

CM-AM EUROPE VALUE

DOCUMENTO DE INFORMACIÓN SEMESTRAL A 30/09/2022

FORMA JURÍDICA DEL OIC

SICAV General

CLASIFICACIÓN

Clasificación del BCE Fondo de acciones

ASIGNACIÓN DE RESULTADOS

Resultado de capitalización y de reparto

ESTADO DEL PATRIMONIO

Componentes del estado del patrimonio	Importe al cierre del periodo*
a) Los valores financieros admisibles mencionados en el punto 1.º del apartado I del artículo L. 214-20 del código monetario y financiero francés	234 946 690,55
b) Activos bancarios	13 797 038,76
c) Otros activos del OICVM	887 585,66
d) Total de activos del OICVM	249 631 314,97
e) Pasivo	-957 665,90
f) Valor de inventario neto	248 673 649,07

* Importes certificados

NÚMERO DE PARTICIPACIONES EN CIRCULACIÓN Y VALOR DE INVENTARIO NETO POR PARTICIPACIÓN O ACCIÓN

Participación	Tipo de participación	Patrimonio neto	Número de participaciones en circulación	Valor liquidativo
C1 CM-AM EU.VAL.RC 6D	De capitalización	148 808 601,96	52 555,421811	2831,46
C3 CM-AM EU.VAL.S4DEC	De capitalización	49 476 006,76	17 144,7648	2885,77
D1 CM-AM EU.VAL.RD 6D	De reparto	49 860 509,14	28 302,870979	1761,67
I1 CM-AM EU.VAL.IC 3D	De capitalización	493 048,98	4,767	103 429,61
R1 CM-AM EU.VAL R	De capitalización	35 482,23	265,00	133,89

COMPONENTES DE LA CARTERA DE VALORES

Componentes de la cartera de valores:	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
a) Valores financieros elegibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en un mercado según lo dispuesto en el artículo L. 422-1	94,48	94,12
b) Valores financieros elegibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en otro mercado regulado, con funcionamiento periódico, reconocido, abierto al público y que tenga domicilio social en un Estado miembro de la Unión Europea o en otro Estado que forme parte del Acuerdo sobre el Espacio Económico Europeo.	0,00	0,00
c) Valores financieros elegibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores de un tercer país o negociados en otro mercado de un tercer país regulado, con funcionamiento periódico, reconocido y abierto al público, siempre que dicha bolsa o mercado no esté incluido en una lista elaborada por la Autoridad de los Mercados Financieros o que la elección de dicha bolsa o mercado esté prevista por la ley o por los reglamentos o estatutos del organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios	0,00	0,00
d) Los valores financieros de reciente emisión que se indican en el punto 4.º del apartado I del artículo R. 214-11 del código monetario y financiero francés	0,00	0,00
e) Otros activos	0,30	0,29

DESGLOSE DE LOS ACTIVOS DE LOS APARTADOS A), B) Y F) DEL ARTÍCULO R.214-1-1 POR DIVISA

Títulos	Divisa	Importe (EUR)	Porcentaje	
			Patrimonio neto	Total de activos
DEUTSCHE TELEKOM	EUR	9 238 469,77	3,72	3,67
BNP PARIBAS ACT.A	EUR	9 069 578,37	3,65	3,63
STELLANTIS	EUR	8 064 976,00	3,24	3,23
VINCI	EUR	7 924 520,77	3,19	3,17
TOTALENERGIES SE	EUR	7 414 557,25	2,98	2,97
SANOFI	EUR	7 030 441,60	2,83	2,82
SAP	EUR	6 475 305,24	2,60	2,59
ALLIANZ	EUR	6 371 845,80	2,56	2,55
SIEMENS	EUR	6 255 070,80	2,52	2,51
SAINT-GOBAIN	EUR	5 943 709,20	2,39	2,38
SODEXO	EUR	5 853 974,88	2,35	2,35
ORANGE	EUR	5 546 728,45	2,23	2,22
MERCK KGAA	EUR	5 361 952,80	2,16	2,15
SMURFIT KAPPA GP	EUR	5 220 740,00	2,10	2,09
AXA	EUR	5 081 350,28	2,04	2,04
NEXANS	EUR	5 055 235,20	2,03	2,03
KON.AHOLD DELHAIZE	EUR	4 986 087,57	2,01	2,00
MICHELIN	EUR	4 834 555,61	1,94	1,94
ENI	EUR	4 750 192,18	1,91	1,90
EDP ENERG.PORTUGAL	EUR	4 626 755,28	1,86	1,85
CORPORACION ACCION	EUR	4 390 800,68	1,77	1,76
SOCIETE GENERALE	EUR	4 016 630,84	1,62	1,61
ACCOR	EUR	3 987 671,69	1,60	1,60
INTESA SANPAOLO	EUR	3 986 797,99	1,60	1,60
RENAULT	EUR	3 891 745,80	1,57	1,56
ANDRITZ	EUR	3 837 832,52	1,54	1,54
SOLVAY	EUR	3 619 399,08	1,46	1,45
APERAM	EUR	3 560 637,88	1,43	1,43
VEOLIA ENVIRON.	EUR	3 503 807,28	1,41	1,40
ENEL	EUR	3 489 518,21	1,40	1,40
MERCEDES-BENZ GRP	EUR	3 483 107,25	1,40	1,40
CARREFOUR	EUR	3 346 552,16	1,35	1,34
DEUTSCHE POST NOM.	EUR	3 248 997,19	1,31	1,30
VOLKSWAGEN PRIV.	EUR	3 212 203,20	1,29	1,29
REPSOL	EUR	3 151 533,63	1,27	1,26
DANONE	EUR	3 018 285,51	1,21	1,21
BANCO BILBAO VIZC.	EUR	2 938 406,98	1,18	1,18
GALP ENERGIA	EUR	2 669 809,54	1,07	1,07
PUBLICIS GROUPE	EUR	2 614 585,20	1,05	1,05
AMUNDI	EUR	2 463 541,20	0,99	0,99
AIRBUS	EUR	2 452 652,88	0,99	0,98
THALES	EUR	2 450 970,00	0,99	0,98
ING GROEP	EUR	2 446 012,69	0,98	0,98
ARKEMA	EUR	2 389 421,00	0,96	0,96
INTL CONSOL.AIRL.	EUR	2 165 848,20	0,87	0,87

Títulos	Divisa	Importe (EUR)	Porcentaje	
			Patrimonio neto	Total de activos
FRESENIUS	EUR	1 886 580,55	0,76	0,76
ARCELORMITTAL	EUR	1 237 688,85	0,50	0,50
SIXT ORD.	EUR	1 098 239,25	0,44	0,44
FAURECIA	EUR	951 843,57	0,38	0,38
ATOS	EUR	891 276,00	0,36	0,36
TOTAL	EUR	211 508 443,87	85,06	84,74
BP	GBP	9 094 794,66	3,66	3,64
RIO TINT.ORD	GBP	2 747 496,62	1,10	1,10
TOTAL	GBP	11 842 291,28	4,76	4,74
NOVARTIS	CHF	7 682 270,87	3,09	3,07
ROCHE HOLDING BJ	CHF	2 087 566,18	0,84	0,84
TOTAL	CHF	9 769 837,05	3,93	3,91
SANDVIK	SEK	1 826 118,35	0,73	0,73
TOTAL	SEK	1 826 118,35	0,73	0,73
TOTAL		234 946 690,55	94,48	94,12

DESGLOSE DE LOS ACTIVOS DE LOS APARTADOS A), B) Y F) DEL ARTÍCULO R.214-1-1 POR SECTOR ECONÓMICO

Sector económico	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
Empresas petroleras antiguo código ICB	10,89	10,83
Automóviles y equipos antiguo código ICB	9,83	9,79
Bancos antiguo código ICB	9,03	9,00
Industria farmacéutica y biotecnología antiguo código ICB	8,91	8,88
Construcción y materiales antiguo código ICB	5,58	5,56
Viajes y ocio antiguo código ICB	4,83	4,81
Otros sectores económicos	45,41	45,25
TOTAL	94,48	94,12

DESGLOSE DE LOS ACTIVOS DE LOS APARTADOS A), B) Y F) DEL ARTÍCULO R.214-1-1, POR PAÍS DE RESIDENCIA DEL EMISOR

País	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
FRANCIA	39,12	38,98
ALEMANIA	18,75	18,68
PAÍSES BAJOS	7,22	7,19
OTROS PAÍSES	29,39	29,27
TOTAL	94,48	94,12

DESGLOSE DE OTROS ACTIVOS POR TIPO

Tipo de activo	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
PARTICIPACIONES DE OIC	0,30	0,29
<input type="checkbox"/> OIC y fondos de inversión de tipo general (no profesionales)	0,30	0,29
<input type="checkbox"/> FCPR, FCPI, FIP abiertos a los inversores no profesionales	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> Organismo de titularización	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> OPCI y SCPI abiertos a inversores no profesionales	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> SEF, SICAF y fondos de inversión alternativos	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> Fondos profesionales de tipo general (abiertos a inversores profesionales)	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> OPCI profesionales, fondos profesionales especializados y fondos profesionales de capital riesgo	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> Otras inversiones colectivas	0,00	0,00
OTROS TIPOS DE ACTIVOS	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> Bonos de suscripción	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> Bonos de caja	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> Pagarés	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> Cédulas hipotecarias	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> Otros	0,00	0,00
TOTAL	0,30	0,29

MOVIMIENTOS EN LA CARTERA DE VALORES DURANTE EL PERIODO

Movimientos registrados durante el periodo	Movimientos (en importe)
Adquisiciones	294 827 993,46
Cesiones	580 218 173,96

Reglamento SFTR

Este OIC no ha participado en operaciones sujetas al Reglamento UE 2015/2365 sobre transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización («Reglamento SFTR») durante el periodo, por lo que no tiene información que divulgar a los inversores al respecto.

REPARTO DURANTE EL PERIODO EN CURSO

Participación		Importe unitario en EUR			
		Cuota del resultado	Cuota de las plusvalías netas	Total unitario	Crédito fiscal
Dividendos pagados					
17/06/2022	D PART. DISTRIBUIBLES	0,00	0,00	0,00	0,00
	D1 PART DIST RD	73,70	0,00	73,70	3,15
Dividendos por pagar					
	D PART. DISTRIBUIBLES	0,00	0,00	0,00	0,00
	D1 PART DIST RD	0,00	0,00	0,00	0,00

DETALLE DE LA CARTERA DE VALORES

Designación de los valores	Divisa	Ctd. Número o nominal	Valor bursátil	% Patrimonio neto
TOTAL Acciones y valores similares			234 946 690,55	94,48
TOTAL Acciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar			234 946 690,55	94,48
TOTAL Acciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar (salvo warrants y bonos de sus.)			234 946 690,55	94,48
TOTAL AUSTRIA			3 837 832,52	1,54
AT0000730007 ANDRITZ	EUR	87 943	3 837 832,52	1,54
TOTAL BÉLGICA			3 619 399,08	1,46
BE0003470755 SOLVAY	EUR	45 447	3 619 399,08	1,46
TOTAL SUIZA			9 769 837,05	3,93
CH0012005267 NOVARTIS	CHF	97 818	7 682 270,87	3,09
CH0012032048 ROCHE HOLDING BJ	CHF	6207	2 087 566,18	0,84
TOTAL ALEMANIA			46 631 771,85	18,75
DE0005552004 DEUTSCHE POST NOM.	EUR	104 419	3 248 997,19	1,31
DE0005557508 DEUTSCHE TELEKOM	EUR	528 154	9 238 469,77	3,71
DE0005785604 FRESENIUS	EUR	85 949	1 886 580,55	0,76
DE0006599905 MERCK KGAA	EUR	32 146	5 361 952,80	2,16
DE0007100000 MERCEDES-BENZ GROUP	EUR	66 535	3 483 107,25	1,40
DE0007164600 SAP	EUR	76 977	6 475 305,24	2,60
DE0007231326 SIXT ORD.	EUR	13 385	1 098 239,25	0,44
DE0007236101 SIEMENS	EUR	61 809	6 255 070,80	2,52
DE0007664039 VOLKSWAGEN PRIV.	EUR	25 413	3 212 203,20	1,29
DE0008404005 ALLIANZ	EUR	39 381	6 371 845,80	2,56
TOTAL ESPAÑA			12 646 589,49	5,09
ES0105563003 CORPORACION ACCIONA ENERGIAS R	EUR	114 463	4 390 800,68	1,77
ES0113211835 BCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	EUR	635 950	2 938 406,98	1,18
ES0173516115 REPSOL	EUR	266 966	3 151 533,63	1,27
ES0177542018 INTL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	EUR	2 004 487	2 165 848,20	0,87

Designación de los valores	Divisa	Ctd. Número o nominal	Valor bursátil	% Patrimonio neto
TOTAL FRANCIA			97 280 981,86	39,12
FR0000044448 NEXANS	EUR	55 008	5 055 235,20	2,03
FR0000051732 ATOS	EUR	109 225	891 276,00	0,36
FR0000120172 CARREFOUR	EUR	235 424	3 346 552,16	1,35
FR0000120271 TOTALENERGIES SE	EUR	153 590	7 414 557,25	2,98
FR0000120404 ACCOR	EUR	184 529	3 987 671,69	1,60
FR0000120578 SANOFI	EUR	89 674	7 030 441,60	2,83
FR0000120628 AXA	EUR	226 089	5 081 350,28	2,04
FR0000120644 DANONE	EUR	62 143	3 018 285,51	1,21
FR0000121147 FAURECIA	EUR	84 759	951 843,57	0,38
FR0000121220 SODEXO	EUR	75 868	5 853 974,88	2,35
FR0000121329 THALES	EUR	21 690	2 450 970,00	0,99
FR0000124141 VEOLIA ENVIRONNEMENT	EUR	177 768	3 503 807,28	1,41
FR0000125007 SAINT-GOBAIN	EUR	160 424	5 943 709,20	2,39
FR0000125486 VINCI	EUR	95 281	7 924 520,77	3,19
FR0000130577 PUBLICIS GROUPE	EUR	53 468	2 614 585,20	1,05
FR0000130809 SOCIETE GENERALE	EUR	196 749	4 016 630,84	1,62
FR0000131104 BNP PARIBAS ACTIONS A	EUR	207 994	9 069 578,37	3,65
FR0000131906 RENAULT	EUR	139 140	3 891 745,80	1,57
FR0000133308 ORANGE	EUR	599 776	5 546 728,45	2,23
FR0004125920 AMUNDI	EUR	57 345	2 463 541,20	0,99
FR0010313833 ARKEMA	EUR	31 825	2 389 421,00	0,96
FR001400AJ45 MICHELIN	EUR	208 791	4 834 555,61	1,94
TOTAL REINO UNIDO			11 842 291,28	4,76
GB0007188757 RIO TINTO ORD.	GBP	49 350	2 747 496,62	1,10
GB0007980591 BP	GBP	1 846 699	9 094 794,66	3,66
TOTAL IRLANDA			5 220 740,00	2,10
IE00B1RR8406 SMURFIT KAPPA GROUP	EUR	178 000	5 220 740,00	2,10
TOTAL ITALIA			12 226 508,38	4,92
IT0000072618 INTESA SANPAOLO	EUR	2 341 319	3 986 797,99	1,60

Designación de los valores	Divisa	Ctd. Número o nominal	Valor bursátil	% Patrimonio neto
IT0003128367 ENEL	EUR	826 117	3 489 518,21	1,40
IT0003132476 ENI	EUR	435 398	4 750 192,18	1,92
TOTAL LUXEMBURGO			4 798 326,73	1,93
LU0569974404 APERAM	EUR	145 868	3 560 637,88	1,43
LU1598757687 ARCELORMITTAL	EUR	59 893	1 237 688,85	0,50
TOTAL PAÍSES BAJOS			17 949 729,14	7,22
NL0000235190 AIRBUS	EUR	27 592	2 452 652,88	0,99
NL0011794037 KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	EUR	190 782	4 986 087,57	2,01
NL0011821202 ING GROEP	EUR	276 136	2 446 012,69	0,98
NL00150001Q9 STELLANTIS	EUR	656 971	8 064 976,00	3,24
TOTAL PORTUGAL			7 296 564,82	2,93
PTEDP0AM0009 EDP ENERGIAS PORTUGAL	EUR	1 042 062	4 626 755,28	1,86
PTGAL0AM0009 GALP ENERGIA	EUR	271 764	2 669 809,54	1,07
TOTAL SUECIA			1 826 118,35	0,73
SE0000667891 SANDVIK	SEK	130 226	1 826 118,35	0,73
TOTAL Títulos de OIC			736 085,03	0,30
TOTAL OICVM y equivalentes de otros Estados miembros de la UE			736 085,03	0,30
TOTAL FRANCIA			736 085,03	0,30
FR0013041738 CM-AM HUMAN CARE (IC)	EUR	8,4	736 085,03	0,30