

CM-AM CASH

HALBJAHRESBERICHT ZUM 30.09.2021

RECHTSFORM DES OGA

Allgemeine SICAV

KLASSIFIZIERUNG

Geldmarkt

ERGEBNISVERWENDUNG

Thesaurierungs- und ausschüttungsfähige Erträge

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

Bestandteile der Vermögensaufstellung	Betrag zum Periodenende *
a) Zulässige Finanzwerte gemäß Artikel L. 214-20 Absatz I, Nr. 1 des Code monétaire et financier (französisches Währungs- und Finanzgesetzbuch)	8 140 051 968,27
b) Bankguthaben	1 341 261 281,93
c) Sonstige vom OGAW gehaltene Aktiva	599 538 685,45
d) Summe der vom OGAW gehaltenen Aktiva	10 080 851 935,65
e) Passiva	-24 742 088,90
f) Nettoinventarwert	10 056 109 846,75

* Die Beträge sind abgezeichnet

**ANZAHL DER IM UMLAUF BEFINDLICHEN ANTEILE UND
NETTOINVENTARWERT JE ANTEIL**

Anteilsklasse	Anteilsart	Nettovermögen	Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert
A1 CM AM C.RC FCP 3D	Thesaurierungsfähig	178 807 094,78	3 483,956	51 323,00
B1 CM AM CASH RC2 6D	Thesaurierungsfähig	177 842 511,62	17 964 977,415034	9,8994
C1 CM-AM CASH IC 3DEC	Thesaurierungsfähig	7 658 087 428,48	15 146,715	505 593,94
C3 CM-AM CASH ES 3DEC	Thesaurierungsfähig	2 023 805 027,28	20 476,305	98 836,43
D1 CM AM CASH ID 3D	Ausschüttungsfähig	17 567 784,59	36,216	485 083,51

ZUSAMMENSETZUNG DES WERTPAPIERPORTFOLIOS

Zusammensetzung des Wertpapierportfolios:	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Summe der Aktiva
a) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt im Sinne von Artikel L. 422-1 zum Handel zugelassen sind	80,95	80,75
b) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen regelmäßig operierenden, anerkannten und für die Öffentlichkeit zugänglichen geregelten Markt in einem Mitgliedsstaat der Europäischen Union oder einem anderen Mitgliedsstaat des Europäischen Wirtschaftsraums zum Handel zugelassen sind.	0,00	0,00
c) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer Börse in einem Drittland zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen regelmäßig operierenden, anerkannten und für die Öffentlichkeit zugänglichen geregelten Markt in einem Drittland gehandelt werden, sofern diese Börse bzw. dieser Markt nicht auf einer Liste der Autorité des Marchés Financiers geführt wird oder sofern die Wahl dieser Börse bzw. dieses Marktes gesetzlich oder im Reglement oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist	0,00	0,00
d) Neu begebene Wertpapiere im Sinne von Nr. 4 in Absatz I von Artikel R. 214-11 des Code Monétaire et Financier	0,00	0,00
e) Sonstige Aktiva	5,67	5,66

**VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE AUS DEN ABSÄTZEN A), B) UND F)
VON ARTIKEL R.214-1-1 NACH WÄHRUNG**

Wertpapiere	Währung	Betrag (EUR)	Prozentsatz	
			Nettovermögen	Summe der Aktiva
L.B.P. NCP25102021	EUR	300 100 509,66	2,92	2,88
BARCLA NCP08032022	EUR	200 298 687,96	1,99	1,99
EDF NCP25102021	EUR	200 063 821,69	1,99	1,98
EDF NCP01102021	EUR	199 500 000,00	1,98	1,98
BFCM 0,75%150623	EUR	167 641 053,18	1,67	1,66
CD NORDE.BK ABP 22	EUR	150 720 796,59	1,50	1,50
SG BMT02052022	EUR	150 331 484,43	1,49	1,49
BPCE PRE CPTE 0322	EUR	150 278 358,14	1,49	1,49
EDF NCP04012022	EUR	150 128 244,76	1,49	1,49
VEOLIA NCP23112021	EUR	150 093 839,96	1,49	1,49
SG ISSUER 21 IDX	EUR	149 983 110,00	1,49	1,49
SG BMT03052022	EUR	130 301 338,35	1,30	1,29
CD BC ZURICH 0222	EUR	130 184 935,22	1,29	1,29
CD STD CHART.B.23	EUR	120 731 662,04	1,20	1,20
CD GOLDMAN S.0122	EUR	120 103 392,21	1,19	1,19
HSBC BANK TV080323	EUR	101 403 561,10	1,01	1,01
CD STDARD CHAR.23	EUR	100 598 862,51	1,00	1,00
CD NATWEST 082022	EUR	100 304 240,82	1,00	1,00
CD LLOYDS BAN0722	EUR	100 287 938,91	1,00	0,99
CACF BMT10012022	EUR	100 090 299,72	1,00	0,99
BARCLA NCP31122021	EUR	100 085 511,95	1,00	0,99
VEOLIA NCP29112021	EUR	100 081 622,60	1,00	0,99
ECP SANTANDER 1221	EUR	100 062 261,24	1,00	0,99
CD CS AG 301121	EUR	100 051 753,44	0,99	0,99
BC ZURICH 111021	EUR	100 010 411,36	0,99	0,99
SGIS 1221	EUR	99 643 041,10	0,99	0,99
CD L.BK CO.MKTS 22	EUR	90 384 712,49	0,90	0,90
BARCLA NCP30062022	EUR	90 250 171,87	0,90	0,90
ENDESA 0%021121	EUR	90 031 065,92	0,90	0,89
CS AG LDN TV010923	EUR	81 356 264,40	0,81	0,81
ECP NATWEST 0522	EUR	80 215 206,26	0,80	0,80
NORDEA NCP21042022	EUR	80 165 952,12	0,80	0,80
CACF BMT11032022	EUR	80 125 931,77	0,80	0,79
JYSKE NCP15102021	EUR	79 797 753,07	0,79	0,79
LVMH TV110222	EUR	72 131 040,00	0,72	0,72
TOYOTA MOTOR 0923	EUR	70 403 900,00	0,70	0,70
ECP SANTANDER 0622	EUR	70 161 321,22	0,70	0,70
CL NCP20012022	EUR	70 082 078,26	0,70	0,70
CL NCP13012022	EUR	70 075 106,97	0,70	0,70
BFCM 0,5%161122	EUR	70 069 235,32	0,70	0,70
ENGIE NCP10012022	EUR	70 068 833,19	0,70	0,70
CL NCP12112021	EUR	70 027 713,12	0,70	0,69
CL NCP08102021	EUR	70 004 349,56	0,70	0,69
CD CS 28072022	EUR	69 687 290,40	0,69	0,69
CD NATWEST M.0323	EUR	60 371 161,70	0,60	0,60

Wertpapiere	Wahrung	Betrag (EUR)	Prozentsatz	
			Nettovermogen	Summe der Aktiva
CD NATWEST MARKE22	EUR	60 088 835,08	0,60	0,60
ANZ NEW Z 0,625%22	EUR	57 245 444,23	0,57	0,57
ABN AMRO 0,25%21	EUR	55 100 058,83	0,55	0,55
CO.RABOBK 4,75%22	EUR	54 646 120,21	0,54	0,54
UBS LONDO 0,125%21	EUR	54 634 578,37	0,54	0,54
ANZ BANKI 0,25%22	EUR	50 530 452,05	0,50	0,50
TOYOTA MOTOR TV23	EUR	50 477 480,55	0,50	0,50
CD STAND CHART0922	EUR	50 218 039,24	0,50	0,50
BPIFR NCP27052022	EUR	50 154 491,63	0,50	0,50
CD NATWEST M.0222	EUR	50 148 527,96	0,50	0,50
SANTANDER CON TV21	EUR	50 128 166,65	0,50	0,50
LBK HESSEN 0,1%21	EUR	50 099 363,00	0,50	0,50
UBS NCP17032022	EUR	50 090 859,73	0,50	0,50
CL NCP17032022	EUR	50 088 978,87	0,50	0,50
PALATI NCP15032022	EUR	50 086 644,26	0,50	0,50
DEUT PFANDBRF TV21	EUR	50 056 083,30	0,50	0,50
CFCMNO NCP14122021	EUR	50 044 476,53	0,50	0,50
ECP VW FIN 201221	EUR	50 021 997,45	0,50	0,50
BFCM BMT17012022	EUR	49 989 508,33	0,50	0,50
PALATI NCP21062022	EUR	49 887 055,97	0,50	0,49
PALATI NCP06052022	EUR	49 856 067,95	0,50	0,49
BPIFR NCP24012022	EUR	49 559 713,54	0,49	0,49
BK OF NOVA 0,25%22	EUR	49 530 356,60	0,49	0,49
VOLVO TREASUR TV21	EUR	44 537 100,63	0,44	0,44
BK OF NOV 0,375%22	EUR	43 782 249,45	0,44	0,43
WELLS FARGO 15/22	EUR	40 748 789,04	0,41	0,40
LANDESBK BAD.VAR22	EUR	40 328 758,80	0,40	0,40
ING 0,375%261121	EUR	40 185 375,32	0,40	0,40
FRANFI NCP13042022	EUR	40 080 886,64	0,40	0,40
BFCM BMT21022022	EUR	40 006 846,22	0,40	0,40
ENGIE NCP20122021	EUR	39 945 692,40	0,40	0,40
VOLKSWAGEN LE TV22	EUR	39 158 486,25	0,39	0,39
LANDESBANK VAR 22	EUR	35 328 035,05	0,35	0,35
COVIV NCP01102021	EUR	35 000 000,00	0,35	0,35
CITIGROUP 0,5%22	EUR	34 197 963,81	0,34	0,34
COMMERZBANK 0,5%21	EUR	33 192 792,30	0,33	0,33
UBS LONDON 0,25%22	EUR	33 099 929,01	0,33	0,33
BNP PARIBA 0,75%22	EUR	32 146 600,06	0,32	0,32
BBVA 17/22 MTN	EUR	31 366 432,74	0,31	0,31
SANTANDER CON TV21	EUR	30 069 807,48	0,30	0,30
BMW FINANCE TV22	EUR	30 056 400,00	0,30	0,30
CL NCP15022022	EUR	30 042 067,67	0,30	0,30
CACF NCP02022022	EUR	30 038 567,02	0,30	0,30
VOLVO TREASUR TV21	EUR	30 034 216,65	0,30	0,30
FRANFI NCP23122021	EUR	30 033 742,13	0,30	0,30
SCANIA CV AB TV21	EUR	30 021 900,00	0,30	0,30
CD BELFIUS BK 1021	EUR	30 009 302,62	0,30	0,30
NORMAN BMT25112022	EUR	29 988 115,50	0,30	0,30

Wertpapiere	Wahrung	Betrag (EUR)	Prozentsatz	
			Nettovermogen	Summe der Aktiva
CACF NCP06012022	EUR	29 529 362,75	0,29	0,29
ENGIE NCP29102021	EUR	28 008 160,55	0,28	0,28
FINAGA NCP30052022	EUR	27 435 596,32	0,27	0,27
MIZUHO INTL TV22	EUR	25 177 975,00	0,25	0,25
AT&T 0%010422	EUR	25 035 000,00	0,25	0,25
NORMAN BMT27042022	EUR	24 982 125,00	0,25	0,25
UBS NCP15032022	EUR	24 544 035,58	0,24	0,24
STIF NCP23032022	EUR	24 427 527,45	0,24	0,24
ALSTOM NCP22032022	EUR	24 043 206,07	0,24	0,24
VOLKSWAG 0,625%22	EUR	23 191 508,07	0,23	0,23
BK MONTREAL TV1021	EUR	23 012 931,11	0,23	0,23
SAP 0,25%100322	EUR	21 789 344,54	0,22	0,22
UBS GROUP 1,75%22	EUR	21 745 411,47	0,22	0,22
NATIONAL A 0,25%22	EUR	21 376 163,23	0,21	0,21
BNP PARIBAS 0,5%22	EUR	21 185 378,21	0,21	0,21
SOCIETE GE 0,75%23	EUR	20 938 281,57	0,21	0,21
TOYOTA MOTOR TV23	EUR	20 223 377,80	0,20	0,20
BMW FINAN 0,25%22	EUR	20 079 279,44	0,20	0,20
CREDIT M TV21 EMTN	EUR	20 018 563,88	0,20	0,20
COCA-COLA EUR TV21	EUR	20 013 000,00	0,20	0,20
COMMERZBANK TV21	EUR	20 012 473,04	0,20	0,20
COFACE NCP28012022	EUR	20 011 122,10	0,20	0,20
CD H.P.INTL BK 21	EUR	20 007 618,46	0,20	0,20
BFCM BMT02122021	EUR	19 977 917,56	0,20	0,20
JYSKE NCP01072022	EUR	19 955 755,38	0,20	0,20
BBVA 17/22 MTN	EUR	17 031 204,18	0,17	0,17
SEB NCP08112021	EUR	17 004 428,95	0,17	0,17
ABN AMRO 0,5%23	EUR	15 246 560,96	0,15	0,15
NATIONWIDE 0,75%21	EUR	15 118 111,64	0,15	0,15
VW INTL FINAN TV22	EUR	15 081 365,82	0,15	0,15
CD HEWLETT-PACK 21	EUR	15 006 375,08	0,15	0,15
SAGESS NCP05112021	EUR	15 006 058,32	0,15	0,15
CFCMMA BMT15112021	EUR	14 996 405,83	0,15	0,15
ALSTOM NCP02022022	EUR	14 017 492,74	0,14	0,14
LA POSTE 4,25%21	EUR	13 563 039,05	0,13	0,13
ALSTOM NCP08032022	EUR	13 019 350,05	0,13	0,13
BFCM BMT18022022	EUR	12 997 946,87	0,13	0,13
VONOVIA 0%010923	EUR	11 052 360,00	0,11	0,11
COLGATE-PALM 0%21	EUR	11 002 860,00	0,11	0,11
SOPRA NCP14012022	EUR	11 001 297,60	0,11	0,11
GOLDM.S.GRP 15/22	EUR	10 885 712,42	0,11	0,11
CO.RABOBK 4%22	EUR	10 475 099,02	0,10	0,10
BNP4,125%11-22EMTN	EUR	10 215 329,36	0,10	0,10
BNP PARIBAS TV22	EUR	10 078 977,77	0,10	0,10
VOLKSWAG FIN TV23	EUR	10 067 418,90	0,10	0,10
JOHNSON + JOHNSON	EUR	10 034 628,76	0,10	0,10
ICADE NCP09122021	EUR	10 006 820,51	0,10	0,10
PSA BA NCP16122021	EUR	10 006 004,44	0,10	0,10

Wertpapiere	Wahrung	Betrag (EUR)	Prozentsatz	
			Nettovermogen	Summe der Aktiva
FRANFI NCP15112021	EUR	10 005 700,25	0,10	0,10
COFACE NCP07102021	EUR	10 000 527,79	0,10	0,10
CD HEW PACK 1021	EUR	10 000 466,70	0,10	0,10
ALL.B. NCP02062022	EUR	9 966 218,62	0,10	0,10
JYSKE NCP08022022	EUR	9 966 156,93	0,10	0,10
ALL.B. BMT10032022	EUR	9 962 877,01	0,10	0,10
FRANFI NCP14012022	EUR	9 510 425,61	0,09	0,09
BFCM NCP29072022	EUR	9 480 285,27	0,09	0,09
ALSTOM NCP15122021	EUR	9 006 464,20	0,09	0,09
DE VOLKSBANK TV22	EUR	8 353 701,92	0,08	0,08
LLOYDS BANK CO0622	EUR	6 033 267,00	0,06	0,06
CITIGROUP 1,375%21	EUR	5 678 192,11	0,06	0,06
BARCLAYS 1,5%0422	EUR	5 491 581,04	0,05	0,05
VOLKSWAGEN LEASING	EUR	5 117 856,16	0,05	0,05
SANTANDER 0,875%22	EUR	5 051 545,89	0,05	0,05
CS AG LDN TV180522	EUR	5 030 988,89	0,05	0,05
CAT31 NCP08072022	EUR	5 013 948,19	0,05	0,05
CD C.SUISSE 080722	EUR	5 012 910,92	0,05	0,05
WELLS FARGO 17/22	EUR	5 008 050,00	0,05	0,05
ATOS S NCP31082022	EUR	5 005 812,32	0,05	0,05
MORGAN STANLE TV22	EUR	5 004 605,56	0,05	0,05
EDR.FR BMT10022023	EUR	5 000 979,56	0,05	0,05
PSA BA BMT28122022	EUR	5 000 005,08	0,05	0,05
ENGIE NCP01122021	EUR	4 982 224,28	0,05	0,05
ALL.B. NCP27042022	EUR	4 981 611,32	0,05	0,05
ALL.B. NCP19042022	EUR	4 981 312,78	0,05	0,05
ALL.B. NCP26102021	EUR	4 978 067,99	0,05	0,05
TOTAL 2,125%191121	EUR	4 086 516,16	0,04	0,04
SONEPA NCP16032022	EUR	4 006 147,93	0,04	0,04
HSBC HLDGS 1,5%22	EUR	2 542 670,21	0,03	0,03
EDR(FR BMT27092023	EUR	1 999 998,60	0,02	0,02
SUMME	EUR	8 120 470 262,84	80,76	80,56
CP VOLKSW.F.0122	SEK	19 581 705,43	0,19	0,19
SUMME	SEK	19 581 705,43	0,19	0,19
SUMME		8 140 051 968,27	80,95	80,75

**VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE AUS DEN ABSÄTZEN A), B) UND F)
VON ARTIKEL R.214-1-1 NACH WIRTSCHAFTSSEKTOR**

Wirtschaftssektor	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Summe der Aktiva
Banken alter ICB-Code	50,26	50,13
Elektrizität alter ICB-Code	6,36	6,35
Allgemeine Finanzen alter ICB-Code	4,95	4,94
Sonstige Anlageinstrumente als Aktien alter ICB-Code	4,62	4,60
Gas, Wasser und andere Versorger alter ICB-Code	3,91	3,90
Banken alter ICB-Code	2,98	2,98
Sonstige Wirtschaftssektoren	7,87	7,85
SUMME	80,95	80,75

**VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE AUS DEN ABSÄTZEN A), B) UND F)
VON ARTIKEL R.214-1-1 NACH LAND DES EMITTENTEN**

Land	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Summe der Aktiva
FRANKREICH	36,86	36,79
VEREINIGTES KÖNIGREICH	18,80	18,75
DEUTSCHLAND	4,87	4,86
ANDERE LÄNDER	20,42	20,35
SUMME	80,95	80,75

AUFSCHLÜSSELUNG DER SONSTIGEN AKTIVA NACH ART

Art der Aktiva	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Summe der Aktiva
OGA-ANTEILE	5,67	5,66
▪ OGA und Investmentfonds allgemeiner Ausrichtung (Privatanleger)	5,67	5,66
▪ FCPR, FCPI, FIP, die Privatanlegern offenstehen	0,00	0,00
▪ Verbriefungsvehikel	0,00	0,00
▪ OPCI, SCPI, die Privatanlegern offenstehen	0,00	0,00
▪ SEF, SICAF und alternative Dachfonds	0,00	0,00
▪ Professionelle Fonds allgemeiner Ausrichtung (die professionellen Anlegern offenstehen)	0,00	0,00
▪ Professionelle OPCI, spezialisierte professionelle Fonds und professionelle Kapitalanlagefonds	0,00	0,00
▪ Sonstige Kollektivanlagen	0,00	0,00
ANDERE ARTEN VON VERMÖGENSWERTEN	0,00	0,00
▪ Optionsscheine	0,00	0,00
▪ Kassenobligationen	0,00	0,00
▪ Solawechsel	0,00	0,00
▪ Hypothekenbriefe	0,00	0,00
▪ Sonstige	0,00	0,00
SUMME	5,67	5,66

VERÄNDERUNGEN IM WERTPAPIERPORTFOLIO IM BERICHTSZEITRAUM

Veränderungen während des Berichtszeitraums	Veränderung (Betrag)
Käufe	9 074 232 695,90
Verkäufe	9 154 887 761,53

AUSSCHÜTTUNGEN IM LAUFE DES BERICHTSZEITRAUMS

	Anteilsklasse	Betrag je Anteil in EUR			
		Anteil am Ergebnis	Anteil an den Nettogewinnen	Summe je Anteil	Steuer- gutschrift
Ausgeschüttete Dividenden					
	D1 PART DIST ID	0,00	0,00	0,00	0,00
Noch auszuschüttende Dividenden					
	D1 PART DIST ID	0,00	0,00	0,00	0,00

DETAILAUFSTELLUNG DES PORTFOLIOS

Bezeichnung der Wertpapiere	Emission	Fälligkeit	Währung	Menge	Zinssatz	Börsenwert	% des Nettovermögens
				Anz. oder Nennwert			
SUMME Anleihen und ähnliche Wertpapiere						2 424 384 475,66	24,11
SUMME Anleihen und ähnliche Wertpapiere, die auf einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelt werden						2 424 384 475,66	24,11
SUMME Auf einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelte festverzinsliche Anleihen						1 396 197 368,11	13,89
SUMME AUSTRALIEN						71 906 615,28	0,72
XS1586704378 NATIONAL AUS BK 0,25%17-280322	28.03.2017	28.03.2022	EUR	21 271	0,25	21 376 163,23	0,21
XS1916387431 ANZ BANKING GROUP 0,25%18-1122	29.11.2018	29.11.2022	EUR	50 000	0,25	50 530 452,05	0,51
SUMME KANADA						93 312 606,05	0,93
XS1592881020 BK OF NOVA SCOTIA 0,375%17-22	06.04.2017	06.04.2022	EUR	435	0,375	43 782 249,45	0,44
XS1799545758 BK OF NOVA SCOTIA 0,25%18-0922	28.03.2018	28.09.2022	EUR	49 160	0,25	49 530 356,60	0,49
SUMME SCHWEIZ						21 745 411,47	0,22
CH0302790123 UBS GROUP 1,75%15-161122	09.11.2015	16.11.2022	EUR	20 923	1,75	21 745 411,47	0,22
SUMME DEUTSCHLAND						144 443 224,07	1,44
DE000A2TSTD0 SAP 0,25%18-100322	10.12.2018	10.03.2022	EUR	217	0,25	21 789 344,54	0,22
DE000A3MP4S3 VONOVIA 0%21-010923	01.09.2021	01.09.2023	EUR	110		11 052 360,00	0,11
DE000CZ40NM2 COMMERZBANK 0,5%18-061221 920	04.12.2018	06.12.2021	EUR	330	0,50	33 192 792,30	0,33
XS1050917373 VOLKSWAGEN LEASING 2,125%14-22	04.04.2014	04.04.2022	EUR	5 000	2,125	5 117 856,16	0,05
XS1972547183 VOLKSWAG FIN SVCS 0,625%19-22	01.04.2019	01.04.2022	EUR	23 000	0,625	23 191 508,07	0,23
XS2092937650 LBK HESSEN-THUERING 0,1%19-21	13.12.2019	13.12.2021	EUR	500	0,10	50 099 363,00	0,50
SUMME SPANIEN						53 449 182,81	0,53
XS1548914800 BBVA 0,625%17-170122	17.01.2017	17.01.2022	EUR	169	0,625	17 031 204,18	0,17
XS1550951641 SANTANDER CONSUM F 0,875%17-22	24.01.2017	24.01.2022	EUR	50	0,875	5 051 545,89	0,05
XS1678372472 BBVA 0,75%17-110922	11.09.2017	11.09.2022	EUR	310	0,75	31 366 432,74	0,31
SUMME FRANKREICH						439 488 474,01	4,36
FR0010394437 LA POSTE 4,25%06-081121 EMTN	25.10.2006	08.11.2021	EUR	13 009	4,25	13 563 039,05	0,13
FR0013386539 BFCM 0,75%19-150623	15.01.2019	15.06.2023	EUR	1 641	0,75	167 641 053,18	1,66
XS0635033631 BNP 4,125%11-2022 EMTN	14.06.2011	14.01.2022	EUR	9 800	4,125	10 215 329,36	0,10

Bezeichnung der Wertpapiere	Emission	Fälligkeit	Währung	Menge Anz. oder Nennwert	Zinssatz	Börsen- wert	% des Nettovermögens
XS0994990280 TOTAL 2,125%13-191121 EMTN	19.11.2013	19.11.2021	EUR	40	2,125	4 086 516,16	0,04
XS1394103789 BNP PARIBAS 0,75%16-111122	12.04.2016	11.11.2022	EUR	31 500	0,75	32 146 600,06	0,32
XS1418786890 SOCIETE GENERA 0,75%16-260523	26.05.2016	26.05.2023	EUR	205	0,75	20 938 281,57	0,21
XS1527753187 BNP PARIBAS 0,5%16-010622	01.12.2016	01.06.2022	EUR	21 000	0,50	21 185 378,21	0,21
XS1856833543 BFCM 0,5%18-161122	16.07.2018	16.11.2022	EUR	690	0,50	70 069 235,32	0,70
XS2121087824 SGIS 1221	01.12.2020	01.12.2021	EUR	1 000		99 643 041,10	0,99
SUMME VEREINIGTES KÖNIGREICH						168 132 314,50	1,67
XS1116480697 BARCLAYS 1,5%14-010422	01.10.2014	01.04.2022	EUR	5 400	1,50	5 491 581,04	0,05
XS1130066175 NATIONWIDE BUILD 0,75%14-1021	29.10.2014	29.10.2021	EUR	15 000	0,75	15 118 111,64	0,15
XS1171526772 ANZ NEW ZEALAND 0,625%15-0122	27.01.2015	27.01.2022	EUR	56 800	0,625	57 245 444,23	0,57
XS1379182006 HSBC HLDGS 1,5%16-150322	15.03.2016	15.03.2022	EUR	2 500	1,50	2 542 670,21	0,03
XS1673620016 UBS LONDON 0,125%17-051121	05.09.2017	05.10.2021	EUR	54 572	0,125	54 634 578,37	0,54
XS1746107975 UBS LONDON 0,25%18-100122	10.01.2018	10.01.2022	EUR	32 992	0,25	33 099 929,01	0,33
SUMME NIEDERLANDE						266 136 393,78	2,65
XS0304159576 COOP.RABOBK 4,75%07-060622	06.06.2007	06.06.2022	EUR	52 005	4,75	54 646 120,21	0,54
XS0728812495 COOP.RABOBK 4%12-110122	11.01.2012	11.01.2022	EUR	10 060	4,00	10 475 099,02	0,10
XS1856791873 ABN AMRO 0,5%18-170723	17.07.2018	17.07.2023	EUR	15 000	0,50	15 246 560,96	0,15
XS1910245593 BMW FINANCE 0,25%140122	14.11.2018	14.01.2022	EUR	20 000	0,25	20 079 279,44	0,20
XS1914937021 ING 0,375%18-261121	26.11.2018	26.11.2021	EUR	400	0,375	40 185 375,32	0,40
XS1917577931 ABN AMRO 0,25%21	03.12.2018	03.12.2021	EUR	54 916	0,25	55 100 058,83	0,55
XS2391570178 EMTN_TOYOTA_MOTOR_FINANCE_29092023	29.09.2021	29.08.2023	EUR	700		70 403 900,00	0,71
SUMME VEREINIGTE USA						137 583 146,14	1,37
XS1128148845 CITIGROUP 1,375%14-271021	27.10.2014	27.10.2021	EUR	5 600	1,375	5 678 192,11	0,06
XS1173845436 GLDM SACHS GRP 1,375%15-0722	26.01.2015	26.07.2022	EUR	10 700	1,375	10 885 712,42	0,11
XS1288903278 WELLS FARGO 1,5%15-120922	10.09.2015	12.09.2022	EUR	40 000	1,50	40 748 789,04	0,40
XS1411535286 JOHNSON & JOHNSON 0,25%16-0122	20.05.2016	20.01.2022	EUR	10 000	0,25	10 034 628,76	0,10
XS1939355753 CITIGROUP 0,5%19-290122	29.01.2019	29.01.2022	EUR	34 000	0,50	34 197 963,81	0,34
XS2078405722 COLGATE-PALMOLIVE 0%19-121121	11.11.2019	12.11.2021	EUR	11 000		11 002 860,00	0,11
XS2310399535 AT&T 0%21-010422	03.03.2021	01.04.2022	EUR	25 000		25 035 000,00	0,25

Bezeichnung der Wertpapiere	Emission	Fälligkeit	Währung	Menge Anz. oder Nennwert	Zinssatz	Börsenwert	% des Nettovermögens
SUMME Auf einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelte variabel verzinsliche Anleihen						863 122 631,73	8,58
SUMME KANADA						23 012 931,11	0,23
XS2063363662 BK MONTREAL TV19-121021	11.10.2019	12.10.2021	EUR	23 000		23 012 931,11	0,23
SUMME DEUTSCHLAND						194 951 255,34	1,94
DE000A2YNVX5 DEUT PFANDBRFBK TV19-101221	12.12.2019	10.12.2021	EUR	500		50 056 083,30	0,50
DE000CZ45VE1 COMMERZBANK TV19-061221	06.12.2019	06.12.2021	EUR	200		20 012 473,04	0,20
DE000LB2CVJ2 LANDESBANK BADEN-WU VAR 131022	13.10.2020	13.10.2022	EUR	400		40 328 758,80	0,40
DE000LB2CVX3 LANDESBANK BADEN-WU VAR 261022	26.10.2020	26.10.2022	EUR	350		35 328 035,05	0,35
XS2258429815 VOLKSWAGEN LEASING TV20-161122	16.11.2020	16.11.2022	EUR	390		39 158 486,25	0,39
XS2328430470 VOLKSWAG FIN SVCS TV21-060423	06.04.2021	06.04.2023	EUR	100		10 067 418,90	0,10
SUMME SPANIEN						80 197 974,13	0,80
XS2077543317 SANTANDER CONSUM FI TV19-1121	08.11.2019	08.11.2021	EUR	500		50 128 166,65	0,50
XS2092614309 SANTANDER CONSUM FI TV19-1221	13.12.2019	13.12.2021	EUR	300		30 069 807,48	0,30
SUMME FRANKREICH						102 228 581,65	1,02
FR0013463742 CREDIT MUTUEL TV19-261121 EMTN	26.11.2019	26.11.2021	EUR	200		20 018 563,88	0,20
FR0013482809 LVMH TV20-110222	11.02.2020	11.02.2022	EUR	720		72 131 040,00	0,72
XS1584041252 BNP PARIBAS TV17-220922 18127	22.03.2017	22.09.2022	EUR	10 000		10 078 977,77	0,10
SUMME VEREINIGTES KÖNIGREICH						239 015 056,39	2,36
XS1717567587 COCA-COLA EUROPA. TV17-161121	16.11.2017	16.11.2021	EUR	20 000		20 013 000,00	0,20
XS2176687270 CS AG LDN TV20-180522	18.05.2020	18.05.2022	EUR	5 000		5 030 988,89	0,05
XS2189425981 LLOYDS BANK CO0622	15.06.2020	15.06.2022	EUR	60		6 033 267,00	0,06
XS2247624617 MIZUHO INTL TV20-211022	21.10.2020	21.10.2022	EUR	25 000		25 177 975,00	0,25
XS2310947259 HSBC BANK TV21-080323	08.03.2021	08.03.2023	EUR	1 000		101 403 561,10	0,99
XS2381633150 CS AG LDN TV21-010923	01.09.2021	01.09.2023	EUR	80 000		81 356 264,40	0,81
SUMME NIEDERLANDE						109 110 960,27	1,09
XS2122422921 BMW FINANCE TV180222 EMTN	19.02.2020	18.02.2022	EUR	300		30 056 400,00	0,30
XS2242176258 DE VOLKSBANK TV20-071022	07.10.2020	07.10.2022	EUR	83		8 353 701,92	0,08
XS2289104908 TOYOTA MOTOR FI TV21-190123	19.01.2021	19.01.2023	EUR	500		50 477 480,55	0,51
XS2381867907 TOYOTA MOTOR FI TV21-250823	27.08.2021	25.08.2023	EUR	200		20 223 377,80	0,20

Bezeichnung der Wertpapiere	Emission	Fälligkeit	Währung	Menge	Zinssatz	Börsenwert	% des Nettovermögens
				Anz. oder Nennwert			
SUMME SCHWEDEN						104 593 217,28	1,04
XS2075262233 VOLVO TREASURY TV19-011121	01.11.2019	01.11.2021	EUR	445		44 537 100,63	0,44
XS2091486683 SCANIA CV AB TV19-101221	10.12.2019	10.12.2021	EUR	30 000		30 021 900,00	0,30
XS2091664024 VOLVO TREASURY TV10122021 EMTN	10.12.2019	10.12.2021	EUR	30 000		30 034 216,65	0,30
SUMME VEREINIGTE USA						10 012 655,56	0,10
XS1558022866 WELLS FARGO TV17-310122	31.01.2017	31.01.2022	EUR	5 000		5 008 050,00	0,05
XS1603892065 MORGAN STANLEY TV17-081122	27.04.2017	08.11.2022	EUR	5 000		5 004 605,56	0,05
SUMME Auf einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelte indexierte Anleihen						165 064 475,82	1,64
SUMME LUXEMBURG						149 983 110,00	1,49
XS2121089879 SG ISSUER 20-251121 EONIA	25.11.2020	25.11.2021	EUR	1 500		149 983 110,00	1,49
SUMME NIEDERLANDE						15 081 365,82	0,15
XS2289829033 VW INTL FINANCE TV21-210722	21.01.2021	21.07.2022	EUR	150		15 081 365,82	0,15
SUMME Schuldtitel						5 715 667 492,61	56,84
SUMME Schuldtitel, die auf einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelt werden						5 715 667 492,61	56,84
SUMME übertragbare Schuldtitel						5 715 667 492,61	56,84
SUMME BELGIEN						30 009 302,62	0,30
BE6330676683 CD BELFIUS BK 1021	14.09.2021	29.10.2021	EUR	30 000 000		30 009 302,62	0,30
SUMME SCHWEIZ						230 195 346,58	2,29
CH0589643441 BC ZURICH 111021	09.04.2021	11.10.2021	EUR	100 000 000	-0,53	100 010 411,36	0,99
CH0589643680 CD BC ZURICH 0222	14.07.2021	14.02.2022	EUR	130 000 000		130 184 935,22	1,30
SUMME DEUTSCHLAND						150 084 258,69	1,49
XS2277009390 ECP VW FIN 201221	21.12.2020	20.12.2021	EUR	50.000.000		50 021 997,45	0,50
XS2361683282 ECP SANTANDER 1221	02.07.2021	30.12.2021	EUR	100 000 000		100 062 261,24	0,99
SUMME DÄNEMARK						109 719 665,38	1,09
FR0126704149 JYSKE NCP08022022	09.02.2021	08.02.2022	EUR	10 000 000	0,065	9 966 156,93	0,10
FR0126790767 JYSKE NCP15102021	15.04.2021	15.10.2021	EUR	80 000 000	0,04	79 797 753,07	0,79
FR0126895046 JYSKE NCP01072022	01.07.2021	01.07.2022	EUR	20 000 000	0,07	19 955 755,38	0,20
SUMME SPANIEN						160 192 387,14	1,59
ES0530670YU7 ENDESA 0%021121	01.07.2021	02.11.2021	EUR	90 000 000		90 031 065,92	0,89

Bezeichnung der Wertpapiere	Emission	Fälligkeit	Währung	Menge Anz. oder Nennwert	Zinssatz	Börsenwert	% des Nettovermögens
XS2354254083 ECP SANTANDER 0622	11.06.2021	10.06.2022	EUR	70 000 000		70 161 321,22	0,70
SUMME FINNLAND						80 165 952,12	0,80
FR0126815473 NORDEA NCP21042022	21.04.2021	21.04.2022	EUR	80 000 000		80 165 952,12	0,80
SUMME FRANKREICH						3 166 509 816,75	31,49
FR0125973026 CFCMMA BMT15112021	15.11.2019	15.11.2021	EUR	15 000 000	0,245	14 996 405,83	0,15
FR0125978397 BFCM BMT02122021	02.12.2019	02.12.2021	EUR	20 000 000	0,30	19 977 917,56	0,20
FR0126048026 BFCM BMT17012022	17.01.2020	17.01.2022	EUR	50.000.000	0,23	49 989 508,33	0,50
FR0126127960 BFCM BMT18022022	18.02.2020	18.02.2022	EUR	13 000 000	0,22	12 997 946,87	0,13
FR0126129735 BFCM BMT21022022	21.02.2020	21.02.2022	EUR	40 000 000	0,23	40 006 846,22	0,40
FR0126489147 CL NCP08102021	09.10.2020	08.10.2021	EUR	70 000 000		70 004 349,56	0,70
FR0126503459 NORMAN BMT27042022	27.10.2020	27.04.2022	EUR	25 000 000	0,16	24 982 125,00	0,25
FR0126503541 NORMAN BMT25112022	25.11.2020	25.11.2022	EUR	30 000 000	0,18	29 988 115,50	0,30
FR0126534074 VEOLIA NCP23112021	23.11.2020	23.11.2021	EUR	150 000 000		150 093 839,96	1,49
FR0126534280 VEOLIA NCP29112021	30.11.2020	29.11.2021	EUR	100 000 000		100 081 622,60	1,00
FR0126534884 EDF NCP04012022	05.01.2021	04.01.2022	EUR	150 000 000		150 128 244,76	1,49
FR0126534967 ENGIE NCP10012022	11.01.2021	10.01.2022	EUR	70 000 000		70 068 833,19	0,70
FR0126537283 ALL.B. NCP26102021	26.10.2020	26.10.2021	EUR	5 000 000	0,11	4 978 067,99	0,05
FR0126566019 CL NCP12112021	12.11.2020	12.11.2021	EUR	70 000 000		70 027 713,12	0,70
FR0126587445 SOPRA NCP14012022	13.01.2021	14.01.2022	EUR	11 000 000		11 001 297,60	0,11
FR0126589250 CACF BMT10012022	10.12.2020	10.01.2022	EUR	100 000 000		100 090 299,72	1,00
FR0126590530 PSA BA NCP16122021	15.12.2020	16.12.2021	EUR	10 000 000		10 006 004,44	0,10
FR0126638131 ALL.B. BMT10032022	11.01.2021	10.03.2022	EUR	10 000 000	0,09	9 962 877,01	0,10
FR0126638255 FRANFI NCP14012022	14.01.2021	14.01.2022	EUR	9 500 000		9 510 425,61	0,09
FR0126648627 CACF BMT11032022	12.01.2021	11.03.2022	EUR	80 000 000		80 125 931,77	0,80
FR0126654211 CL NCP13012022	14.01.2021	13.01.2022	EUR	70 000 000		70 075 106,97	0,70
FR0126654229 SG BMT03052022	12.01.2021	03.05.2022	EUR	130 000 000		130 301 338,35	1,30
FR0126682667 ENGIE NCP01122021	01.02.2021	01.12.2021	EUR	5 000 000	-0,015	4 982 224,28	0,05
FR0126687187 COFACE NCP28012022	26.01.2021	28.01.2022	EUR	20 000 000		20 011 122,10	0,20
FR0126703927 CL NCP15022022	16.02.2021	15.02.2022	EUR	30 000 000		30 042 067,67	0,30

Bezeichnung der Wertpapiere	Emission	Fälligkeit	Währung	Menge Anz. oder Nennwert	Zinssatz	Börsen- wert	% des Nettovermögens
FR0126704693 EDR.FR BMT10022023	10.02.2021	10.02.2023	EUR	5 000 000	0,53	5 000 979,56	0,05
FR0126707308 COVIV NCP01102021	30.03.2021	01.10.2021	EUR	35 000 000		35 000 000,00	0,35
FR0126780271 FRANFI NCP13042022	13.04.2021	13.04.2022	EUR	40 000 000		40 080 886,64	0,40
FR0126781030 CAT31 NCP08072022	07.07.2021	08.07.2022	EUR	5 000 000		5 013 948,19	0,05
FR0126794256 ALL.B. NCP19042022	19.04.2021	19.04.2022	EUR	5 000 000	0,05	4 981 312,78	0,05
FR0126815291 BPIFR NCP24012022	22.04.2021	24.01.2022	EUR	49 500 000		49 559 713,54	0,49
FR0126815598 BPCE PRE CPTE 0322	23.04.2021	31.03.2022	EUR	150 000 000		150 278 358,14	1,49
FR0126816091 ALL.B. NCP27042022	27.04.2021	27.04.2022	EUR	5 000 000	0,05	4 981 611,32	0,05
FR0126816620 SG BMT02052022	27.04.2021	02.05.2022	EUR	150 000 000		150 331 484,43	1,49
FR0126817040 SEB NCP08112021	06.05.2021	08.11.2021	EUR	17 000 000		17 004 428,95	0,17
FR0126824665 ENGIE NCP20122021	20.07.2021	20.12.2021	EUR	40 000 000	0,055	39 945 692,40	0,40
FR0126841602 PALATI NCP06052022	07.05.2021	06.05.2022	EUR	50.000.000	0,10	49 856 067,95	0,50
FR0126842337 L.B.P. NCP25102021	25.06.2021	25.10.2021	EUR	300 000 000		300 100 509,66	2,94
FR0126865627 ALL.B. NCP02062022	02.06.2021	02.06.2022	EUR	10 000 000	0,065	9 966 218,62	0,10
FR0126867318 ICADE NCP09122021	07.06.2021	09.12.2021	EUR	10 000 000		10 006 820,51	0,10
FR0126870627 PALATI NCP21062022	22.06.2021	21.06.2022	EUR	50.000.000	0,10	49 887 055,97	0,50
FR0126894239 PSA BA BMT28122022	28.06.2021	28.12.2022	EUR	5 000 000	0,20	5 000 005,08	0,05
FR0126895491 SAGESS NCP05112021	30.06.2021	05.11.2021	EUR	15 000 000		15 006 058,32	0,15
FR0126916180 CACF NCP06012022	06.07.2021	06.01.2022	EUR	29 500 000		29 529 362,75	0,29
FR0126919689 COFACE NCP07102021	06.07.2021	07.10.2021	EUR	10 000 000		10 000 527,79	0,10
FR0126921552 CL NCP20012022	20.07.2021	20.01.2022	EUR	70 000 000		70 082 078,26	0,70
FR0126956970 FINAGA NCP30052022	22.07.2021	30.05.2022	EUR	27 400 000		27 435 596,32	0,27
FR0126958430 BFCM NCP29072022	29.07.2021	29.07.2022	EUR	9 500 000	0,06	9 480 285,27	0,09
FR0126959164 ALSTOM NCP02022022	02.09.2021	02.02.2022	EUR	14 000 000		14 017 492,74	0,14
FR0126959339 ALSTOM NCP08032022	08.09.2021	08.03.2022	EUR	13 000 000		13 019 350,05	0,13
FR0126959487 ALSTOM NCP15122021	15.09.2021	15.12.2021	EUR	9 000 000		9 006 464,20	0,09
FR0126959602 ALSTOM NCP22032022	22.09.2021	22.03.2022	EUR	24 000 000		24 043 206,07	0,24
FR0126964669 ENGIE NCP29102021	30.07.2021	29.10.2021	EUR	28 000 000		28 008 160,55	0,28
FR0126965161 EDF NCP01102021	30.08.2021	01.10.2021	EUR	199 500 000		199 500 000,00	1,98

Bezeichnung der Wertpapiere	Emission	Fälligkeit	Währung	Menge	Zinssatz	Börsenwert	% des Nettovermögens
				Anz. oder Nennwert			
FR0126965773 EDF NCP25102021	24.09.2021	25.10.2021	EUR	200 000 000		200 063 821,69	1,99
FR0126969023 STIF NCP23032022	28.07.2021	23.03.2022	EUR	24 400 000		24 427 527,45	0,24
FR0126971599 CACF NCP02022022	02.08.2021	02.02.2022	EUR	30 000 000		30 038 567,02	0,30
FR0126988247 FRANFI NCP15112021	13.08.2021	15.11.2021	EUR	10 000 000		10 005 700,25	0,10
FR0127006577 ATOS S NCP31082022	27.08.2021	31.08.2022	EUR	5 000 000		5 005 812,32	0,05
FR0127009035 CL NCP17032022	17.09.2021	17.03.2022	EUR	50.000.000		50 088 978,87	0,50
FR0127010199 CFCMNO NCP14122021	14.09.2021	14.12.2021	EUR	50.000.000		50 044 476,53	0,50
FR0127010264 PALATI NCP15032022	15.09.2021	15.03.2022	EUR	50.000.000		50 086 644,26	0,50
FR0127010827 SONEPA NCP16032022	14.09.2021	16.03.2022	EUR	4 000 000		4 006 147,93	0,04
FR0127014209 FRANFI NCP23122021	23.09.2021	23.12.2021	EUR	30 000 000		30 033 742,13	0,30
FR0127014589 EDR(FR BMT27092023	27.09.2021	27.09.2023	EUR	2 000 000	0,48	1 999 998,60	0,02
FR0127035592 BPIFR NCP27052022	28.09.2021	27.05.2022	EUR	50.000.000		50 154 491,63	0,50
SUMME VEREINIGTES KÖNIGREICH						1 483 223 629,20	14,75
FR0126633280 UBS NCP17032022	18.03.2021	17.03.2022	EUR	50.000.000		50 090 859,73	0,50
FR0126727587 BARCLA NCP08032022	09.03.2021	08.03.2022	EUR	200 000 000		200 298 687,96	1,99
FR0126775248 UBS NCP15032022	15.04.2021	15.03.2022	EUR	24 500 000		24 544 035,58	0,24
FR0126864802 BARCLA NCP31122021	28.05.2021	31.12.2021	EUR	100 000 000		100 085 511,95	1,00
GB00BHLL8398 CD L.BK CO.MKTS 22	09.02.2021	16.09.2022	EUR	90 000 000		90 384 712,49	0,90
GB00BHLL8950 CD LLOYDS BAN0722	10.02.2021	29.07.2022	EUR	100 000 000		100 287 938,91	1,00
XS2265032008 ECP NATWEST 0522	25.11.2020	25.05.2022	EUR	80 000 000		80 215 206,26	0,80
XS2267076896 CD CS AG 301121	30.11.2020	30.11.2021	EUR	100 000 000		100 051 753,44	0,99
XS2288950756 CD GOLDMAN S.0122	14.01.2021	13.01.2022	EUR	120 000 000		120 103 392,21	1,19
XS2293122862 CD NATWEST M.0222	27.01.2021	27.07.2022	EUR	50.000.000		50 148 527,96	0,50
XS2306625687 CD NATWEST MARKE22	23.02.2021	23.02.2022	EUR	60 000 000		60 088 835,08	0,60
XS2307045976 CD NATWEST 082022	25.02.2021	25.08.2022	EUR	100 000 000		100 304 240,82	1,00
XS2317103377 CD STAND CHART0922	10.03.2021	15.09.2022	EUR	50.000.000		50 218 039,24	0,50
XS2337344381 CD STDARD CHAR.23	27.04.2021	27.01.2023	EUR	100 000 000		100 598 862,51	1,00
XS2365099402 CD C.SUISSE 080722	09.07.2021	08.07.2022	EUR	5 000 000		5 012 910,92	0,05
XS2370719481 CD STD CHART.B.23	29.07.2021	10.07.2023	EUR	120 000 000		120 731 662,04	1,20

Bezeichnung der Wertpapiere	Emission	Fälligkeit	Währung	Menge Anz. oder Nennwert	Zinssatz	Börsenwert	% des Nettovermögens
XS2371868006 CD CS 28072022	29.07.2021	28.07.2022	EUR	69 500 000		69 687 290,40	0,69
XS2391349805 CD NATWEST M.0323	24.09.2021	01.03.2023	EUR	60 000 000		60 371 161,70	0,60
SUMME IRLAND						135 264 632,11	1,35
FR0126958521 BARCLA NCP30062022	29.07.2021	30.06.2022	EUR	90 000 000		90 250 171,87	0,90
XS2243302192 CD HEW PACK 1021	07.10.2020	06.10.2021	EUR	10 000 000		10 000 466,70	0,10
XS2258452635 CD H.P.INTL BK 21	12.11.2020	10.11.2021	EUR	20 000 000		20 007 618,46	0,20
XS2260543835 CD HEWLETT-PACK 21	16.11.2020	15.11.2021	EUR	15 000 000		15 006 375,08	0,15
SUMME SCHWEDEN						170 302 502,02	1,69
XS2344282418 CD NORDE.BK ABP 22	14.05.2021	14.10.2022	EUR	150 000 000		150 720 796,59	1,50
XS2393198408 CP VOLKSW.F.0122	29.09.2021	31.01.2022	SEK	200 000 000		19 581 705,43	0,19
SUMME OGA-Anteile						570 288 948,47	5,67
SUMME ALLGEMEINE INVESTMENTFONDS für Privatanleger und vergleichbare Titel aus anderen EU-Mitgliedstaaten						80 670 929,45	0,80
SUMME FRANKREICH						80 670 929,45	0,80
FR0013412822 CM-AM MONE ISR (RC)			EUR	48 823,711		80 670 929,45	0,80
SUMME OGAW und vergleichbare Titel aus anderen EU-Mitgliedstaaten						489 618 019,02	4,87
SUMME FRANKREICH						489 618 019,02	4,87
FR0000003964 SG MONETAIRE PLUS I SI.4DEC			EUR	2 125,1238		49 970 675,74	0,50
FR0000287716 BNPP MONEY 3M IC SI.REGPT 3DEC			EUR	2 609,867		59 948 182,26	0,60
FR0007038138 AMUNDI EUR.LIQ.RAT.SRI I-C3DEC			EUR	0,07		73 029,07	0,00
FR0007075122 OSTRUM SRI MONEY IC FCP 5DEC			EUR	8 075,57058		99 845 224,07	0,99
FR0010089649 SW.L.FDS F MON.M.EUR.I SI.3DEC			EUR	2 018,425		49 963 466,74	0,50
FR0010251660 AMUN.EURO LIQUID.SRI IC FCP 3D			EUR	0,318		73 583,16	0,00
FR0010337667 BNP PARIB.CASH INV.I FCP 3DEC			EUR	1 783,425		99 929 655,38	0,99
FR0010885236 OSTRUM SRI MONEY P.IC FCP 4DEC			EUR	585,5762		60 017 631,28	0,60
FR0013095312 AMUN.EURO LIQUID.SRI I2 FCP 3D			EUR	7 081,265		69 796 571,32	0,69
SUMME Finanzkontrakte						9 532 678,01	0,09
SUMME Finanzkontrakte mit Nachschusspflicht						9 262 986,78	0,09
MARS.EUR Nachschussforderungen Swaps			EUR	9 262 986,78		9 262 986,78	0,09
SUMME Sonstige Verpflichtungen						269 691,23	0,00

Bezeichnung der Wertpapiere	Emission	Fälligkeit	Währung	Menge Anz. oder Nennwert	Zinssatz	Börsen- wert	% des Nettovermögens
SUMME Swaps						269 691,23	0,00
T19001885640 SWTCAL121121COLGATE-			EUR	-11 000 000		-210,68	0,00
T19001902383 SWTCAL131221SANTANDE			EUR	-30 000 000		-7 170,35	0,00
T19001906491 SWTCAL131221LBK HESS			EUR	-50 000 000		-22 329,80	0,00
T20001911366 SWTCIC140122BBVA 17/			EUR	-16 900 000		-8 213,53	0,00
T20001921484 SWTCIC130122CD NATWE			EUR	-28 000 000		-4 790,27	0,00
T20001921485 SWTCIC140122NATWEST			EUR	-50 000 000		-8 576,15	0,00
T20001934728 SWTCAL140122BMW FINA			EUR	-20 000 000		2 554,89	0,00
T20001934729 SWTCAL200122JOHNSON			EUR	-10 000 000		1 255,72	0,00
T20002028209 SWTCIC070222BANK AME			EUR	-60 000 000		14 321,89	0,00
T20002028210 SWTCIC271021CITIGROU			EUR	-5 600 000		582,64	0,00
T20002070230 SWTCAL040422VOLKSWAG			EUR	-5 000 000		2 923,84	0,00
T20002086164 SWTCAL161122BFCM 0.5			EUR	-10 000 000		9 709,99	0,00
T20002091996 SWTCAL250522ECP NATW			EUR	-80 000 000		21 373,27	0,00
T20002101602 SWTCAL120922WELLS FA			EUR	-40 000 000		22 731,96	0,00
T20002101604 SWTCAL270122ANZ NEW			EUR	-10 000 000		4 722,17	0,00
T20002101605 SWTCAL280922BK OF NO			EUR	-28 160 000		16 620,33	0,00
T20002105360 SWTCAL240122SANTANDE			EUR	-5 000 000		2 133,01	0,00
T21002122723 SWTCAL280922BK OF NO			EUR	-21 000 000		5 396,45	0,00
T21002122726 SWTCAL291122ANZ BANK			EUR	-21 000 000		12 811,43	0,00
T21002122729 SWTCAL280322NATIONAL			EUR	-21 271 000		3 477,70	0,00
T21002122735 SWACAL110322CACF B			EUR	-80 000 000		12 708,09	0,00
T21002128967 SWTCAL161122UBS GROU			EUR	-20 923 000		10 975,26	0,00
T21002128968 SWTCAL030522SG B			EUR	-130 000 000		22 669,81	0,00
T21002144929 SWTCIC270722CD NATWE			EUR	-50 000 000		6 725,29	0,00
T21002144930 SWTCIC210722MIZUHO I			EUR	-50 000 000		6 459,54	0,00
T21002153968 SWTCIC160722GOLDM.S.			EUR	-10 700 000		1 109,19	0,00
T21002153969 SWTCIC290722CD LLOYD			EUR	-100 000 000		10 419,65	0,00
T21002153970 SWTCAL010422VOLKSWAG			EUR	-23 000 000		1 779,02	0,00

Bezeichnung der Wertpapiere	Emission	Fälligkeit	Währung	Menge Anz. oder Nennwert	Zinssatz	Börsen- wert	% des Nettovermögens
T21002153971 SWTCAL160922CD L.BK			EUR	-100 000 000		13 822,43	0,00
T21002159086 SWTCAL250822CD NATWE			EUR	-100 000 000		8 497,54	0,00
T21002173832 SWTCIC150922CD STAND			EUR	-200 000 000		13 355,98	0,00
T21002173833 SWTCIC291122ANZ BANK			EUR	-29 000 000		5 942,26	0,00
T21002186832 SWTCIC010622BNP PARI			EUR	-21 000 000		1 773,20	0,00
T21002209839 SWACIC020522SG B			EUR	-150 000 000		2 636,18	0,00
T21002209892 SWTCIC060622CO.RABOB			EUR	-20 500 000		470,39	0,00
T21002220116 SWTCAL270123CD STDAR			EUR	-100 000 000		26 935,14	0,00
T21002221353 SWACAL141022CD NORDE			EUR	-150 000 000		6 726,55	0,00
T21002241172 SWTCIC161122BFCM 0.5			EUR	-35 000 000		1 315,07	0,00
T21002246358 SWTCIC111122BNP PARI			EUR	-31 500 000		-1 224,34	0,00
T21002246359 SWTCIC161122BFCM 0.5			EUR	-24 000 000		-832,92	0,00
T21002249260 SWTCIC110922BBVA 17/			EUR	-31 000 000		-4 093,58	0,00
T21002249297 SWTCAL150623BFCM 0.7			EUR	-100 000 000		-26 201,42	0,00
T21002257577 SWTCAL150623BFCM 0.7			EUR	-64 100 000		-1 014,54	0,00
T21002267745 SWTCAL100723CD STD C			EUR	-120 000 000		57 507,58	0,00
T21002269801 SWTCAL170723ABN AMRO			EUR	-15 000 000		7 295,24	0,00
T21002269802 SWTCAL260523SOCIETE			EUR	-20 500 000		8 104,60	0,00
T21002282836 SWTCIC010823VONOVIA			EUR	-11 000 000		4 872,99	0,00
T21002297781 SWTCAL010323CD NATWE			EUR	-60 000 000		-891,12	0,00
T21002297799 SWTCIC290823TOYOTA M			EUR	-70 000 000		2 523,64	0,00

CM-AM CASH

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte-Verordnung

30.09.2021

Eine leere Tabelle bedeutet, dass keine Daten vorliegen.

Betrag der verliehenen Wertpapiere und Rohstoffe als Anteil am Vermögen

	Verleihen von Wertpapieren	Entleihen von Wertpapieren	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Pensionsgeschäfte	Total Return Swap
Betrag der verliehenen Vermögenswerte					
% des Vermögens, das verliehen werden kann					

Engagements für jede Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps, ausgedrückt in absoluten Werten und in Prozent des Nettovermögens des Fonds

	Verleihen von Wertpapieren	Entleihen von Wertpapieren	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Pensionsgeschäfte	Total Return Swap
Betrag					
% des Gesamtnettovermögens					

Eine leere Tabelle bedeutet, dass keine Daten vorliegen.

10 größte Emittenten gehaltener Sicherheiten (ohne Barmittel) für alle Arten von Finanzierungsgeschäften (Umfang der Sicherheiten für laufende Transaktionen)

1. Bezeichnung	
Umfang der erhaltenen Sicherheiten	
2. Bezeichnung	
Umfang der erhaltenen Sicherheiten	
3. Bezeichnung	
Umfang der erhaltenen Sicherheiten	
4. Bezeichnung	
Umfang der erhaltenen Sicherheiten	
5. Bezeichnung	
Umfang der erhaltenen Sicherheiten	
6. Bezeichnung	
Umfang der erhaltenen Sicherheiten	
7. Bezeichnung	
Umfang der erhaltenen Sicherheiten	
8. Bezeichnung	
Umfang der erhaltenen Sicherheiten	
9. Bezeichnung	
Umfang der erhaltenen Sicherheiten	
10. Bezeichnung	
Umfang der erhaltenen Sicherheiten	

Eine leere Tabelle bedeutet, dass keine Daten vorliegen.

10 Hauptkontrahenten nach absolutem Wert der Aktiva und Passiva ohne Aufrechnung

	Verleihen von Wertpapieren	Entleihen von Wertpapieren	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Pensionsgeschäfte	Total Return Swap
1. Bezeichnung					
Betrag					
Domizil					
2. Bezeichnung					
Betrag					
Domizil					
3. Bezeichnung					
Betrag					
Domizil					
4. Bezeichnung					
Betrag					
Domizil					
5. Bezeichnung					
Betrag					
Domizil					
6. Bezeichnung					
Betrag					
Domizil					
7. Bezeichnung					
Betrag					
Domizil					
8. Bezeichnung					
Betrag					
Domizil					
9. Bezeichnung					
Betrag					
Domizil					
10. Bezeichnung					
Betrag					
Domizil					

Eine leere Tabelle bedeutet, dass keine Daten vorliegen.

Art und Qualität der Sicherheiten

	Verleihen von Wertpapieren	Entleihen von Wertpapieren	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Pensionsgeschäfte	Total Return Swap
Art und Qualität der Sicherheit					
Liquide Mittel					
Schuldinstrumente					
Gutes Rating					
Mittleres Rating					
Niedriges Rating					
Aktien					
Gutes Rating					
Mittleres Rating					
Niedriges Rating					
Fondsanteile					
Gutes Rating					
Mittleres Rating					
Niedriges Rating					
Währung der Sicherheit					
Land des Emittenten der Sicherheit					

Eine leere Tabelle bedeutet, dass keine Daten vorliegen.

Laufzeit der Sicherheit, aufgliedert nach den nachfolgenden Tranchen

	Verleihen von Wertpapieren	Entleihen von Wertpapieren	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Pensionsgeschäfte	Total Return Swap
Weniger als 1 Tag					
1 Tag bis 1 Woche					
1 Woche bis 1 Monat					
1 bis 3 Monate					
3 Monate bis 1 Jahr					
Mehr als 1 Jahr					
Offen					

Fälligkeit der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps, aufgeschlüsselt nach den nachfolgenden Tranchen

	Verleihen von Wertpapieren	Entleihen von Wertpapieren	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Pensionsgeschäfte	Total Return Swap
Weniger als 1 Tag					
1 Tag bis 1 Woche					
1 Woche bis 1 Monat					
1 bis 3 Monate					
3 Monate bis 1 Jahr					
Mehr als 1 Jahr					
Offen					

Abrechnung und Clearing von Verträgen

	Verleihen von Wertpapieren	Entleihen von Wertpapieren	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Pensionsgeschäfte	Total Return Swap
Zentrale Gegenpartei					
Bilaterale Geschäfte					
Drei Parteien					

Eine leere Tabelle bedeutet, dass keine Daten vorliegen.

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten

	Barmittel	Wertpapiere
Höchstbetrag (%)		
Genutzter Betrag (%)		
Erträge für den OGA infolge der Reinvestition von Barsicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und TRS		

Daten zur Verwahrung der vom OGA erhaltenen Sicherheiten

1. Bezeichnung

Einbehaltener Betrag

Eine leere Tabelle bedeutet, dass keine Daten vorliegen.

Daten zur Verwahrung der vom OGA gestellten Sicherheiten

Gesamtbetrag der gestellten Sicherheiten

In % aller geleisteten Sicherheiten

Getrennte Konten

Sammelkonten

Sonstige Konten

Aufgeschlüsselte Angaben zu den Einnahmen

		Verleihen von Wertpapieren	Entleihen von Wertpapieren	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Pensionsgeschäfte	Total Return Swap
OGA	Betrag			410,56		
	in % der Einnahmen			100,00		
Verwalter	Betrag					
	in % der Einnahmen					
Dritte (z. B. Leihstelle...)	Betrag					
	in % der Einnahmen					

Aufgeschlüsselte Angaben zu den Kosten

		Verleihen von Wertpapieren	Entleihen von Wertpapieren	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Pensionsgeschäfte	Performance-Swaps
OGA	Betrag					
Verwalter	Betrag					
Dritte (z. B. Leihstelle...)	Betrag					

Eine leere Tabelle bedeutet, dass keine Daten vorliegen.

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.