

CM-AM CASH ISR

Informationsdokument vom 30.09.2024

Inhalt

VERMÖGENSAUFSTELLUNG IN EUR	3
ANZAHL DER ANTEILE IM UMLAUF UND NETTOINVENTARWERT PRO ANTEIL	4
BESTANDTEILE DES WERTPAPIERPORTFOLIOS IN EUR	5
VERÄNDERUNG DES WERTPAPIERBESTANDS IM BERICHTSZEITRAUM IN EUR	6
AUSSCHÜTTUNGEN IM BERICHTSZEITRAUM	7
VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH WÄHRUNG	8
VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH WIRTSCHAFTSSEKTOR	9
VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH DEM LAND, IN DEM DER EMITTENT SEINEN SITZ HAT	10
AUFSCHLÜSSELUNG DER SONSTIGEN VERMÖGENSWERTE E) DES WERTPAPIERPORTFOLIOS NACH ART	11
AN DIE WERTENTWICKLUNG GEBUNDENE GEBÜHREN	12
AUFSTELLUNG DER ZULÄSSIGEN AKTIVA UND PASSIVA (OHNE TFI)	13
AUFSTELLUNG DER DEVISEN-TERMINGESCHÄFTE	18
TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – AKTIEN	19
TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – ZINSSÄTZE	20
TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – DEVISEN	23
TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – KREDITRISIKO	24
TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – SONSTIGE ENGAGEMENTS	25
AUFSTELLUNG DER DEVISEN-TERMINGESCHÄFTE (ZUR ABSICHERUNG EINER ANTEILSKLASSE VERWENDET)	26
TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – DEVISEN (ZUR ABSICHERUNG EINER ANTEILSKLASSE VERWENDET)	27
ZUSAMMENFASSENDER AUFSTELLUNG	28

CM-AM CASH ISR

VERMÖGENSAUFSTELLUNG IN EUR

Bestandteile der Vermögensaufstellung	Betrag zum Abschluss des Berichtszeitraums *
a) Zulässige Finanzwerte gemäß Artikel L. 214-20 Absatz I, Satz 1 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes	10 974 356 181,98
b) Bankguthaben	1 140 246 995,68
c) Sonstige Aktiva des OGAW	1 345 503 720,37
d) Vom OGAW gehaltene Vermögenswerte insgesamt	13 460 106 898,03
e) Passiva	-19 856 585,33
f) Nettoinventarwert	13 440 250 312,70

* Negative Beträge sind mit einem Minuszeichen gekennzeichnet

CM-AM CASH ISR

ANZAHL DER ANTEILE IM UMLAUF UND NETTOINVENTARWERT PRO ANTEIL

ISIN-Code der Anteilsklasse	Bezeichnung der Anteilsklasse	Verwendung der ausschüttungsfähigen Beträge	Währung der Anteilsklasse	Nettovermögen der Anteilsklasse (EUR)	Anzahl Anteile	Nettoinventarwert (EUR)
FR0013258886	ANTEILSKLASSE THES. ES	Thesaurierbar	EUR	2 979 944 801,07	28 293,600	105 322,22
FR0000979825	ANTEILSKLASSE THES. IC	Thesaurierbar	EUR	6 594 876 095,81	12 259,483	537 940,80
FR0013353828	ANTEILSKLASSE THES. RC	Thesaurierbar	EUR	2 648 323 861,04	48 533,337383	54 567,10
FR0013400546	ANTEILSKLASSE THES. RC	Thesaurierbar	EUR	244 991 122,00	23 301 979,298975	10,51374
FR001400DG78	ANTEILSKLASSE THES. S	Thesaurierbar	EUR	959 803 949,90	8 988,499983	106 781,32
FR0010948190	ANTEILSKLASSE AUSSCH. ID	Ausschüttbar	EUR	12 310 482,88	24,699	498 420,29

CM-AM CASH ISR

BESTANDTEILE DES WERTPAPIERPORTFOLIOS IN EUR

Bestandteile des Wertpapierbestands :	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
a) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Währungs- und Finanzgesetzbuchs regulierten Markt gehandelt werden	81,65	81,53
b) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist und in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Unterzeichnerstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum liegt, gehandelt werden	0,00	0,00
c) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die zum amtlichen Handel an einer Wertpapierbörse eines Drittstaats zugelassen sind oder an einem anderen organisierten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt eines Drittstaats gehandelt werden, sofern die betreffende Börse oder der betreffende Markt nicht auf einer von der AMF veröffentlichten Liste steht oder die Auswahl dieser Börse oder dieses Markts per Gesetz oder im Reglement oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist	0,00	0,00
d) Neu emittierte Finanztitel, die in Abschnitt I, Absatz 4 des Artikels R. 214-11 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) genannt sind	0,00	0,00
e) Sonstige Aktiva	9,75	9,74

CM-AM CASH ISR

VERÄNDERUNG DES WERTPAPIERBESTANDS IM BERICHTSZEITRAUM IN EUR

Bestandteile des Wertpapierbestands :	Veränderung (Betrag)	
	Käufe	Veräußerungen
a) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Währungs- und Finanzgesetzbuchs regulierten Markt gehandelt werden	36 209 229 197,16	35 046 486 147,86
b) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist und in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Unterzeichnerstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum liegt, gehandelt werden	0,00	0,00
c) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die zum amtlichen Handel an einer Wertpapierbörse eines Drittstaats zugelassen sind oder an einem anderen organisierten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt eines Drittstaats gehandelt werden, sofern die betreffende Börse oder der betreffende Markt nicht auf einer von der AMF veröffentlichten Liste steht oder die Auswahl dieser Börse oder dieses Markts per Gesetz oder im Reglement oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist	0,00	0,00
d) Neu emittierte Finanztitel, die in Abschnitt I, Absatz 4 des Artikels R. 214-11 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) genannt sind	0,00	0,00
e) Sonstige Aktiva	1 540 200 952,67	1 313 120 238,94

Veränderung im Berichtszeitraum	Veränderung (Betrag)
Käufe	37 749 430 149,83
Veräußerungen	36 359 606 386,80

CM-AM CASH ISR

AUSSCHÜTTUNGEN IM BERICHTSZEITRAUM

	Anteilsklasse	Nettobetrag je Anteil	Steuerguthaben	Bruttobetrag je Anteil
Ausgeschüttete Dividenden				
06/08/2024	ANTEILSKLASSE AUSSCH. ID	14 776,51	0,00	14 776,51
Auszuschüttende Dividenden				

CM-AM CASH ISR

VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH WÄHRUNG

Währung	Betrag (EUR)	Prozentsatz	
		Nettovermögen	Gesamtvermögen
Euro	10 952 122 285,62	81,49	81,37
US-Dollar	22 233 896,36	0,16	0,16
Summe	10 974 356 181,98	81,65	81,53

CM-AM CASH ISR

VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH WIRTSCHAFTSSEKTOR

Wirtschaftssektor	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
Banken	56,39	56,31
	10,39	10,38
Gas, Wasser und sonstige Versorgungsdienste	2,75	2,74
Staatlich garantierte Emittenten	2,41	2,40
Allgemeine Finanzen	2,25	2,24
Banken	1,87	1,87
Strom	1,68	1,68
Automobil und Zulieferer	1,33	1,33
Erdölgesellschaften	0,89	0,89
Bau / Grundstoffe	0,48	0,48
Nahrungsmittel	0,29	0,29
Produkte für den Hausgebrauch	0,22	0,22
Festnetztelefonie	0,19	0,19
Einzelhandel	0,18	0,18
Chemie	0,15	0,15
Software / EDV-Dienstleistungen	0,11	0,11
Staatsanleihen	0,07	0,07
Summe	81,65	81,53

CM-AM CASH ISR

VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH DEM LAND, IN DEM DER EMITTENT SEINEN SITZ HAT

Land	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
Frankreich	42,92	42,86
Vereinigtes Königreich	16,53	16,51
Spanien	4,89	4,88
Deutschland	4,50	4,49
Belgien	3,83	3,83
Kanada	3,42	3,41
Niederlande	2,74	2,74
Italien	1,13	1,13
Luxemburg	0,73	0,72
Schweden	0,59	0,59
USA	0,19	0,19
Irland	0,18	0,18
Summe	81,65	81,53

CM-AM CASH ISR

AUFSCHLÜSSELUNG DER SONSTIGEN VERMÖGENSWERTE E) DES WERTPAPIERPORTFOLIOS NACH ART

Art des Wertpapiers	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
OGA-Anteile	9,75	9,74
OGAW und vergleichbare Titel aus anderen EU-Mitgliedstaaten	9,45	9,44
AIF und vergleichbare Titel aus anderen EU-Mitgliedstaaten	0,30	0,30
Sonstige OGA und Investmentfonds	0,00	0,00
Sonstige Aktiva	0,00	0,00
Summe	9,75	9,74

CM-AM CASH ISR

AN DIE WERTENTWICKLUNG GEBUNDENE GEBÜHREN

ANTEILSKLASSE THES. ES	30.09.2024
An die Wertentwicklung gebundene Gebühren (variable Kosten)	167 183,32
Prozentualer Anteil der an die Wertentwicklung gebundenen	0,01

ANTEILSKLASSE THES. IC	30.09.2024
An die Wertentwicklung gebundene Gebühren (variable Kosten)	1 750 826,28
Prozentualer Anteil der an die Wertentwicklung gebundenen	0,02

ANTEILSKLASSE THES. RC	30.09.2024
An die Wertentwicklung gebundene Gebühren (variable Kosten)	462 528,55
Prozentualer Anteil der an die Wertentwicklung gebundenen	0,02

ANTEILSKLASSE THES. RC2	30.09.2024
An die Wertentwicklung gebundene Gebühren (variable Kosten)	21 941,49
Prozentualer Anteil der an die Wertentwicklung gebundenen	0,01

ANTEILSKLASSE THES. S	30.09.2024
An die Wertentwicklung gebundene Gebühren (variable Kosten)	313 795,93
Prozentualer Anteil der an die Wertentwicklung gebundenen	0,03

ANTEILSKLASSE AUSSCH. ID	30.09.2024
An die Wertentwicklung gebundene Gebühren (variable Kosten)	3 609,88
Prozentualer Anteil der an die Wertentwicklung gebundenen	0,03

CM-AM CASH ISR

AUFSTELLUNG DER ZULÄSSIGEN AKTIVA UND PASSIVA (OHNE TFI)

Instrumente	Währung	Menge	Betrag	%NV
Anleihen			1 017 757 095,94	7,57
Sonstige an einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelte Anleihen und ähnliche Wertpapiere			1 012 746 176,49	7,53
Banken			827 276 338,24	6,16
ABNANV Float 09/22/25	EUR	500	50 112 574,00	0,37
ACAFP 0.954 12/10/24	EUR	1 000	100 263 144,56	0,75
BFCM Float 04/28/25	EUR	250	25 217 718,29	0,19
BFCM Float 09/12/26	EUR	500	50 065 105,00	0,37
BNP PARIBAS 2,875%14-1224	EUR	20 000	20 411 546,00	0,15
BNS Float 10/18/24	EUR	750	75 613 658,25	0,56
BPCE TV24-060326	EUR	40	4 013 677,32	0,03
CIBC TV23-240125	EUR	200	20 190 662,24	0,15
HSBC BANK TV23-080325	EUR	200	20 078 347,62	0,15
ING GROEP TV21-291125	EUR	140	13 942 251,12	0,10
LLOYDS BANK TV23-160125	EUR	800	80 882 054,05	0,60
MIZUHO INTL 0%24-160226	EUR	50 000	48 113 580,00	0,36
NACN Float 04/21/25	EUR	280	28 341 551,80	0,21
NATIONAL BANK OF CA 15.122.025	EUR	600	57 205 104,00	0,43
NATL BK CANADA 0%23-171125 1	EUR	1 500	144 847 500,00	1,08
NATWEST MKTS TV24-090126 EMTN	EUR	2 000	2 027 863,12	0,02
NIBC BANK 270.125	EUR	120	11 820 336,00	0,09
SANTANDER CONSUM F 4,375%23-25	EUR	350	35 691 784,56	0,27
SOCIETEGENERALE TV24-190126	EUR	375	37 933 202,25	0,28
TD Float 01/20/25	EUR	500	504 678,06	0,00
Chemie			19 779 960,59	0,15
SIKASW Float 11/01/24	EUR	19 649	19 779 960,59	0,15
Einzelhandel			24 257 774,75	0,18
ALD TV23-210225	EUR	241	24 257 774,75	0,18
Bau / Grundstoffe			34 790 853,60	0,26
DGFP Float 05/13/26	EUR	346	34 790 853,60	0,26
BMW Float 06/05/26	EUR	365	36 809 111,20	0,27
Allgemeine Finanzen			34 229 315,11	0,25
SOCGEN Float 01/13/25	EUR	339	34 229 315,11	0,25
Staatsanleihen			9 997 100,00	0,07
BOTS 0 09/30/24	EUR	10 000	9 997 100,00	0,07
Festnetztelefonie			25 605 723,00	0,19
AT T TV 060325	EUR	25 500	25 605 723,00	0,19
Sonstige nicht an einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelte Anleihen und ähnliche Wertpapiere			5 010 919,45	0,04
Banken			5 010 919,45	0,04
BNP PARIBAS TV24-200326	EUR	50	5 010 919,45	0,04
Schuldtitel			9 956 599 086,04	74,08
An einem organisierten oder gleichwertigen Markt gehandelte Schuldtitel			9 757 371 777,47	72,60

CM-AM CASH ISR

AUFSTELLUNG DER ZULÄSSIGEN AKTIVA UND PASSIVA (OHNE TFI)

Instrumente	Währung	Menge	Betrag	%NV
Nahrungsmittel			39 592 872,28	0,29
DANONE NCP15012025	EUR	40 000 000	39 592 872,28	0,29
Automobil und Zulieferer			178 842 641,80	1,33
ECP VOLKSWAGEN 24	EUR	100 000 000	99 662 822,79	0,74
ECP VW 170125	EUR	80 000 000	79 179 819,01	0,59
Banken			251 613 623,11	1,87
L.B.P. NCP01082025	EUR	150 000 000	150 879 435,94	1,12
L.B.P. NCP18072025	EUR	100 000 000	100 734 187,17	0,75
AQUITA BMT13012025	EUR	30 000 000	30 970 304,83	0,23
BARCLA NCP07042025	EUR	80 000 000	81 575 923,42	0,61
BARCLA NCP10022025	EUR	190 000 000	195 041 169,02	1,45
BARCLA NCP10032025	EUR	100 000 000	102 309 492,50	0,76
BFCM NCP01042025	EUR	120 000 000	122 066 222,62	0,91
BFCM NCP04022025	EUR	80 000 000	82 205 116,34	0,61
BFCM NCP04112024	EUR	100 000 000	103 810 286,94	0,77
BFCM NCP04112024	EUR	150 000 000	155 354 547,96	1,16
BFCM NCP07052025	EUR	100 000 000	101 578 057,75	0,76
BFCM NCP10072025	EUR	100 000 000	100 827 029,80	0,75
BFCM NCP18062025	EUR	200 000 000	202 131 263,78	1,50
BILBAO NCP05082024	EUR	150 000 000	148 099 760,60	1,10
BPCE NCP09012025	EUR	120 000 000	123 729 715,12	0,92
BPCE NCP15112024	EUR	100 000 000	103 760 935,55	0,77
BPCE NCP31012025	EUR	200 000 000	205 652 074,84	1,53
CACF BMT05022026	EUR	50 000 000	48 241 831,28	0,36
CACF BMT06062025	EUR	50 000 000	48 927 187,58	0,36
CACF BMT20062025	EUR	50 000 000	48 920 550,97	0,36
CACF BMT29052026	EUR	70 000 000	67 156 887,70	0,50
CACF NCP15072025	EUR	100 000 000	97 575 758,28	0,73
CACF NCP28022025	EUR	50 000 000	49 318 376,88	0,37
CAT31 NCP 725	EUR	30 000 000	30 190 709,60	0,22
CCCMUT NCP28012025	EUR	100 000 000	102 858 937,68	0,77
CD BNP 3.585%25	EUR	120 000 000	118 626 903,15	0,88
CD BNP FORTIS 24	EUR	50 000 000	49 679 643,88	0,37
CD BNP PAR.FORT.25	EUR	200 000 000	197 526 133,32	1,47
CD BNP PAR FORT 24	EUR	100 000 000	99 313 927,22	0,74
CD BOM.3.615%0425	EUR	135 000 000	132 597 476,71	0,99
RABO 0525	EUR	160 000 000	156 905 052,63	1,17
CD KBC GROUP 1224	EUR	50 000 000	49 602 273,73	0,37
CD NATWEST 3.43%26	EUR	120 000 000	115 007 044,16	0,86
CD NATWEST 300126	EUR	55 000 000	53 088 482,56	0,40
CD NATWEST MARKE23	EUR	50 000 000	48 276 487,04	0,36
CD NATWEST MARKE25	EUR	120 000 000	116 218 078,80	0,86
CD NATWEST MKT1025	EUR	85 000 000	82 360 936,78	0,61
CD NATWEST MKT 25	EUR	50 000 000	49 461 225,60	0,37
CD STANDARD CHAR25	EUR	50 000 000	49 370 800,20	0,37

CM-AM CASH ISR

AUFSTELLUNG DER ZULÄSSIGEN AKTIVA UND PASSIVA (OHNE TFI)

Instrumente	Währung	Menge	Betrag	%NV
CL BMT04072025	EUR	40 000 000	40 517 328,86	0,30
CL BMT17012025	EUR	70 000 000	72 150 385,56	0,54
CL BMT26062025	EUR	30 000 000	30 418 227,05	0,23
CL NCP13032025	EUR	50 000 000	51 123 953,72	0,38
CL NCP14022025	EUR	150 000 000	153 871 728,71	1,14
CP SANT.3.785% 25	EUR	75 000 000	73 776 385,21	0,55
CP SANT.3.80% 25	EUR	70 000 000	68 757 175,85	0,51
CP SANT.3.865% 24	EUR	200 000 000	199 854 282,25	1,49
ECD NATWEST MAR.25	EUR	30 000 000	29 670 583,64	0,22
ECP DEUTSCH BK 25	EUR	100 000 000	97 865 869,91	0,73
ECP INTESA SP 0825	EUR	100 000 000	97 432 912,80	0,72
ECP LLOYDS BK 24	EUR	140 000 000	138 936 254,63	1,03
ECP NATWEST MAR.24	EUR	60 000 000	59 914 360,74	0,45
ECP SANTAN 12.025	EUR	85 000 000	84 239 349,00	0,63
ECP SANTAN 3.55%25	EUR	100 000 000	97 586 349,49	0,73
ECP SANTAN 4.22%24	EUR	80 000 000	79 759 338,82	0,59
ECP SANTANDER0725	EUR	80 000 000	78 095 416,23	0,58
ECP SANTANDER 25	EUR	90 000 000	88 879 150,37	0,66
LLOYDS BANK 0%25	EUR	30 000 000	29 703 592,93	0,22
NATIXI NCP07052025	EUR	100 000 000	101 581 357,75	0,76
NATIXI NCP28082025	EUR	200 000 000	200 564 135,57	1,49
NATIXI NCP30042025	EUR	120 000 000	121 996 364,07	0,91
NATIXI NCP31012025	EUR	100 000 000	102 814 085,45	0,76
NTESA SANPAOLO FUNDING LLC 19112024	USD	25 000 000	22 233 896,36	0,17
PALATI NCP05122024	EUR	30 000 000	31 057 305,56	0,23
PALATI NCP26092025	EUR	50 000 000	50 020 638,89	0,37
PALATI NCP28022025	EUR	80 000 000	81 989 123,31	0,61
SANTANDER CON.1224	EUR	110 000 000	109 337 941,15	0,81
SG BMT05122025	EUR	180 000 000	174 274 827,45	1,30
SG BMT12092025	EUR	150 000 000	145 951 532,81	1,09
SG BMT24032025	EUR	40 000 000	40 882 500,32	0,30
SG BMT31102024	EUR	20 000 000	20 804 779,73	0,15
SG BMT31102024	EUR	50 000 000	51 988 436,00	0,39
SG BMT31102025	EUR	50 000 000	50 700 071,66	0,38
SG BMT31122024	EUR	50 000 000	51 687 366,75	0,38
STELLA BMT30042025	EUR	15 000 000	15 137 946,75	0,11
STELLA NCP04042025	EUR	50 000 000	51 025 513,59	0,38
SVENSK NCP23102024	EUR	80 000 000	79 819 812,18	0,59
Erdölgesellschaften			119 595 294,11	0,89
ECP ENI SPA 171024	EUR	70 000 000	69 884 449,94	0,52
ECP ENI ZC 281124	EUR	50 000 000	49 710 844,17	0,37
Bau / Grundstoffe			29 690 609,89	0,22
VINCI NCP17012025	EUR	30 000 000	29 690 609,89	0,22
			1 160 773 056,43	8,64
CDC HA NCP13012025	EUR	50 000 000	49 493 507,53	0,37

CM-AM CASH ISR

AUFSTELLUNG DER ZULÄSSIGEN AKTIVA UND PASSIVA (OHNE TFI)

Instrumente	Währung	Menge	Betrag	%NV
CDC HA NCP14102024	EUR	20 000 000	19 972 926,35	0,15
CDC HA NCP19032025	EUR	500 000	492 295,50	0,00
CD COMMERZBANK 24	EUR	90 000 000	89 796 647,56	0,67
CD GOLDMAN SACHS24	EUR	50 000 000	49 879 248,12	0,37
CD HEWLETT PACKA25	EUR	10 000 000	9 802 962,31	0,07
CD LE ZCP DE TOR25	EUR	160 000 000	156 029 026,43	1,16
CD TORONTO 3.56%25	EUR	135 000 000	132 516 260,68	0,99
CD TORONTO DOM24	EUR	150 000 000	149 015 284,77	1,11
CFCMMA BMT03022025	EUR	30 000 000	30 232 118,50	0,22
CFCMMA BMT05052025	EUR	30 000 000	30 253 739,50	0,23
CFCMMA NCP05122024	EUR	25 000 000	25 312 045,83	0,19
CFCMMA NCP25032025	EUR	10 000 000	10 220 792,57	0,08
ECD HP BNK 3.62%25	EUR	15 000 000	14 638 596,67	0,11
ECP AMCOR UK FIN24	EUR	30 000 000	29 824 645,10	0,22
KERING NCP07102024	EUR	50 000 000	49 969 213,63	0,37
KERING NCP10102024	EUR	20 000 000	19 981 528,78	0,15
KERING NCP PRE CPT	EUR	50 000 000	49 792 897,23	0,37
LEASIN NCP25092025	EUR	150 000 000	145 761 503,00	1,08
LEASIN NCP29072025	EUR	70 000 000	68 234 842,43	0,51
PRFIN. NCP11032025	EUR	30 000 000	29 552 973,94	0,22
Strom			225 752 837,10	1,68
ECP SSE 3.62%1124	EUR	13 500 000	13 425 293,28	0,10
EDF NCP04042025	EUR	100 000 000	98 367 071,37	0,73
EDF NCP16012025	EUR	80 000 000	79 217 319,26	0,59
EDF NCP18122024	EUR	35 000 000	34 743 153,19	0,26
Staatlich garantierte Emittenten			323 476 555,03	2,41
BPIFR NCP07072025	EUR	80 000 000	78 173 422,67	0,58
BPIFR NCP20062025	EUR	190 000 000	185 884 381,01	1,39
UNEDIC NCP10012025	EUR	60 000 000	59 418 751,35	0,44
Allgemeine Finanzen			267 462 929,60	1,99
CFCMOC BMT21022025	EUR	30 000 000	30 791 505,09	0,23
CFCMOC BMT28102024	EUR	20 000 000	20 799 091,88	0,15
CFCMOC NCP04022025	EUR	30 000 000	30 831 664,13	0,23
CFCMOC NCP13122024	EUR	25 000 000	25 705 066,85	0,19
CFCMOC NCP19022025	EUR	10 000 000	10 256 169,05	0,08
CFCMOC NCP23102024	EUR	20 000 000	20 804 698,67	0,15
FINAGA NCP13012025	EUR	50 000 000	49 499 035,01	0,37
FINAGA NCP13032025	EUR	30 000 000	29 555 228,13	0,22
FINAGA NCP31032025	EUR	50 000 000	49 220 470,79	0,37
Gas, Wasser und sonstige Versorgungsdienste			368 929 088,59	2,75
ENGIE NCP10102024	EUR	125 000 000	126 479 174,72	0,94
ENGIE NCP16012025	EUR	60 000 000	60 061 156,33	0,45
VEOLIA NCP14102024	EUR	120 000 000	122 676 325,45	0,91
VEOLIA NCP18112024	EUR	60 000 000	59 712 432,09	0,45

CM-AM CASH ISR

AUFSTELLUNG DER ZULÄSSIGEN AKTIVA UND PASSIVA (OHNE TFI)

Instrumente	Währung	Menge	Betrag	%NV
Software / EDV-Dienstleistungen			14 906 892,21	0,11
DASSAU NCP04122024	EUR	15 000 000	14 906 892,21	0,11
Produkte für den Hausgebrauch			29 978 489,38	0,22
KERING NCP08102024	EUR	30 000 000	29 978 489,38	0,22
Nicht an einem organisierten Markt gehandelte Schuldtitel			199 227 308,57	1,48
			199 227 308,57	1,48
ECD NATIONAL AUS24	EUR	100 000 000	99 764 576,19	0,74
ECD THE TORONTO 24	EUR	100 000 000	99 462 732,38	0,74
Anteile von OGA und Investmentfonds			1 310 527 955,20	9,75
OGAW und vergleichbare Titel aus anderen EU-Mitgliedstaaten			1 269 862 737,51	9,45
AMUNDI EURO LIQ RA-I CAP	EUR	1,368	1 517 329,79	0,01
AMUNDI EURO LIQUIDTY SRI-I2C	EUR	32 906,297	345 250 189,55	2,57
AMUNDI EURO LIQUIDTY SRI-ICC	EUR	0,084	20 669,61	0,00
AXA IM EURO LIQUIDITY SRI-C	EUR	1 101,7958	52 020 247,50	0,39
BNP PARIBAS CASH INVEST I	EUR	41,205	2 455 146,66	0,02
BNP PARIBAS MONEY 3M-IC	EUR	21 166,329	517 609 194,34	3,85
OSTRUM SRI MONEY-I C EUR	EUR	43,42563	571 044,86	0,00
OSTRUM SRI MONEY PLUS-IC EUR	EUR	1 422,3829	155 173 354,75	1,15
SG MONETAIRE PLUS-IC	EUR	42,4996	1 062 506,51	0,01
SLF (F) MONEY MARKET EURO I	EUR	7 362,092	194 183 053,94	1,45
AIF und vergleichbare Titel aus anderen EU-Mitgliedstaaten			40 665 217,69	0,30
CM-AM MONE ISR-RC	EUR	23 140,869	40 665 217,69	0,30
Summe			12 284 884 137,18	91,40

CM-AM CASH ISR

AUFSTELLUNG DER DEWISEN-TERMINGESCHÄFTE

Bezeichnung d. Instruments	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)			
	Aktiva	Passiva	Fremdwährungs-forderungen (+)		Zu liefernde Währungen (-)	
			Währung	Betrag (*)	Währung	Betrag (*)
V USD EUR 19/11/24	478 165,42	0,00	EUR	22 822 806,92	USD	-22 344 641,50
Summe	478 165,42	0,00		22 822 806,92		-22 344 641,50

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM CASH ISR

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – AKTIEN

Termin-Finanzinstrumente – Aktien				
Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
Futures				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Optionen				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Sonstige Instrumente				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Summe		0,00	0,00	0,00

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM CASH ISR

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – ZINSSÄTZE

Termin-Finanzinstrumente – Zinssätze				
Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
Futures				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Optionen				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Swaps				
SWAABA130225BNP PAR.	98 262 000,00	0,00	23 076,06	98 262 000,00
SWAABA170725ECP SANT	77 197 000,00	0,00	312 615,42	77 197 000,00
SWAABA290725LEASIN N	67 621 000,00	0,00	223 644,92	67 621 000,00
SWABNP060825ECP INTE	96 923 000,00	0,00	68 881,10	96 923 000,00
SWABNP130125FINAGA N	49 057 000,00	0,00	31 170,80	49 057 000,00
SWABNP250925LEASIN N	145 644 000,00	0,00	168 880,51	145 644 000,00
SWANOM101224CASA 0.9	99 425 000,00	0,00	22 120,44	99 425 000,00
SWARBS161124VEOLIA N	59 237 000,00	0,00	9 745,54	59 237 000,00
SWTABA030125ECP SANT	81 990 000,00	384 330,98	0,00	81 990 000,00
SWTABA070725BPIFR N	77 144 000,00	0,00	338 750,15	77 144 000,00
SWTABA181225CD NATWE	46 882 000,00	203 941,28	0,00	46 882 000,00
SWTABA220725ECP SANT	96 535 000,00	0,00	375 394,32	96 535 000,00
SWTABA241024CD GOLDM	49 032 000,00	4 524,58	0,00	49 032 000,00
SWTABN120525CD TORON	129 912 000,00	0,00	195 958,51	129 912 000,00
SWTABN300425CD BOM.3	129 987 000,00	0,00	190 544,13	129 987 000,00
SWTBVV171125BANQUE N	46 201 000,00	0,00	247 844,92	46 201 000,00
SWTBVV171125BANQUE N	92 580 000,00	0,00	450 178,02	92 580 000,00
SWTBVV270125ECD NATW	27 950 000,00	196 903,53	0,00	27 950 000,00
SWTBNP041124ECP VOLK	98 367 000,00	0,00	15 716,16	98 367 000,00
SWTBNP061224CD BNP F	49 065 000,00	0,00	15 782,45	49 065 000,00
SWTBNP100626CD NATWE	112 497 000,00	0,00	1 446 736,77	112 497 000,00
SWTBNP121124KERING N	49 207 000,00	0,00	12 232,84	49 207 000,00
SWTBNP1301253.5769/O	48 892 000,00	0,00	39 757,65	48 892 000,00
SWTBNP170125ECP VW 1	78 222 000,00	0,00	50 104,95	78 222 000,00
SWTBNP170125VINCI N	29 448 000,00	0,00	17 187,49	29 448 000,00
SWTBNP200625CACF B	47 525 000,00	12 869,89	0,00	47 525 000,00
SWTBNP231024CD COMME	86 331 000,00	0,00	14 540,33	86 331 000,00
SWTBNP241025CD NATWE	78 452 000,00	0,00	650 977,18	78 452 000,00
SWTBNP270125NIBC BAN	12 000 0,00	81 021,94	0,00	12 000 0,00
SWTBNP271024SVENSK N	76 802 000,00	17 939,83	0,00	76 802 000,00
SWTBNP280525ECP DEUT	96 319 000,00	0,00	358 281,35	96 319 000,00
SWTBNP281024ECD NATI	95 991 000,00	24 265,47	0,00	95 991 000,00
SWTBNP290526CACF B	65 268 000,00	0,00	962 251,79	65 268 000,00
SWTBNP310125CD BNP 3	117 841 000,00	0,00	59 747,29	117 841 000,00
SWTCAL071024KERING N	49 192 000,00	2 151,69	0,00	49 192 000,00

CM-AM CASH ISR

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – ZINSSÄTZE

Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
SWTCAL080625CACF B	47 472 000,00	12 990,40	0,00	47 472 000,00
SWTCAL120525CD COOP.	154 000 000,00	0,00	193 930,29	154 000 000,00
SWTCAL160425CP SANT.	67 410 000,00	0,00	73 561,65	67 410 000,00
SWTCAL171125CD NATWE	113 791 000,00	0,00	827 603,43	113 791 000,00
SWTCAL261124ECD THE	95 654 000,00	4 326,49	0,00	95 654 000,00
SWTCAL280225CACF N	96 290 000,00	40 649,83	0,00	96 290 000,00
SWTDOM040425EDF N	96 360 000,00	0,00	301 023,68	96 360 000,00
SWTDOM160225ECP SANT	86 712 000,00	135 035,26	0,00	86 712 000,00
SWTHSB041224SANTANDE	105 534 000,00	245 570,96	0,00	105 534 000,00
SWTHSB081024CP SANT.	196 146 000,00	56 823,91	0,00	196 146 000,00
SWTHSB090525CD HEWLE	9 633 000,00	0,00	21 886,79	9 633 000,00
SWTHSB111224CD BNP P	98 120 000,00	0,00	47 848,37	98 120 000,00
SWTHSB140225BILBAO N	145 819 000,00	0,00	104 962,41	145 819 000,00
SWTHVB010226CD NATWE	55 000 000,00	134 138,04	0,00	55 000 000,00
SWTHVB040425CP SANT.	72 235 000,00	0,00	11 101,54	72 235 000,00
SWTHVB051225SG B	170 470 000,00	0,00	1 614 948,32	170 470 000,00
SWTHVB091224CD TORON	143 678 000,00	147 775,79	0,00	143 678 000,00
SWTHVB110825CD LE ZC	153 934 000,00	0,00	862 989,39	153 934 000,00
SWTHVB120925SG B	142 347 000,00	0,00	713 482,36	142 347 000,00
SWTHVB150225CD BNP P	96 422 000,00	144 694,31	0,00	96 422 000,00
SWTHVB150725CACF N	96 470 000,00	0,00	392 426,41	96 470 000,00
SWTHVB201224BNP PARI	20 289 000,00	22 208,18	0,00	20 289 000,00
SWTHVB280225OISEST/3	653 058,61	43 436,12	0,00	653 058,61
SWTHVB280225OISEST/3	654,03	43,84	0,00	654,03
SWTLLO201224ECP LLOY	137 426 000,00	0,00	66 538,98	137 426 000,00
SWTNAT140225CD STAND	92 995 000,00	398 336,35	0,00	92 995 000,00
SWTNAT151024ECP NATW	60 000 000,00	499 561,07	0,00	60 000 000,00
SWTNAT160226MIZUHO I	46 725 000,00	0,00	74 729,68	46 725 000,00
SWTNAT200625BPIFR N	192 825 000,00	0,00	730 939,78	192 825 000,00
SWTNAT210725SANTANDE	35 000 0,00	0,00	258 440,53	35 000 0,00
SWTNAT281124ECP ENI	49 040 000,00	0,00	17 710,06	49 040 000,00
SWTNOM140225CD STAND	934 086,19	0,00	199 168,18	934 086,19
SWTNOM180125EDF N	77 160 000,00	308 114,46	0,00	77 160 000,00
SWTNOM270125CD NATWE	50 000 000,00	336 812,62	0,00	50 000 000,00
SWTRBS151225NAT. BNK	56 000 000,00	175 536,01	0,00	56 000 000,00
SWTRBS311024ECP SANT	76 726 000,00	57 638,69	0,00	76 726 000,00
SWTSG 050226CACF B	46 935 000,00	138 754,62	0,00	46 935 000,00
SWTSG 130125LLOYDS B	30 000 000,00	203 628,43	0,00	30 000 000,00
Untersumme		4 034 024,57	12 815 412,94	5 879 203 798,83
Sonstige Instrumente				
Untersumme		0,00	0,00	0,00

CM-AM CASH ISR

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – ZINSSÄTZE

Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
Summe		4 034 024,57	12 815 412,94	5 879 203 798,83

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM CASH ISR

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – DEWISEN

Termin-Finanzinstrumente – Devisen				
Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
Futures				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Optionen				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Sonstige Instrumente				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Summe		0,00	0,00	0,00

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM CASH ISR

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – KREDITRISIKO

Termin-Finanzinstrumente – Kreditrisiko				
Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
Futures				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Optionen				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Sonstige Instrumente				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Summe		0,00	0,00	0,00

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM CASH ISR

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – SONSTIGE ENGAGEMENTS

Termin-Finanzinstrumente – Sonstige Engagements				
Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
Futures				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Optionen				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Sonstige Instrumente				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Summe		0,00	0,00	0,00

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM CASH ISR

AUFSTELLUNG DER DEWISEN-TERMINGESCHÄFTE (ZUR ABSICHERUNG EINER ANTEILSKLASSE VERWENDET)

Bezeichnung d. Instruments	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)				Abgesicherte Anteilsklasse
	Aktiva	Passiva	Fremdwährungsforderungen (+)		Zu liefernde Währungen (-)		
			Währung	Betrag (*)	Währung	Betrag (*)	
Summe	0,00	0,00		0,00		0,00	

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM CASH ISR

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – DEISEN (ZUR ABSICHERUNG EINER ANTEILSKLASSE VERWENDET)

Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)	Abgesicherte Anteilsklasse
		Aktiva	Passiva	+/-	
Futures					
Untersumme		0,00	0,00	0,00	
Optionen					
Untersumme		0,00	0,00	0,00	
Swaps					
Untersumme		0,00	0,00	0,00	
Sonstige Instrumente					
Untersumme		0,00	0,00	0,00	
Summe		0,00	0,00	0,00	

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM CASH ISR

ZUSAMMENFASSENDE AUFSTELLUNG

	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert
Summe Aufstellung der zulässigen Aktiva und Passiva (ohne TFI)	12 284 884 137,18
Aufstellung der TFI (ohne TFI, die zur Absicherung ausgegebener Anteile verwendet werden):	
Summe Devisen-Termingeschäfte	478 165,42
Summe Termin-Finanzinstrumente – Aktien	0,00
Summe Termin-Finanzinstrumente – Zinssätze	-8 781 388,37
Summe Termin-Finanzinstrumente – Devisen	0,00
Summe Termin-Finanzinstrumente – Anleihen	0,00
Summe Termin-Finanzinstrumente – Sonstige Engagements	0,00
Aufstellung der Termin-Finanzinstrumente, die zur Absicherung ausgegebener Anteile verwendet werden	0,00
Sonstige Aktiva (+)	1 170 710 570,86
Sonstige Passiva (-)	-7 041 172,39
Summe = Nettovermögen	13 440 250 312,70