

CM-AM CONVERTIBLES EURO

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

FORMA JURÍDICA DEL OIC

SICAV General

CLASIFICACIÓN

Clasificación del BCE Fondos mixtos (ex diversificados)

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	110 964 041,63
b) Activos bancarios	15 390 832,02
c) Otros activos del OICVM	14 434 507,22
d) Total de activos del OICVM	140 789 380,87
e) Pasivo	776 743,98
f) Valor de inventario neto	140 012 636,89

* 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
C2 CM-AM CO.E.IC 3DEC	De capitalización	43 514 122,27	4 760 242,50	9,14
C3 CM-AM CON.EU.RC 6D	De capitalización	77 327 015,49	5 518 950,890901	14,01
C4 CM-AM CO.EURO S3D	De capitalización	6 177 056,27	210 879,867	29,29
D1 CM-AM CO.EUR.RD 6D	De reparto	12 994 442,86	524 589,52	24,77

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	79,18	78,75
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	0,07	0,07
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	9,76	9,70

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
WORLDLINE 0%26 OCE	EUR	9 079 350,00	6,55	6,46
DEU POST 0,05%25CV	EUR	8 457 336,99	6,04	6,01
SCHNEIDER E.0%26CV	EUR	7 987 500,00	5,70	5,67
AMADEUS 1,5%25 CV	EUR	7 179 452,46	5,13	5,10
SAFRAN 0,875%27 OC	EUR	6 936 000,00	4,95	4,93
EDENRED 0%0628 CV	EUR	4 570 500,00	3,26	3,25
PRYSMIAN 0%020226	EUR	4 262 850,00	3,04	3,03
NEXI 0%24022028	EUR	3 811 320,00	2,72	2,71
CELLNEX T 0,5%28	EUR	3 740 986,30	2,67	2,66
TAG IM.0,625%26 CV	EUR	3 697 424,57	2,64	2,63
LEG IMMOBILIEN 28	EUR	3 559 106,09	2,54	2,53
EDF	EUR	3 210 300,00	2,29	2,28
FRA.BT BNT19102022	EUR	3 000 399,13	2,14	2,13
FRA.BT BNT05102022	EUR	3 000 123,91	2,14	2,13
FRA.BT BNT16112022	EUR	3 000 000,00	2,14	2,13
ACCOR 0,7%27 CV	EUR	2 229 520,00	1,59	1,58
ARC.OBL.0%23 OCC	EUR	2 105 640,00	1,50	1,50
NEXI 1,75%0427 CV	EUR	2 097 734,29	1,50	1,49
GAZTRANSPORT TECHN	EUR	1 801 470,00	1,29	1,28
LEG IMMOB.WLD.17/2	EUR	1 789 795,30	1,28	1,27
SOITEC 0%011025 CV	EUR	1 192 660,00	0,85	0,85
VOLTALIA 1%0125 CV	EUR	1 101 600,00	0,79	0,78
VEOLIA ENVIRON.	EUR	1 084 050,00	0,77	0,77
NEOEN 2,875% 0927	EUR	972 608,40	0,69	0,69
CB NEOEN 2% 0625	EUR	723 900,00	0,52	0,51
CELLNEX T 0,75%31	EUR	662 534,25	0,47	0,47
COINTREAU 0,125%26	EUR	591 634,00	0,42	0,42
CELLNEX TEL.15,%26	EUR	577 763,01	0,41	0,41
UBISOFT 0%24OCEANE	EUR	524 300,00	0,37	0,37
ELIS 2,25%29 CV	EUR	465 775,00	0,33	0,33
KERING	EUR	412 695,00	0,29	0,29
ADIDAS 0,05%23 CV	EUR	390 452,60	0,28	0,28
IBERDROLA	EUR	287 460,00	0,21	0,20
SAFRAN PROV.ECH.	EUR	282 030,00	0,20	0,20
SYMRISE	EUR	241 080,00	0,17	0,17
BE SEMICO 1 875 29	EUR	84 076,25	0,06	0,06
LVMH MOET VUITTON	EUR	61 040,00	0,04	0,04
ABENGOA 1,5%24 IDX	EUR	4875,91	0,00	0,00
ABENGOA CL.B	EUR	3165,83	0,00	0,00
ABENGOA 2 1,5%24	EUR	177,22	0,00	0,00
TOTAL	EUR	95 180 686,51	67,98	67,61
CARREF. 0%24 CV	USD	5 693 020,41	4,06	4,04
STMICRO.0%0827 CV	USD	4 844 081,63	3,46	3,44
CARREFOUR 0%23 CV	USD	1 576 816,33	1,13	1,12
MICHELIN 0%23 CV	USD	966 836,73	0,69	0,69

Títulos	Divisa	Importe (EUR)	Porcentaje	
			Patrimonio neto	Total de activos
QIAGEN 1%1124 CV	USD	646 418,37	0,46	0,46
QIAGEN 17122027	USD	532 163,27	0,38	0,38
ABBVIE 2,3%211122	USD	513 289,40	0,37	0,36
MICROSOFT	USD	95 061,22	0,07	0,07
TOTAL	USD	14 867 687,36	10,62	10,56
SIKA TV050625 CV	CHF	615 043,88	0,44	0,44
NESTLE NOM.	CHF	300 623,88	0,21	0,21
TOTAL	CHF	915 667,76	0,65	0,65
TOTAL		110 964 041,63	79,25	78,82

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
Servicios de apoyo a las empresas antiguo código ICB	14,30	14,22
Electrónica y equipos eléctricos antiguo código ICB	8,75	8,70
Inv. inmobiliaria y serv. antiguo código ICB	6,46	6,43
Soberanos	6,43	6,39
Transporte industrial antiguo código ICB	6,04	6,01
Software y servicios informáticos antiguo código ICB	5,20	5,17
Otros sectores económicos	32,07	31,90
TOTAL	79,25	78,82

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	44,70	44,45
ALEMANIA	12,95	12,88
ESPAÑA	8,90	8,85
OTROS PAÍSES	12,70	12,64
TOTAL	79,25	78,82

DESGLOSE DE OTROS ACTIVOS POR TIPO

Tipo de activo	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
PARTICIPACIONES DE OIC	9,76	9,70
☐ OIC y fondos de inversión de tipo general (no profesionales)	9,76	9,70
☐ 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	9,76	9,70

MOVIMIENTOS EN LA CARTERA DE VALORES DURANTE EL PERIODO

Movimientos registrados durante el periodo	Movimientos (en importe)
Adquisiciones	133 272 554,48
Cesiones	135 875 761,93

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 Acciones y valores similares						7 778 975,93	5,56
TOTAL Acciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar						7 778 975,93	5,56
TOTAL Acciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar (salvo warrants y bonos de sus.)						7 778 975,93	5,56
TOTAL SUIZA						300 623,88	0,21
CH0038863350 NESTLE NOM.			CHF	2700		300 623,88	0,21
TOTAL ALEMANIA						241 080,00	0,17
DE000SYM9999 SYMRISE			EUR	2400		241 080,00	0,17
TOTAL ESPAÑA						290 625,83	0,21
ES0105200002 ABENGOA CL.B			EUR	487 051		3165,83	0,00
ES0144580Y14 IBERDROLA			EUR	30 000		287 460,00	0,21
TOTAL FRANCIA						6 851 585,00	4,90
FR0000073272 SAFRAN PROV.ECHANGE			EUR	3000		282 030,00	0,20
FR0000121014 LVMH MOET HENNESSY VUITTON			EUR	100		61 040,00	0,04
FR0000121485 KERING			EUR	900		412 695,00	0,29
FR0000124141 VEOLIA ENVIRONNEMENT			EUR	55 000		1 084 050,00	0,77
FR0010242511 EDF			EUR	270 000		3 210 300,00	2,31
FR0011726835 GAZTRANSPORT TECHNIGAZ			EUR	15 900		1 801 470,00	1,29
TOTAL ESTADOS UNIDOS						95 061,22	0,07
US5949181045 MICROSOFT			USD	400		95 061,22	0,07
TOTAL Obligaciones y valores similares						94 184 542,66	67,26
TOTAL Obligaciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar						94 184 542,66	67,26
TOTAL Obligaciones de tipo fijo negociadas en un mercado regulado o similar						513 289,40	0,37
TOTAL ESTADOS UNIDOS						513 289,40	0,37
US00287YBM03 ABBVIE 2,3%20-211122	21/05/2020	21/11/2022	USD	500	2,30	513 289,40	0,37
TOTAL Obligaciones convertibles negociadas en un mercado regulado o similar						93 666 377,35	66,89

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Ctd. Número o nominal	Tipos de interés	Valor bursátil	% Patrimonio neto
TOTAL SUIZA						615 043,88	0,44
CH0413990240 SIKA TV18-050625 CV	05/06/2018	05/06/2025	CHF	25	0,15	615 043,88	0,44
TOTAL ALEMANIA						17 894 115,55	12,78
DE000A289T23 LEG IMMOBILIEN AG 0,4% 300628	24/06/2020	30/06/2028	EUR	48	0,40	3 559 106,09	2,54
DE000A2G87D4 DEUTSCH POST 0,05%217-300625CV	13/12/2017	30/06/2025	EUR	90	0,05	8 457 336,99	6,04
DE000A2GSDH2 LEG IMMOB.0,875%17-010925 CV	01/09/2017	01/09/2025	EUR	20	0,875	1 789 795,30	1,28
DE000A2LQRW5 ADIDAS 0,05%18-120923 CONV.	12/09/2018	12/09/2023	EUR	2	0,05	390 452,60	0,28
DE000A3E46Y9 TAG IMMOBIL.0,625%20-0826 CV	27/08/2020	27/08/2026	EUR	50	0,625	3 697 424,57	2,64
TOTAL ESPAÑA						12 160 913,24	8,69
XS1750026186 CELLNEX TELECOM 1,5%16-26 CV	16/01/2018	16/01/2026	EUR	5	1,50	577 763,01	0,41
XS1978209002 ABENGOA 2 1,5%19-261024	26/04/2019	26/10/2024	EUR	165 622		177,22	0,00
XS2021212332 CELLNEX TELECOM 0,5%19-0728 CV	05/07/2019	05/07/2028	EUR	40	0,50	3 740 986,30	2,67
XS2154448059 AMADEUS IT GRP 1,5%20-0425 CV	09/04/2020	09/04/2025	EUR	65	1,50	7 179 452,46	5,14
XS2257580857 CELLNEX 0,75%20-201131 CV	20/11/2020	20/11/2031	EUR	10	0,75	662 534,25	0,47
TOTAL FRANCIA						46 717 660,87	33,36
FR0013200995 COINTREAU 0,125%16-26 OCEANE	07/09/2016	07/09/2026	EUR	3400	0,125	591 634,00	0,42
FR0013261062 CARREFOUR 0%17-140623 CONV	14/06/2017	14/06/2023	USD	8		1 576 816,33	1,13
FR0013284130 ARCHER OBL.0%17-310323 OCC	22/09/2017	31/03/2023	EUR	18		2 105 640,00	1,50
FR0013309184 MICHELIN 0%18-101123 CV	10/01/2018	10/11/2023	USD	5		966 836,73	0,69
FR0013326204 CARREFOUR 0%18-270324 CV	27/03/2018	27/03/2024	USD	30		5 693 020,41	4,07
FR0013439304 WORLDLINE 0%19-300726 OCEANE	30/07/2019	30/07/2026	EUR	105 000		9 079 350,00	6,50
FR0013448412 UBISOFT 0%19-240924 OCEANE	19/09/2019	24/09/2024	EUR	5000		524 300,00	0,37
FR0013513041 SAFRAN 0,875%20-150527 OCEANE	15/05/2020	15/05/2027	EUR	60 000	0,875	6 936 000,00	4,95
FR0013515707 CB NEOEN 2% 02062025	02/06/2020	02/06/2025	EUR	15 000	2,00	723 900,00	0,52
FR0013521085 ACCOR 0,7%20-071227 CV	30/11/2020	07/12/2027	EUR	58 000	0,70	2 229 520,00	1,59
FR0014000105 SOITEC 0%20-011025 CONV.REGS	01/10/2020	01/10/2025	EUR	7000		1 192 660,00	0,85
FR00140001X1 VOLTALIA 1%21-130125 CONV.	13/01/2021	13/01/2025	EUR	40 000	1,00	1 101 600,00	0,79
FR0014000OG2 SCHNEIDER ELECTR.0%20-150626CV	24/11/2020	15/06/2026	EUR	45 000		7 987 500,00	5,70
FR0014003YP6 EDENRED 0%21-140628 CONV.	14/06/2021	14/06/2028	EUR	75 000		4 570 500,00	3,26
FR001400AFJ9 ELIS 2,25%22-220929 OCEANE	22/09/2022	22/09/2029	EUR	5	2,25	465 775,00	0,33

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Ctd. Número o nominal	Tipos de interés	Valor bursátil	% Patrimonio neto
FR001400CMS2 NEOEN 2,875% 0927	08/09/2022	14/09/2027	EUR	10	2,875	972 608,40	0,69
TOTAL ITALIA						10 171 904,29	7,26
XS2161819722 NEXI 1,75%20-240427 CV	24/04/2020	24/04/2027	EUR	25	1,75	2 097 734,29	1,50
XS2294704007 PRYSMIAN 0%21-020226 CONV	02/02/2021	02/02/2026	EUR	45		4 262 850,00	3,04
XS2305842903 NEXI 0%24022028	24/02/2021	24/02/2028	EUR	54		3 811 320,00	2,72
TOTAL PAÍSES BAJOS						6 106 739,52	4,36
DE000A286LP0 QIAGEN 17122027	17/12/2020	17/12/2027	USD	3		532 163,27	0,38
XS1908221507 QIAGEN 1%18-131124 CONV.	13/11/2018	13/11/2024	USD	3	1,00	646 418,37	0,46
XS2211997239 STMICROELECT.0%20-040827 CO CO	04/08/2020	04/08/2027	USD	24		4 844 081,63	3,46
XS2465773070 BE SEMICONDUCTOR INDUS 1,87%060429	06/04/2022	06/04/2029	EUR	1	1,875	84 076,25	0,06
TOTAL Obligaciones indexadas negociadas en un mercado regulado o similar						4875,91	0,00
TOTAL ESPAÑA						4875,91	0,00
XS1978210273 ABENGOA ABEN.2 1,5%19-24 INDEX	26/04/2019	26/10/2024	EUR	165 622		4875,91	0,00
TOTAL Títulos de crédito						9 000 523,04	6,43
TOTAL Títulos de crédito negociados en un mercado regulado o similar						9 000 523,04	6,43
TOTAL Títulos de crédito negociables						9 000 523,04	6,43
TOTAL FRANCIA						9 000 523,04	6,43
FR0126893694 FRA.BT BNT05102022	22/09/2021	05/10/2022	EUR	3 000 000		3 000 123,91	2,14
FR0127176487 FRA.BT BNT19102022	22/03/2022	19/10/2022	EUR	3 000 000		3 000 399,13	2,14
FR0127176495 FRA.BT BNT16112022	22/03/2022	16/11/2022	EUR	3 000 000		3 000 000,00	2,15
TOTAL Títulos de OIC						13 662 353,77	9,76
TOTAL OICVM y equivalentes de otros Estados miembros de la UE						13 662 353,77	9,76
TOTAL FRANCIA						13 662 353,77	9,76
FR0000984254 CM-AM DOLLAR CASH IC SI.3DEC			USD	3258,554		6 336 125,26	4,53
FR0013336773 CM-AM HIGH YIELD 2024 (RC)			EUR	23 682,652		2 346 003,51	1,68
FR0013472461 CM-AM HIGH YIELD 2024 (IC)			EUR	24,863		2 384 847,03	1,70
FR0013507605 CM-AM OBLI SPREAD 2023 (S)			EUR	23 764,729		2 438 261,20	1,74
FR00140077F8 CM-AM CONVICTIONS USA (IC)			EUR	1,698		157 116,77	0,11
TOTAL Contratos financieros						0,00	0,00

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Ctd. Número o nominal	Tipos de interés	Valor bursátil	% Patrimonio neto
TOTAL Contratos financieros con ajuste de márgenes						0,00	0,00
TOTAL Compromisos a plazo firme						0,00	0,00
ECXXZ2F00002 EURUSD-CME 1222			USD	60		43 169,64	0,01
FESXZ2F00002 STX50E-EUX 1222			EUR	100		-8500,00	-0,01
TOTAL FRANCIA						-34 669,64	0,00
MARF.EUR ajuste de márgenes futuros			EUR	8500		8500,00	0,03
MARF.USD Ajustes de márgenes futuros			USD	-42 306,25		-43 169,64	-0,03