

# **CM-AM GREEN BONDS**

**HALBJÄHRLICHES INFORMATIONSBLETT ZUM 30.09.2022**

## **RECHTSFORM DES OGA**

Allgemeine SICAV

## **KLASSIFIZIERUNG**

Klassifizierung EZB-Anleihenfonds

## **ZUORDNUNG DER ERGEBNISSE**

Kapitalisierbares Ergebnis

## VERMÖGENSLAGE

Elemente der Vermögenslage	Betrag zum periodischen Abschlussdatum*
a) Zulässige Finanztitel, die in Nr.1 Absatz I Artikel R. 214-20 des frz. Währungs- und Finanzgesetzes genannt werden	50 774 652,07
b) Bankguthaben	3 462 890,48
c) Sonstige vom OGAW gehaltene Vermögenswerte	975 400,00
d) Summe der vom OGAW gehaltenen Vermögenswerte	55 212 942,55
e) Passiva	-564 657,73
f) Nettoinventarwert	54 648 284,82

\* Die Beträge werden unterzeichnet

**ANZAHL DER IM UMLAUF BEFINDLICHEN EINHEITEN UND  
NETTOINVENTARWERT JE ANTEIL ODER AKTIE**

<b>Anteil</b>	<b>Anteilsart</b>	<b>Nettovermögen</b>	<b>Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile</b>	<b>Liquidationswert</b>
C1 CM-AM GR. BDS RC 6D	Kapitalisierbar	3 920 237,53	46 141,702906	84,96
I1 CM-AM GR.BDS IC 3D	Kapitalisierbar	50 728 047,29	593,532	85 468,09

## ELEMENTE DES WERTPAPIERPORTFOLIOS

Elemente des Wertpapierportfolios:	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
a) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die zum Handel an einem regulierten Markt im Sinne von Artikel L. 422-1 zugelassen sind	92,91	91,96
b) Zulässige Finanzwertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zum Handel an einem anderen regulierten Markt zugelassen sind, sich im regulären Betrieb befinden, anerkannt und öffentlich zugänglich sind und ihren satzungsmäßigen Sitz in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Vertragsstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum haben.	0,00	0,00
c) Zugelassene Finanzwertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Drittlandsbörse zugelassen sind oder an einem anderen regulierten Drittlandsmarkt gehandelt werden, sich im regulären Betrieb befinden, anerkannt und öffentlich zugänglich sind, sofern die Börse oder der Markt nicht in einer von der Finanzmarktaufsichtsbehörde erstellten Liste aufgeführt ist oder die Wahl dieser Börse oder eines solchen Marktes von den Regelungen oder durch die Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist	0,00	0,00
d) Neu ausgegebene Finanztitel, die in Nr.4 Absatz I Artikel R. 214-11 des frz. Währungs- und Finanzgesetzes genannt werden	0,00	0,00
e) Sonstige Vermögenswerte	0,00	0,00

## AUFTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE VON A), B) UND F) VON ARTIKEL R.214-1-1 NACH WÄHRUNG

Wertpapiere	Währung	Betrag (EUR)	Prozentsatz	
			Nettovermögen	Gesamtvermögen
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
BPCE 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
APS 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>

**AUFTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE VON A), B) UND F) DES ARTIKELS R.214-1-1 NACH WIRTSCHAFTSSEKTOREN**

Wirtschaftssektor	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
Staatsanleihen	29,51	29,21
Banken alter ICB-Code	16,49	16,32
Nicht staatlich garantierte Entität	8,71	8,62
Supranational	8,58	8,49
Elektrizität alter ICB-Code	5,83	5,77
Staatlich garantierte Entität	5,40	5,35
Andere Wirtschaftssektoren	18,39	18,20
<b>TOTAL</b>	<b>92,91</b>	<b>91,96</b>

**AUFTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE VON A), B) UND F) DES ARTIKELS  
R.214-1-1 NACH WOHSITZLAND DES EMITTENTEN**

Land	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
FRANKREICH	28,79	28,50
NIEDERLANDE	13,01	12,88
SPANIEN	12,91	12,78
ANDERE LÄNDER	38,20	37,80
<b>TOTAL</b>	<b>92,91</b>	<b>91,96</b>

## AUFTEILUNG ANDERER VERMÖGENSWERTE NACH ART

Art der Vermögenswerte	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
<b>ANTEILE DES OGA</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<input type="checkbox"/> OGA und Allzweck-Investmentfonds (Nicht-Profis)	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> FCPR, FCPI, FIP offen für nicht-professionelle Anleger	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> Verbriefungsorganisation	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> OPCI, SCPI offen für nicht-professionelle Anleger	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> SEF, SICAF und Dach-Hedgefonds	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> Professionelle Mehrzweckfonds (offen für professionelle Anleger)	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> Professionelle OPCIs, spezialisierte professionelle Fonds und professionelle Kapitalanlagefonds	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> Andere kollektive Kapitalanlagen	0,00	0,00
<b>ANDERE ARTEN VON VERMÖGENSWERTEN</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<input type="checkbox"/> Zeichnungspreis	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> Kassenobligationen	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> Schuldscheine	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> Schuldverschreibungen	0,00	0,00
<input type="checkbox"/> Sonstige	0,00	0,00
<b>TOTAL</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>



## BEWEGUNGEN IM WERTPAPIERPORTFOLIO WÄHREND DES ZEITRAUMS

Bewegungen während des Zeitraums	Bewegungen (als Betrag)
Akquisitionen	2 906 897,56
Veräußerungen	1 949 393,97

### SFTR-Verordnung

Dieser OGA hat während des Berichtszeitraums nicht an Geschäften teilgenommen, die der EU-Verordnung 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung ("SFTR-Verordnung") unterliegen, und hat daher keine Informationen, die den Anlegern in diesem Zusammenhang mitgeteilt werden müssen.

## DETAILLIERTES WERTPAPIERPORTFOLIO

Bezeichnung der Werte	Emission	Fälligkeit	Währung	Menge Anzahl oder nominal	Wechselkurs	Börsen- wert	% Netto- vermögen
<b>TOTAL Anleihen und gleichwertige Wertpapiere</b>						<b>38 169 479,30</b>	<b>69,84</b>
<b>TOTAL Anleihen &amp; gleichwertige Werte gehandelt an einem regulierten oder gleichwertigen Markt</b>						<b>38 169 479,30</b>	<b>69,84</b>
<b>TOTAL Festverzinsliche Anleihen gehandelt an einem regulierten oder gleichwertigen Markt</b>						<b>35 748 010,38</b>	<b>65,41</b>
<b>TOTAL BELGIEN</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 DEUTSCHLAND</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	1 500	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	1.300	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 DÄNEMARK</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 SPANIEN</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	1 035		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 FINNLAND</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 FRANKREICH</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

Bezeichnung der Werte	Emission	Fälligkeit	Währung	Menge Anzahl oder nominal	Wechselkurs	Börsen- wert	% Netto- vermögen
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 VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>						<b>1 395 406,85</b>	<b>2,55</b>
XS1676952481 SSE 0,875%17-060925	06.09.2017	06.09.2025	EUR	1 500	0,875	1 395 406,85	2,55
<b>TOTAL ITALIEN</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	1 200	0,875	1 180 242,90	2,16
<b>TOTAL NIEDERLANDE</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	1 400	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 PHILIPPINEN</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	1 500	0,35	1 406 680,68	2,57
<b>TOTAL SCHWEDEN</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 Indexierte Anleihen, die an einem regulierten oder gleichwertigen Markt gehandelt werden</b>						<b>2 421 468,92</b>	<b>4,43</b>
<b>TOTAL FRANKREICH</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 Schuldverschreibungen</b>						<b>12 605 172,77</b>	<b>23,07</b>
<b>TOTAL An einem regulierten oder gleichwertigen Markt gehandelte Schuldtitel</b>						<b>12 605 172,77</b>	<b>23,07</b>

Bezeichnung der Werte	Emission	Fälligkeit	Währung	Menge Anzahl oder nominal	Wechselkurs	Börsen- wert	% Netto- vermögen
<b>TOTAL Handelbare Schuldtitel</b>						<b>12 605 172,77</b>	<b>23,07</b>
<b>TOTAL BELGIEN</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 SPANIEN</b>						<b>2 605 552,88</b>	<b>4,77</b>
ES0000012J07 SPAIN 1%21-300742	14.09.2021	30.07.2042	EUR	4 000	1,00	2 605 552,88	4,77
<b>TOTAL IRLAND</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 NIEDERLANDE</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 Finanzverträge</b>						<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>TOTAL Finanzkontrakte mit Margin Call</b>						<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>SUMME Feste Terminverpflichtungen</b>						<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
FGBLZ2F00002 BUND-EUX 1222			EUR	-85		555 050,00	0,00
<b>TOTAL FRANKREICH</b>						<b>-555 050,00</b>	<b>-1,02</b>
MARF.USD Future Margin Calls			EUR	-555 050		-555 050,00	-1,02

## Zusätzliche Informationen für Anleger in der Bundesrepublik Deutschland

### a) Zahl- und Informationsstelle in Deutschland

TARGOBANK AG Kasernenstraße 10 40213 Düsseldorf

b) Ausgabeanträge, Rücknahmegesuche und Konversionsanträge Anträge zur Ausgabe von Aktien, Rücknahmegesuche und, falls erforderlich, die mit dem Rücknahmegesuch einzureichenden Aktienzertifikate sowie Konversionsanträge für die in Deutschland vertriebsberechtigten Teilfonds können bei der Zahlstelle eingereicht werden.

c) Rücknahmemeerlöse, Ausschüttungen und sonstige etwaige Zahlungen an die Aktionäre Rücknahmemeerlöse, Ausschüttungen sowie sonstige etwaige Zahlungen an die Aktionäre können in der Bundesrepublik Deutschland über die oben genannte Zahlstelle auch in bar bezogen werden.

d) Informationen an die Aktionäre Der ausführliche Verkaufsprospekt, Die Ausgabe und Rücknahmepreise, die Wesentlichen Anlegerinformation bzw. Key Investor Information Document, die Satzung sowie die aktuellen Jahres- und Halbjahresberichte sind bei der TARGOBANK AG Kasernenstraße 10 40213 Düsseldorf kostenlos erhältlich. In der Bundesrepublik Deutschland werden die Ausgabe- und Rücknahmepreise der Investmentanteile in der „Börsen- Zeitung“ und etwaige sonstige Mitteilungen an die Anleger im elektronischen Bundesanzeiger veröffentlicht.