

CM-AM DOLLAR CASH

DOCUMENTO DE INFORMACIÓN SEMESTRAL A 30/09/2022

FORMA JURÍDICA DEL OIC

SICAV General

CLASIFICACIÓN

Monetario

ASIGNACIÓN DE RESULTADOS

Resultado de capitalización

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	431 976 835,82
b) Activos bancarios	72 534 717,08
c) Otros activos del OICVM	179 552 108,98
d) Total de activos del OICVM	684 063 661,88
e) Pasivo	-155 132 886,75
f) Valor de inventario neto	528 930 775,13

* 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 DOL.CAS.IC3D	De capitalización	528 930 775,13	277 569,745	1905,57

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	81,67	63,15
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	3,78	2,93

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
BRED NCP07102022	USD	12 495 695,93	2,36	1,82
CD UBS LDN 091222	USD	12 404 327,92	2,35	1,81
EUROCL 0%22-1022	USD	11 974 645,74	2,26	1,75
NATL BK C 2,15%22	USD	11 576 147,89	2,19	1,69
GLDM SACHS GR TV22	USD	10 896 666,00	2,06	1,59
ECP INSTIT.CRED.22	USD	9 998 987,63	1,89	1,46
ECP NATWEST M.1022	USD	9 996 278,27	1,89	1,46
CD BELFIUS BK 1022	USD	9 995 932,99	1,89	1,46
COFACE NCP11102022	USD	9 991 344,61	1,89	1,46
CD GOLDMAN S 1022	USD	9 990 263,99	1,89	1,46
BFCM ECP12102022	USD	9 990 111,79	1,89	1,46
VOLKSB NCP18102022	USD	9 983 660,91	1,89	1,46
ECP MACQUARIE 22	USD	9 974 673,64	1,89	1,46
CD MIZUHO BK 1122	USD	9 961 616,95	1,88	1,46
ECP NTT FL. UK1122	USD	9 957 951,22	1,88	1,46
ECP LLY.CO.MA.22	USD	9 948 162,69	1,88	1,45
ECP VERIZON COM.22	USD	9 931 526,27	1,88	1,45
ECP AT T INC 1222	USD	9 905 518,12	1,87	1,45
ECP THE TORONTO 23	USD	9 893 375,52	1,87	1,45
COOP.RAB. N 3,95%2	USD	9 140 541,35	1,73	1,34
BNPP 3,25%030323	USD	7 986 384,44	1,51	1,17
ECP FED.DES CAI.22	USD	7 479 546,20	1,41	1,09
ENI 4%120923	USD	7 431 766,67	1,41	1,09
ABBVIE 2,3%211122	USD	7 041 926,11	1,33	1,03
BARCLAYS BANK TV22	USD	5 018 837,46	0,95	0,73
CS AG LDN TV301222	USD	3 967 296,67	0,75	0,58
ECD MIZUHO BANK 22	USD	3 493 077,18	0,66	0,51
BNPAI TV0423	USD	3 254 886,64	0,62	0,48
ABBVIE 2022	USD	3 199 908,65	0,60	0,47
ZF EU FIN 2,05%22	USD	3 016 894,17	0,57	0,44
CS AG LDN TV301222	USD	2 598 342,15	0,49	0,38
LLOYDS BA 4,05%23	USD	2 494 862,50	0,47	0,36
BANCO SAB 3,125%23	USD	1 993 670,83	0,38	0,29
ABBVIE TV211122	USD	1 505 841,05	0,28	0,22
UNICREDIT TV310523	USD	1 481 057,20	0,28	0,22
BFCM 2,125%211122	USD	1 366 980,92	0,26	0,20
BFCM 1,9%28 EMTN	USD	1 081 318,61	0,20	0,16
BK MONTREAL 19/22	USD	1 032 132,58	0,20	0,15
IBM 2,875%091122	USD	1 011 459,72	0,19	0,15
INTESA SA 3,375%23	USD	1 002 661,00	0,19	0,15
GENERAL ELE 2,7%22	USD	588 364,18	0,11	0,09
NATIONWIDE B 2%23	USD	522 914,00	0,10	0,08
TORONTO D 0,25%23	USD	495 638,61	0,09	0,07
BK OF NO 2,375%23	USD	434 074,62	0,08	0,06
SWISS RE 2,875%22	USD	324 330,50	0,06	0,05

Títulos	Divisa	Importe (EUR)	Porcentaje	
			Patrimonio neto	Total de activos
ENGIE 2,875%-22	USD	101 317,61	0,02	0,01
TOTAL	USD	277 932 919,70	52,54	40,63
ENDESA 0%261022	EUR	12 242 211,82	2,32	1,80
ECP AMCOR 311022	EUR	11 749 889,74	2,22	1,72
SAVENC NCP24102022	EUR	10 774 712,47	2,04	1,58
PRFIN.NCP 06102022	EUR	9 799 192,48	1,85	1,43
ECP ENEL ZC 121022	EUR	9 797 564,38	1,85	1,43
AXEREA NCP31102022	EUR	8 812 989,99	1,67	1,29
ECP ESSITY AB 1222	EUR	7 823 576,66	1,48	1,14
BEL NCP05102022	EUR	7 349 520,59	1,39	1,07
FINAGA NCP09112022	EUR	7 342 098,31	1,39	1,07
ECP HEIDELBER.1222	EUR	7 330 004,72	1,39	1,07
F.MARC NCP07102022	EUR	5 879 494,81	1,11	0,86
ROQUET NCP07112022	EUR	4 895 641,40	0,93	0,72
ROQUET NCP07122022	EUR	4 889 551,29	0,92	0,71
ECP SCANIA ZC 22	EUR	4 889 292,06	0,92	0,71
ECP COFI 101122	EUR	2 446 982,73	0,46	0,36
SAVENC NCP07102022	EUR	1 959 810,69	0,37	0,29
TOTAL	EUR	117 982 534,14	22,31	17,25
ECP BMW ZC 22	GBP	13 301 965,08	2,51	1,95
BARCLAYS TV061023	GBP	7 121 989,37	1,35	1,04
WESTPAC B 2,625%22	GBP	3 297 654,17	0,62	0,48
EDF 6,875%22	GBP	2 943 098,45	0,56	0,43
TOTAL	GBP	26 664 707,07	5,04	3,90
ECP SVENSKA VW1022	SEK	9 396 674,91	1,78	1,37
TOTAL	SEK	9 396 674,91	1,78	1,37
TOTAL		431 976 835,82	81,67	63,15

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
Bancos antiguo código ICB	26,07	20,17
Finanzas generales antiguo código ICB	9,89	7,64
Instrumentos de inversión distintos de las acciones antiguo código ICB	7,68	5,94
Electricidad antiguo código ICB	4,72	3,65
Alimentación antiguo código ICB	3,80	2,94
Industria general antiguo código ICB	2,33	1,80
Otros sectores económicos	15,63	12,08
TOTAL	70,12	54,22

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	20,36	15,73
REINO UNIDO	14,33	11,08
PAÍSES BAJOS	7,97	6,17
OTROS PAÍSES	33,96	26,26
TOTAL	76,62	59,24

DESGLOSE DE OTROS ACTIVOS POR TIPO

Tipo de activo	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
PARTICIPACIONES DE OIC	3,78	2,93
☐ OIC y fondos de inversión de tipo general (no profesionales)	3,78	2,93
☐ FCPR, FCPI, FIP abiertos a los inversores no profesionales	0,00	0,00
☐ Organismo de titularización	0,00	0,00
☐ OPCI y SCPI abiertos a inversores no profesionales	0,00	0,00
☐ SEF, SICAF y fondos de inversión alternativos	0,00	0,00
☐ Fondos profesionales de tipo general (abiertos a inversores profesionales)	0,00	0,00
☐ OPCI profesionales, fondos profesionales especializados y fondos profesionales de capital riesgo	0,00	0,00
☐ Otras inversiones colectivas	0,00	0,00
OTROS TIPOS DE ACTIVOS	0,00	0,00
☐ Bonos de suscripción	0,00	0,00
☐ Bonos de caja	0,00	0,00
☐ Pagarés	0,00	0,00
☐ Cédulas hipotecarias	0,00	0,00
☐ Otros	0,00	0,00
TOTAL	3,78	2,93

MOVIMIENTOS EN LA CARTERA DE VALORES DURANTE EL PERIODO

Movimientos registrados durante el periodo	Movimientos (en importe)
Adquisiciones	1 310 879 095,35
Cesiones	1 207 291 463,14

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.

DETALLE DE LA CARTERA DE VALORES

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Ctd. Número o nominal	Tipos de interés	Valor bursátil	% Patrimonio neto
TOTAL Obligaciones y valores similares						103 928 964,12	19,65
TOTAL Obligaciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar						103 928 964,12	19,65
TOTAL Obligaciones de tipo fijo negociadas en un mercado regulado o similar						91 575 840,67	17,31
TOTAL AUSTRALIA						3 297 654,17	0,62
XS1333068465 WESTPAC BANKING 2,625%15 1222	14/12/2015	14/12/2022	GBP	2910	2,625	3 297 654,17	0,62
TOTAL CANADÁ						13 537 993,70	2,56
US06367WRC90 BANK OF MONTREAL 2,05%19-1122	21/10/2019	01/11/2022	USD	1025	2,05	1 032 132,58	0,20
US064159QD10 BK OF NOVA SCOTIA 2,375%19-23	18/07/2019	18/01/2023	USD	434	2,375	434 074,62	0,08
US63307CAG69 NATL BK CANADA 2,15%19-071022	09/10/2019	07/10/2022	USD	11 458	2,15	11 576 147,89	2,19
US89114QCM87 TORONTO DOMINION BK 0,25%21-23	06/01/2021	06/01/2023	USD	500	0,25	495 638,61	0,09
TOTAL ESPAÑA						1 993 670,83	0,38
US05964HAE53 BANCO SANTANDER 3,125%17-0223	23/10/2017	23/02/2023	USD	10	3,125	1 993 670,83	0,38
TOTAL FRANCIA						13 479 100,03	2,55
FR0013215357 BPCE 1,9%16-281022 EMTN	28/10/2016	28/10/2022	USD	1075	1,90	1 081 318,61	0,20
US05574LFY92 BNPP 3,25%13-030323 MTN T.143	04/03/2013	03/03/2023	USD	8000	3,25	7 986 384,44	1,51
US06675FAS65 BFCM 2,125%19-211122	21/11/2019	21/11/2022	USD	1359	2,125	1 366 980,92	0,26
US36160BAA35 ENGIE 2,875%-101022 EMTN	10/10/2012	10/10/2022	USD	100	2,875	101 317,61	0,02
XS0403958498 EDF 6,875%08-121222	12/12/2008	12/12/2022	GBP	50	6,875	2 943 098,45	0,56
TOTAL REINO UNIDO						14 107 062,54	2,67
US539439AS89 LLOYDS BANK GRP 4,05%18-160823	16/08/2018	16/08/2023	USD	2500	4,05	2 494 862,50	0,47
US63859UBE29 NATIONWIDE BUILD 2%20 270123	27/01/2020	27/01/2023	USD	525	2,00	522 914,00	0,10
XS1396715465 CS AG LDN TV16-301222 0JHE	30/06/2016	30/12/2022	USD	3900	2,80	3 967 296,67	0,75
XS1695301900 BARCLAYS TV17-061023	06/10/2017	06/10/2023	GBP	6250		7 121 989,37	1,35
TOTAL ITALIA						8 434 427,67	1,59
US46115HBC07 INTESA SANPAOLO 3,375%18-0123	12/01/2018	12/01/2023	USD	1000	3,375	1 002 661,00	0,19
XS1826630425 ENI 4%18-120923	12/09/2018	12/09/2023	USD	7500	4,00	7 431 766,67	1,40
TOTAL LUXEMBURGO						3 016 894,17	0,57

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Ctd. Número o nominal	Tipos de interés	Valor bursátil	% Patrimonio neto
US23291KAF21 DH EU FIN II 2,05%19 151122	07/11/2019	15/11/2022	USD	3000	2,05	3 016 894,17	0,57
TOTAL PAÍSES BAJOS						9 140 541,35	1,73
US21685WDF14 COOP. RABOBK 3,95%12-091122 78	09/11/2012	09/11/2022	USD	9000	3,95	9 140 541,35	1,73
TOTAL ESTADOS UNIDOS						24 568 496,21	4,64
US00287YAL39 ABBVIE 2,9%13-061122	08/11/2012	06/11/2022	USD	3167	2,90	3 199 908,65	0,60
US00287YBM03 ABBVIE 2,3%20-211122	21/05/2020	21/11/2022	USD	7000	2,30	7 041 926,11	1,33
US00287YBP34 ABBVIE TV20-211122	21/08/2020	21/11/2022	USD	1500		1 505 841,05	0,28
US369604BD45 GENERAL ELECTRIC 2,7%12-1022	09/10/2012	09/10/2022	USD	581	2,70	588 364,18	0,11
US459200JC60 IBM 2,875%15 091122	09/11/2015	09/11/2022	USD	1000	2,875	1 011 459,72	0,19
US87089HAA14 SWISS RE TREASU US 2,875%12-22	06/12/2022	06/12/2022	USD	325	2,875	324 330,50	0,06
XS1308289146 GLDM SACHS GRP TV16-261122	26/05/2016	26/11/2022	USD	5350	2,20	10 896 666,00	2,07
TOTAL Obligaciones de tipo variable revisable negociadas en un mercado regulado o similar						7 334 285,99	1,39
TOTAL REINO UNIDO						2 598 342,15	0,49
XS1280098762 CS AG LDN TV15-301222	30/12/2015	30/12/2022	USD	2600		2 598 342,15	0,49
TOTAL ITALIA						1 481 057,20	0,28
IT0005185381 UNICREDIT TV16-310523 6/16	31/05/2016	31/05/2023	USD	744		1 481 057,20	0,28
TOTAL PAÍSES BAJOS						3 254 886,64	0,62
XS1218967377 BNP PARIBAS TV15-270423	27/04/2015	27/04/2023	USD	1644		3 254 886,64	0,62
TOTAL Obligaciones indexadas negociadas en un mercado regulado o similar						5 018 837,46	0,95
TOTAL REINO UNIDO						5 018 837,46	0,95
XS2019575914 BARCLAYS BANK TV19-011122	01/11/2019	01/11/2022	USD	5000		5 018 837,46	0,95
TOTAL Títulos de crédito						328 047 871,70	62,03
TOTAL Títulos de crédito negociados en un mercado regulado o similar						328 047 871,70	62,03
TOTAL Títulos de crédito negociables						328 047 871,70	62,03
US92344MM670 ECP VERIZON COM.22	28/09/2022	06/12/2022	USD	10 000 000		9 931 526,27	1,88
XS2510549087 ECD MIZUHO BANK 22	25/07/2022	25/10/2022	USD	3 500 000		3 493 077,18	0,66
XS2520969143 ECP BMW ZC 22	11/08/2022	25/11/2022	GBP	12 000 000		13 301 965,08	59,49
TOTAL AUSTRALIA						19 936 290,59	3,77
XS2487633021 ECP MACQUARIE 22	27/05/2022	27/10/2022	USD	10 000 000		9 974 673,64	1,89

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Ctd. Número o nominal	Tipos de interés	Valor bursátil	% Patrimonio neto
XS2521042320 CD MIZUHO BK 1122	11/08/2022	10/11/2022	USD	10 000 000		9 961 616,95	1,88
TOTAL BÉLGICA						24 417 561,46	4,62
BE6336558331 CD BELFIUS BK 1022	07/07/2022	07/10/2022	USD	10 000 000		9 995 932,99	1,89
BE6337194870 ECP COFI 101122	10/08/2022	10/11/2022	EUR	2 500 000		2 446 982,73	0,46
BE6338195215 EUROCL 0%22-1022	26/09/2022	26/10/2022	USD	12 000 000		11 974 645,74	2,27
TOTAL CANADÁ						17 372 921,72	3,28
XS2502039006 ECP THE TORONTO 23	11/07/2022	11/01/2023	USD	10 000 000		9 893 375,52	1,87
XS2532383994 ECP FED.DES CAL22	08/09/2022	03/11/2022	USD	7 500 000		7 479 546,20	1,41
TOTAL ALEMANIA						7 330 004,72	1,39
XS2532606618 ECP HEIDELBER.1222	09/09/2022	09/12/2022	EUR	7 500 000		7 330 004,72	1,39
TOTAL ESPAÑA						22 241 199,45	4,20
ES0530674789 ENDESA 0%261022	21/07/2022	26/10/2022	EUR	12 500 000		12 242 211,82	2,31
XS2537090065 ECP INSTIT.CRED.22	20/09/2022	04/10/2022	USD	10 000 000		9 998 987,63	1,89
TOTAL FRANCIA						94 180 164,36	22,87
FR0127150367 ROQUET NCP07122022	03/12/2021	07/12/2022	EUR	5 000 000		4 889 551,29	0,92
FR0127339937 BEL NCP05102022	01/04/2022	05/10/2022	EUR	7 500 000		7 349 520,59	1,39
FR0127433771 F.MARC NCP07102022	05/07/2022	07/10/2022	EUR	6 000 000		5 879 494,81	1,11
FR0127436691 PRFIN.NCP 06102022	03/06/2022	06/10/2022	EUR	10 000 000		9 799 192,48	1,85
FR0127486043 SAVENC NCP07102022	05/07/2022	07/10/2022	EUR	2 000 000		1 959 810,69	0,37
FR0127487819 ROQUET NCP07112022	03/08/2022	07/11/2022	EUR	5 000 000		4 895 641,40	0,93
FR0127490870 COFACE NCP11102022	11/07/2022	11/10/2022	USD	10 000 000		9 991 344,61	1,89
FR0127492363 BFCM ECP12102022	07/07/2022	12/10/2022	USD	10 000 000		9 990 111,79	1,89
FR0127543843 AXEREA NCP31102022	22/08/2022	31/10/2022	EUR	9 000 000		8 812 989,99	1,67
FR0127560532 FINAGA NCP09112022	05/08/2022	09/11/2022	EUR	7 500 000		7 342 098,31	1,39
FR0127591446 SAVENC NCP24102022	20/09/2022	24/10/2022	EUR	11 000 000		10 774 712,47	2,04
FR0127615724 BRED NCP07102022	30/09/2022	07/10/2022	USD	12 500 000		12 495 695,93	7,42
TOTAL REINO UNIDO						54 050 595,56	10,22
XS2421402228 CD UBS LDN 091222	10/12/2021	09/12/2022	USD	12 500 000		12 404 327,92	2,35
XS2469844505 CD GOLDMAN S 1022	12/04/2022	12/10/2022	USD	10 000 000		9 990 263,99	1,89
XS2484355693 ECP LLY.CO.MA.22	19/05/2022	21/11/2022	USD	10 000 000		9 948 162,69	1,88

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Ctd. Número o nominal	Tipos de interés	Valor bursátil	% Patrimonio neto
XS2527785948 ECP AMCOR 311022	29/08/2022	31/10/2022	EUR	12 000 000		11 749 889,74	2,22
XS2534274936 ECP NTT FI. UK1122	13/09/2022	14/11/2022	USD	10 000 000		9 957 951,22	1,88
TOTAL PAÍSES BAJOS						29 777 503,56	5,63
FR0127504654 VOLKSB NCP18102022	18/07/2022	18/10/2022	USD	10 000 000		9 983 660,91	1,89
XS2501120096 ECP NATWEST M.1022	07/07/2022	07/10/2022	USD	10 000 000		9 996 278,27	1,89
XS2533019704 ECP ENEL ZC 121022	12/09/2022	12/10/2022	EUR	10 000 000		9 797 564,38	1,85
TOTAL SUECIA						22 109 543,63	4,18
BE6337609174 ECP SCANIA ZC 22	06/09/2022	06/12/2022	EUR	5 000 000		4 889 292,06	0,92
BE6337635435 ECP ESSITY AB 1222	07/09/2022	07/12/2022	EUR	8 000 000		7 823 576,66	1,48
XS2525255050 ECP SVENSKA VW1022	22/08/2022	24/10/2022	SEK	105 000 000		9 396 674,91	1,78
TOTAL ESTADOS UNIDOS						9 905 518,12	1,87
US0020A3MU18 ECP AT T INC 1222	26/09/2022	28/12/2022	USD	10 000 000		9 905 518,12	1,87
TOTAL Títulos de OIC						20 008 988,88	3,78
TOTAL OICVM y equivalentes de otros Estados miembros de la UE						20 008 988,88	3,78
TOTAL LUXEMBURGO						20 008 988,88	3,78
LU2009162558 AMUNDI CASH USD J2C C.			USD	19 462,861		20 008 988,88	3,78
TOTAL Contratos financieros						284 181,56	0,05
TOTAL Otros compromisos						284 181,56	0,05
TOTAL Swaps						284 181,56	0,05
T21002313801 SWTCMC120923ENI 4%12			USD	-7 500 000		284 181,56	0,05