 1/4 01/21/31	EUR	1 344	1 370 671,22	0,87
SANFP 2 3/4 03/11/31	EUR	5	497 826,85	0,32
SANOFI 1,25%22-060429	EUR	4	384 535,78	0,25

CM-AM OBLIGATIONS ISR

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Produits ménagers et constr individuelle			516 441,85	0,33
ELECTROLUX 4,125%22-051026	EUR	500	516 441,85	0,33
Services aux consommateurs			298 702,32	0,19
AYVFP 3 04/18/30	EUR	3	298 702,32	0,19
Services bancaires invest et de courtage			9 536 530,03	6,09
DBOERS 3 1/4 03/24/31	EUR	117	118 990,65	0,08
DEUTSCHE BAHN FIN 0,625%16-28	EUR	1 800	1 723 243,32	1,10
DEUTSCHE BOERSE 1,5%22-040432	EUR	10	916 747,53	0,59
DEUTSCHE BOERSE 3,75%23-280929	EUR	6	629 921,34	0,40
ENELIM 0 1/2 06/17/30	EUR	1 000	909 258,22	0,58
KUNTA 2 3/4 06/14/33	EUR	3 000	2 961 678,49	1,89
MBGGR 3 1/4 11/15/30	EUR	875	893 244,11	0,57
MEDIOBANCA 1% 17072029	EUR	364	351 645,49	0,22
SOCGEN 3 3/4 05/17/35	EUR	3	300 220,81	0,19
SOCGEN 3 3/4 07/15/31	EUR	7	731 580,07	0,47
Sociétés de placement immobilier			2 354 620,08	1,50
COFINIMMO 1%22-240128	EUR	6	583 605,70	0,37
ICADE 1,5%17-130927	EUR	3	298 176,00	0,19
URW 0,625%20-040527	EUR	3	294 708,08	0,19
URWFP 0 3/4 10/25/28	EUR	8	763 861,59	0,49
URWFP 3 1/2 09/11/29	EUR	4	414 268,71	0,26
Soins personnels pharmacies et épiceries			517 837,47	0,33
ORFP 3 3/8 11/23/29	EUR	5	517 837,47	0,33
Souverains			17 919 341,06	11,45
ALLEMAGNE 2,20%23-130428 BOBLS	EUR	210 000 000	2 098 660,03	1,34
ESPAGNE 5,90%11-300726	EUR	84	88 795,89	0,06
OAT 0,50%19-25052029	EUR	3 500 000	3 285 451,92	2,10
OAT 0%22-250532	EUR	1 000 000	835 040,00	0,53
RFGB 0 1/2 09/15/29	EUR	4 000	3 755 210,41	2,40
SPAIN 0%21-310128	EUR	6 000	5 766 480,00	3,68
SPGB 2.55 10/31/32	EUR	2 100	2 089 702,81	1,34
Supranational			7 338 351,81	4,69
EFSF 3 1/2 04/11/29	EUR	2 000	2 058 486,03	1,32
EU 1 07/06/32	EUR	1 300 000	1 179 048,53	0,75
EUROPEAN UNION 0%20-040735	EUR	1 115	843 776,25	0,54
EUROPEAN UNION 0%20-041030	EUR	3 650	3 257 041,00	2,08
Transport industriel			4 311 533,34	2,75
ADIF 3,25%24-310529	EUR	15	1 518 448,97	0,97
ADIF ALTA VELOCIDAD 0728	EUR	12	1 255 098,08	0,80
ASFING 2 3/4 10/02/34	EUR	6	597 485,10	0,38
DSVDC 3 1/8 11/06/28	EUR	450	459 948,02	0,29
KNOGR 3 09/30/29	EUR	471	480 553,17	0,31
Autres obligations et valeurs assimilées non négociées sur un marché réglementé			804 748,60	0,51

CM-AM OBLIGATIONS ISR

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Soins personnels pharmacies et épiceries			804 748,60	0,51
L OREAL 2,875%23-190528	EUR	8	804 748,60	0,51
Total			151 553 558,01	96,80

CM-AM OBLIGATIONS ISR

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 OBLIGATIONS ISR

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 OBLIGATIONS ISR

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 OBLIGATIONS ISR

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 OBLIGATIONS ISR

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 OBLIGATIONS ISR

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 OBLIGATIONS ISR

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 OBLIGATIONS ISR

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 OBLIGATIONS ISR

SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	151 553 558,01
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 (+)	5 050 713,62
Autres passifs (-)	-40 232,73
Total = actif net	156 564 038,90