

# **CM-AM GREEN BONDS**

**DOCUMENTO DE INFORMACIÓN SEMESTRAL A 30/09/2022**

## **FORMA JURÍDICA DEL OIC**

SICAV General

## **CLASIFICACIÓN**

Clasificación del BCE Fondo de obligaciones

## **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	50 774 652,07
b) Activos bancarios	3 462 890,48
c) Otros activos del OICVM	975 400,00
d) Total de activos del OICVM	55 212 942,55
e) Pasivo	-564 657,73
f) Valor de inventario neto	54 648 284,82

\* Importes certificados

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

<b>Participación</b>	<b>Tipo de participación</b>	<b>Patrimonio neto</b>	<b>Número de participaciones en circulación</b>	<b>Valor liquidativo</b>
C1 CM-AM GR.BDS RC 6D	De capitalización	3 920 237,53	46 141,702906	84,96
I1 CM-AM GR.BDS IC 3D	De capitalización	50 728 047,29	593,532	85 468,09

## 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	92,91	91,96
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	0,00	0,00

**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
BELGIUM 1,25%33	EUR	3 753 687,94	6,87	6,79
IRELAND 1,35%31	EUR	3 524 261,59	6,45	6,38
EUROPEAN U 0,4%37	EUR	3 282 489,65	6,01	5,95
NETHERLANDS 0,5%40	EUR	2 721 670,36	4,98	4,93
SPAIN 1%300742	EUR	2 605 552,88	4,77	4,72
OATEI 0,10%22-0738	EUR	1 995 942,55	3,65	3,61
RATP 0,875%250527	EUR	1 859 168,77	3,40	3,37
ALLIANDER 0,875%26	EUR	1 761 405,41	3,22	3,19
BFCM 1,125%22 EMTN	EUR	1 614 786,63	2,95	2,92
ICADE 1,5%130927	EUR	1 583 789,42	2,90	2,87
OAT 1,75%17-39	EUR	1 530 526,44	2,80	2,77
DEUTSCHE 0,75%24	EUR	1 420 026,57	2,60	2,57
ASIAN DEV 0,35%25	EUR	1 406 680,68	2,57	2,55
SSE 0,875%060925	EUR	1 395 406,85	2,55	2,53
SNCF RESEAU 1%31	EUR	1 383 733,92	2,53	2,51
NRW.BANK 0,5%27	EUR	1 340 876,51	2,45	2,43
TENNET 0,75%260625	EUR	1 330 160,71	2,43	2,41
KRED WIEDE 0,25%25	EUR	1 230 940,79	2,25	2,23
SFIL	EUR	1 195 234,11	2,19	2,16
FERR STAT 0,875%23	EUR	1 180 242,90	2,16	2,14
ILE-DE-F 0,675%36	EUR	1 071 415,27	1,96	1,94
CAIXABANK TV090229	EUR	1 030 960,55	1,89	1,87
SANTANDER 0,625%29	EUR	965 155,89	1,77	1,75
ICO 0%300426	EUR	946 818,00	1,73	1,71
SGP 1,125%221028	EUR	927 725,21	1,70	1,68
ADIF 0,95%300427	EUR	926 546,30	1,70	1,68
BFCM 0,25%290628	EUR	821 624,38	1,50	1,49
KRED WIEDE 0,05%24	EUR	773 883,18	1,42	1,40
SHB 0,375%030723	EUR	590 985,29	1,08	1,07
IBERDROL 32	EUR	581 376,56	1,06	1,05
AIR LIQU 0,375%31	EUR	546 458,93	1,00	0,99
ASML HLDG 2,25%32	EUR	546 378,08	1,00	0,99
E.ON SE 011032	EUR	495 263,52	0,91	0,90
ABN AMRO 0,5%29	EUR	466 638,41	0,85	0,85
SNCF RESEAU 1,875%34	EUR	445 493,77	0,82	0,81
BPCE TV28 EMTN	EUR	425 526,37	0,78	0,77
BFCM 0,1%081027	EUR	335 291,62	0,61	0,61
STORA EN 0,625%30	EUR	300 319,89	0,55	0,54
TENNET 1,75%040627	EUR	282 509,79	0,52	0,51
ORSTED 1,5%261129	EUR	177 696,38	0,33	0,32
<b>TOTAL</b>	<b>EUR</b>	<b>50 774 652,07</b>	<b>92,91</b>	<b>91,96</b>
<b>TOTAL</b>		<b>50 774 652,07</b>	<b>92,91</b>	<b>91,96</b>

**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
Soberanos	29,51	29,21
Bancos antiguo código ICB	16,49	16,32
Entidad no avalada por el Estado	8,71	8,62
Supranacional	8,58	8,49
Electricidad antiguo código ICB	5,83	5,77
Entidades avaladas por el Estado	5,40	5,35
Otros sectores económicos	18,39	18,20
<b>TOTAL</b>	<b>92,91</b>	<b>91,96</b>

**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	28,79	28,50
PAÍSES BAJOS	13,01	12,88
ESPAÑA	12,91	12,78
OTROS PAÍSES	38,20	37,80
<b>TOTAL</b>	<b>92,91</b>	<b>91,96</b>

## DESGLOSE DE OTROS ACTIVOS POR TIPO

Tipo de activo	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
<b>PARTICIPACIONES DE OIC</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<input type="checkbox"/> OIC y fondos de inversión de tipo general (no profesionales)	0,00	0,00
<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
<b>OTROS TIPOS DE ACTIVOS</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<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
<b>TOTAL</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>

## MOVIMIENTOS EN LA CARTERA DE VALORES DURANTE EL PERIODO

Movimientos registrados durante el periodo	Movimientos (en importe)
Adquisiciones	2 906 897,56
Cesiones	1 949 393,97

### 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 de o nominal interés	Tipos de interés	Valor bursátil	% Patrimonio neto
<b>TOTAL Obligaciones y valores similares</b>						<b>38 169 479,30</b>	<b>69,84</b>
<b>TOTAL Obligaciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar</b>						<b>38 169 479,30</b>	<b>69,84</b>
<b>TOTAL Obligaciones de tipo fijo negociadas en un mercado regulado o similar</b>						<b>35 748 010,38</b>	<b>65,41</b>
<b>TOTAL BÉLGICA</b>						<b>3 282 489,65</b>	<b>6,01</b>
EU000A3K4C42 EUROPEAN UNION 0,4%21-040237	19/10/2021	04/02/2037	EUR	4 700 000	0,40	3 282 489,65	6,01
<b>TOTAL ALEMANIA</b>						<b>5 260 990,57</b>	<b>9,63</b>
DE000GRN0016 DEUTSCHE KREDITBANK 0,75%17-24	26/09/2017	26/09/2024	EUR	15	0,75	1 420 026,57	2,60
DE000NWB0AE6 NRW.BANK 0,5%17-130927	13/09/2017	13/09/2027	EUR	1500	0,50	1 340 876,51	2,45
XS1414146669 KRED WIEDERAUFBAU 0,05%16-0524	20/05/2016	30/05/2024	EUR	800	0,05	773 883,18	1,42
XS1612940558 KRED WIEDERAUFBAU 0,25%17-0625	16/05/2017	30/06/2025	EUR	1300	0,25	1 230 940,79	2,25
XS2327420977 E.ON SE 011032	01/04/2021	01/10/2032	EUR	700	0,60	495 263,52	0,91
<b>TOTAL DINAMARCA</b>						<b>177 696,38</b>	<b>0,33</b>
XS1721760541 ORSTED 1,5%17-261129	24/11/2017	26/11/2029	EUR	200	1,50	177 696,38	0,33
<b>TOTAL ESPAÑA</b>						<b>4 450 857,30</b>	<b>8,14</b>
ES0200002048 ADIF 0,95%19-300427	25/04/2019	30/04/2027	EUR	10	0,95	926 546,30	1,70
XS2250026734 ICO 0%20-300426	28/10/2020	30/04/2026	EUR	1035		946 818,00	1,73
XS2297549391 CAIXABANK TV21-090229	09/02/2021	09/02/2029	EUR	13		1 030 960,55	1,88
XS2357417257 SANTANDER 0,625%29	24/06/2021	24/06/2029	EUR	12		965 155,89	1,77
XS2455983861 IBERDROLA FINANZAS 32	11/03/2022	11/03/2032	EUR	7	1,375	581 376,56	1,06
<b>TOTAL FINLANDIA</b>						<b>300 319,89</b>	<b>0,55</b>
XS2265360359 STORA ENSO 0,625%20-021230	02/12/2020	02/12/2030	EUR	400	0,625	300 319,89	0,55
<b>TOTAL FRANCIA</b>						<b>13 315 248,47</b>	<b>24,36</b>
FR0013067170 BPCE 1,125%15-141222 EMTN	14/12/2015	14/12/2022	EUR	16	1,125	1 614 786,63	2,95
FR0013234333 OAT 1,75%17-25062039	31/01/2017	25/06/2039	EUR	1 800 000	1,75	1 530 526,44	2,80
FR0013264488 RATP 0,875%17-250527	29/06/2017	25/05/2027	EUR	20	0,875	1 859 168,77	3,40
FR0013281755 ICADE 1,5%17-130927	13/09/2017	13/09/2027	EUR	18	1,50	1 583 789,42	2,90

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Ctd. Número o nominal	Tipos de interés	Valor bursátil	% Patrimonio neto
FR0013372299 SGP 1,125%18-221028	22/10/2018	22/10/2028	EUR	10	1,125	927 725,21	1,70
FR00140003P3 BFCM 0,1%20-081027	08/10/2020	08/10/2027	EUR	4	0,10	335 291,62	0,61
FR0014003N69 AIR LIQUIDE FINANC 0,375%21-31	27/05/2021	27/05/2031	EUR	7	0,375	546 458,93	1,00
FR0014004750 BFCM 0,25%290628	29/06/2021	29/06/2028	EUR	10	0,25	821 624,38	1,50
FR0014006PN2 ILE-DE-FR MOBIL 0,675%21-1136	24/11/2021	24/11/2036	EUR	15	0,675	1 071 415,27	1,96
FR0014006V25 SFIL	01/12/2021	01/12/2031	EUR	15	0,25	1 195 234,11	2,19
XS1514051694 SNCF RESEAU 1%16-091131	09/11/2016	09/11/2031	EUR	16	1,00	1 383 733,92	2,53
XS1588061777 SNCF RESEAU 1,875%17-300334	30/03/2017	30/03/2034	EUR	5	1,875	445 493,77	0,82
<b>TOTAL REINO UNIDO</b>						<b>1 395 406,85</b>	<b>2,55</b>
XS1676952481 SSE 0,875%17-060925	06/09/2017	06/09/2025	EUR	1500	0,875	1 395 406,85	2,55
<b>TOTAL ITALIA</b>						<b>1 180 242,90</b>	<b>2,16</b>
XS1732400319 FERR STATO IT 0,875%17-071223	07/12/2017	07/12/2023	EUR	1200	0,875	1 180 242,90	2,16
<b>TOTAL PAÍSES BAJOS</b>						<b>4 387 092,40</b>	<b>8,03</b>
XS1241581096 TENNET 1,75%15-040627	04/06/2015	04/06/2027	EUR	300	1,75	282 509,79	0,52
XS1400167133 ALLIANDER 0,875%16-220426 MTN	22/04/2016	22/04/2026	EUR	19	0,875	1 761 405,41	3,23
XS1632897762 TENNET 0,75%17-260625	26/06/2017	26/06/2025	EUR	1400	0,75	1 330 160,71	2,43
XS2389343380 ABN AMRO 0,5%21-230929	23/09/2021	23/09/2029	EUR	6	0,50	466 638,41	0,85
XS2473687106 ASML HLDG 2,25%22-170532	17/05/2022	17/05/2032	EUR	600	2,25	546 378,08	1,00
<b>TOTAL FILIPINAS</b>						<b>1 406 680,68</b>	<b>2,57</b>
XS1854893291 ASIAN DEVELOP BANK 0,35%18-25	16/07/2018	16/07/2025	EUR	1500	0,35	1 406 680,68	2,57
<b>TOTAL SUECIA</b>						<b>590 985,29</b>	<b>1,08</b>
XS1848875172 SHB 0,375%18-030723	03/07/2018	03/07/2023	EUR	600	0,375	590 985,29	1,08
<b>TOTAL Obligaciones indexadas negociadas en un mercado regulado o similar</b>						<b>2 421 468,92</b>	<b>4,43</b>
<b>TOTAL FRANCIA</b>						<b>2 421 468,92</b>	<b>4,43</b>
FR0014007LL3 BPCE TV22-140128 EMTN	14/01/2022	14/01/2028	EUR	5		425 526,37	0,78
FR001400AQH0 OATEI 0,10%22-250738 INDX	25/05/2022	25/07/2038	EUR	2 000 000	0,10	1 995 942,55	3,65
<b>TOTAL Títulos de crédito</b>						<b>12 605 172,77</b>	<b>23,07</b>
<b>TOTAL Títulos de crédito negociados en un mercado regulado o similar</b>						<b>12 605 172,77</b>	<b>23,07</b>
<b>TOTAL Títulos de crédito negociables</b>						<b>12 605 172,77</b>	<b>23,07</b>

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Ctd. Número o nominal	Tipos de interés	Valor bursátil	% Patrimonio neto
<b>TOTAL BÉLGICA</b>						<b>3 753 687,94</b>	<b>6,87</b>
BE0000346552 BELGIUM 1,25%18-220433	05/03/2018	22/04/2033	EUR	430 000 000	1,25	3 753 687,94	6,87
<b>TOTAL ESPAÑA</b>						<b>2 605 552,88</b>	<b>4,77</b>
ES0000012J07 SPAIN 1%21-300742	14/09/2021	30/07/2042	EUR	4000	1,00	2 605 552,88	4,77
<b>TOTAL IRLANDA</b>						<b>3 524 261,59</b>	<b>6,45</b>
IE00BFZRQ242 IRELAND 1,35%18-180331	17/10/2018	18/03/2031	EUR	380 000 000	1,35	3 524 261,59	6,45
<b>TOTAL PAÍSES BAJOS</b>						<b>2 721 670,36</b>	<b>4,98</b>
NL0013552060 NETHERLANDS 0,5%19-150140	23/05/2019	15/01/2040	EUR	3 800 000	0,50	2 721 670,36	4,98
<b>TOTAL Contratos financieros</b>						<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>TOTAL Contratos financieros con ajuste de márgenes</b>						<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>TOTAL Compromisos a plazo firme</b>						<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
FGBLZ2F00002 BUND-EUX 1222			EUR	-85		555 050,00	0,00
<b>TOTAL FRANCIA</b>						<b>-555 050,00</b>	<b>-1,02</b>
MARF.EUR ajuste de márgenes futuros			EUR	-555 050		-555 050,00	-1,02