

# CM-AM SHORT TERM 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 | 400 855 869,56                          |
| b) Bankguthaben   | 32 472 479,59                           |
| c) Sonstige vom OGAW gehaltene Vermögenswerte   | 45 549 538,95                           |
| d) Summe der vom OGAW gehaltenen Vermögenswerte   | 478 877 888,10                          |
| e) Passiva  | -2 819 702,30                           |
| f) Nettoinventarwert  | 476 058 185,80                          |

\* 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<br/>befindlichen Anteile</b> | <b>Liquidationswert</b> |
|----------------------|-------------------|----------------------|--|-------------------------|
| C1 CM-AM ST BONDS 6D | Kapitalisierbar   | 476 058 185,80       | 4 771,421572   | 99 772,82               |

## 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  | 84,20         | 83,71          |
| 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  | 8,95          | 8,90           |

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

| Wertpapiere        | Währung | Betrag (EUR)  | Prozentsatz   |                |
|--------------------|---------|---------------|---------------|----------------|
|                    |         |               | Nettovermögen | Gesamtvermögen |
| L OCCI NCP21102022 | EUR     | 19 987 788,55 | 4,18          | 4,16           |
| GS GROUP TV300424  | EUR     | 16 048 864,88 | 3,37          | 3,35           |
| IMERYS NCP 021122  | EUR     | 14 992 436,45 | 3,15          | 3,13           |
| MB AUST PAC 0%25   | EUR     | 14 054 857,50 | 2,95          | 2,93           |
| CD STD CHARTE.0824 | EUR     | 12 342 739,05 | 2,59          | 2,58           |
| STEF NCP21102022   | EUR     | 11 992 706,40 | 2,52          | 2,50           |
| MITSUBIS 0,01%1024 | EUR     | 11 790 491,52 | 2,48          | 2,46           |
| BOLLOR NCP17102022 | EUR     | 11 695 064,02 | 2,46          | 2,44           |
| ALTARE BMT 220323  | EUR     | 10 023 372,39 | 2,11          | 2,09           |
| BOLLOR NCP26102022 | EUR     | 9 997 225,05  | 2,10          | 2,09           |
| FINCANTIER1022     | EUR     | 9 994 804,50  | 2,10          | 2,09           |
| FAUREC NCP19102022 | EUR     | 9 993 457,12  | 2,10          | 2,09           |
| FINAGA NCP17112022 | EUR     | 9 993 350,32  | 2,10          | 2,09           |
| PLAOMN NCP07112022 | EUR     | 9 992 306,72  | 2,10          | 2,09           |
| L.D.C. NCP30112022 | EUR     | 9 977 717,28  | 2,10          | 2,08           |
| TOYOTA MOTOR 0%24  | EUR     | 9 517 050,00  | 2,00          | 1,99           |
| FORD MOTOR CR TV22 | EUR     | 8 378 598,90  | 1,76          | 1,75           |
| DEUTSCHE 1,125%23  | EUR     | 8 071 451,09  | 1,70          | 1,69           |
| CS AG LDN TV010923 | EUR     | 8 023 240,00  | 1,69          | 1,68           |
| AKTIA BANK 0,1%23  | EUR     | 7 948 040,54  | 1,67          | 1,66           |
| ALLIANZ FINAN TV24 | EUR     | 7 715 835,19  | 1,62          | 1,61           |
| KORIAN BMT 150623  | EUR     | 7 050 045,41  | 1,48          | 1,47           |
| SOPRA BMT24112023  | EUR     | 7 038 217,28  | 1,48          | 1,47           |
| NEXITY BMT09122022 | EUR     | 7 035 751,05  | 1,48          | 1,47           |
| BELLON NCP27102022 | EUR     | 6 998 383,54  | 1,47          | 1,46           |
| VOLVO TREASU 0%24  | EUR     | 6 670 860,00  | 1,40          | 1,39           |
| HIGHLAND HLD 0%23  | EUR     | 6 659 186,04  | 1,40          | 1,39           |
| TRATON F 0,125 %24 | EUR     | 6 216 349,02  | 1,31          | 1,30           |
| UNICREDIT 1%180123 | EUR     | 6 017 615,34  | 1,26          | 1,26           |
| F.MARC NCP25102022 | EUR     | 5 999 240,37  | 1,26          | 1,25           |
| ELIS NCP02112022   | EUR     | 5 995 474,26  | 1,26          | 1,25           |
| NEXITY BMT24112023 | EUR     | 5 017 115,06  | 1,05          | 1,05           |
| EDR.FR BMT10022023 | EUR     | 5 009 631,67  | 1,05          | 1,05           |
| CFCMOC BMT21102022 | EUR     | 5 005 261,63  | 1,05          | 1,05           |
| ING GROUP 1%200923 | EUR     | 4 907 817,81  | 1,03          | 1,02           |
| TH.FIS.SC.31122200 | EUR     | 4 841 900,00  | 1,02          | 1,01           |
| NIBC BANK 0%131023 | EUR     | 4 841 429,50  | 1,02          | 1,01           |
| M BISHI 0,339%24   | EUR     | 4 724 975,75  | 0,99          | 0,99           |
| BANCO SANTA.TV0524 | EUR     | 4 552 140,00  | 0,96          | 0,95           |
| TELEC.ITA 3,25%23  | EUR     | 4 096 798,90  | 0,86          | 0,86           |
| VERALL NCP26102022 | EUR     | 3 999 123,85  | 0,84          | 0,84           |
| BANCO SANTAND TV23 | EUR     | 3 510 673,83  | 0,74          | 0,73           |
| ALLERGAN FNDG 18/2 | EUR     | 3 152 569,23  | 0,66          | 0,66           |
| NIBC BANK TV270123 | EUR     | 3 012 658,25  | 0,63          | 0,63           |
| EDR(FR BMT11082023 | EUR     | 3 004 446,15  | 0,63          | 0,63           |

| Wertpapiere        | Wahrung   | Betrag (EUR)          | Prozentsatz    |                 |
|--------------------|------------|-----------------------|----------------|-----------------|
|                    |            |                       | Nettovermogen | Gesamtvermogen |
| F.MARC NCP06012023 | EUR        | 2 989 078,34          | 0,63           | 0,62            |
| FAUREC NCP24012023 | EUR        | 2 979 640,08          | 0,63           | 0,62            |
| PSA BANQUE 0,75%23 | EUR        | 2 971 986,16          | 0,62           | 0,62            |
| BNP PARIB 1,125%23 | EUR        | 2 966 609,18          | 0,62           | 0,62            |
| BAYER LDK 0,17% 23 | EUR        | 2 942 387,26          | 0,62           | 0,61            |
| ILIAD 2,125%051222 | EUR        | 2 747 008,11          | 0,58           | 0,57            |
| VOLVO TREASU 0%23  | EUR        | 2 441 525,40          | 0,51           | 0,51            |
| ILIAD 0,75%110224  | EUR        | 2 370 821,92          | 0,50           | 0,50            |
| CRED.AGRIC.3,03%24 | EUR        | 2 010 385,65          | 0,42           | 0,42            |
| EDR(FR BMT27092023 | EUR        | 2 003 735,69          | 0,42           | 0,42            |
| MEDTRONIC GL 0%23  | EUR        | 1 982 320,00          | 0,42           | 0,41            |
| COMMERZBANK 0,5%23 | EUR        | 1 950 355,34          | 0,41           | 0,41            |
| ARVAL SERV L 0%24  | EUR        | 1 853 180,00          | 0,39           | 0,39            |
| FRESENIUS SE 14/24 | EUR        | 1 287 221,32          | 0,27           | 0,27            |
| FCA BANK 0%160424  | EUR        | 1 279 854,00          | 0,27           | 0,27            |
| RCI BANQUE 0,5%25  | EUR        | 1 192 532,84          | 0,25           | 0,25            |
| MACIF 5,5%080323   | EUR        | 1 038 033,84          | 0,22           | 0,22            |
| BPCE TV230323      | EUR        | 1 002 204,39          | 0,21           | 0,21            |
| SOCIETE GENER TV23 | EUR        | 1 002 013,44          | 0,21           | 0,21            |
| PLASTIC OM 1,25%24 | EUR        | 942 414,66            | 0,20           | 0,20            |
| ASAHI GRO 0,01%24  | EUR        | 858 128,42            | 0,18           | 0,18            |
| BECTON DICKI 0%23  | EUR        | 732 015,00            | 0,15           | 0,15            |
| BECTON D 0,034%25  | EUR        | 629 795,04            | 0,13           | 0,13            |
| MEDTRONIC GL 0%22  | EUR        | 399 556,00            | 0,08           | 0,08            |
| NATWEST 0,125%25   | EUR        | 394 006,07            | 0,08           | 0,08            |
| <b>TOTAL</b>       | <b>EUR</b> | <b>400 855 869,56</b> | <b>84,20</b>   | <b>83,71</b>    |
| <b>TOTAL</b>       |            | <b>400 855 869,56</b> | <b>84,20</b>   | <b>83,71</b>    |

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

| Wirtschaftssektor                                    | Prozentsatz   |                |
|--|---------------|----------------|
|  | Nettovermögen | Gesamtvermögen |
| Banken alter ICB-Code                                | 19,83         | 19,71          |
| Automobile und Zulieferer alter ICB-Code             | 13,43         | 13,35          |
| Allgemeine Finanzen Alter ICB-Code                   | 11,16         | 11,09          |
| Industrieller Transport alter ICB-Code               | 7,08          | 7,03           |
| Umkehrimmobilien und Dienstleistungen alter ICB-Code | 4,64          | 4,61           |
| Haushaltsprodukte alter ICB-Code                     | 4,20          | 4,17           |
| Andere Wirtschaftssektoren                           | 21,77         | 21,66          |
| <b>TOTAL</b>   | <b>82,11</b>  | <b>81,62</b>   |

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

| Land          | Prozentsatz   |                |
|---------------|---------------|----------------|
|               | Nettovermögen | Gesamtvermögen |
| FRANKREICH    | 39,68         | 39,44          |
| LUXEMBURG     | 8,07          | 8,02           |
| NIEDERLANDE   | 7,32          | 7,27           |
| ANDERE LÄNDER | 29,13         | 28,98          |
| <b>TOTAL</b>  | <b>84,20</b>  | <b>83,71</b>   |



## AUFTEILUNG ANDERER VERMÖGENSWERTE NACH ART

| Art der Vermögenswerte   | Prozentsatz   |                |
|--|---------------|----------------|
|  | Nettovermögen | Gesamtvermögen |
| <b>ANTEILE DES OGA</b>   | <b>8,95</b>   | <b>8,90</b>    |
| <input type="checkbox"/> OGA und Allzweck-Investmentfonds (Nicht-Profis)   | 8,95          | 8,90           |
| <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>8,95</b>   | <b>8,90</b>    |

## BEWEGUNGEN IM WERTPAPIERPORTFOLIO WÄHREND DES ZEITRAUMS

| Bewegungen während des Zeitraums | Bewegungen (als Betrag) |
|----------------------------------|-------------------------|
| Akquisitionen                    | 664 947 419,97          |
| Veräußerungen                    | 629 410 905,86          |

### 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<br>Anzahl<br>oder<br>nominal | Wechselkurs | Börsen-<br>wert       | % Netto-<br>vermögen |
|--|------------|------------|---------|------------------------------------|-------------|-----------------------|----------------------|
| <b>TOTAL Anleihen und gleichwertige Wertpapiere</b>  |            |            |         |                                    |             | <b>189 747 757,33</b> | <b>39,86</b>         |
| <b>TOTAL Anleihen &amp; gleichwertige Werte gehandelt an einem regulierten oder gleichwertigen Markt</b> |            |            |         |                                    |             | <b>189 747 757,33</b> | <b>39,86</b>         |
| <b>TOTAL Festverzinsliche Anleihen gehandelt an einem regulierten oder gleichwertigen Markt</b>          |            |            |         |                                    |             | <b>134 270 961,77</b> | <b>28,21</b>         |
| <b>TOTAL AUSTRALIEN</b>  |            |            |         |                                    |             | <b>14 054 857,50</b>  | <b>2,95</b>          |
| XS2434401902 MB AUST PAC 0%22-200125   | 20.01.2022 | 20.01.2025 | EUR     | 150                                |             | 14 054 857,50         | 2,95                 |
| <b>TOTAL DEUTSCHLAND</b>   |            |            |         |                                    |             | <b>14 251 415,01</b>  | <b>2,99</b>          |
| DE000BLB81X0 BAYERISCHE_LDBK__0.17%_26062023   | 26.06.2020 | 26.06.2023 | EUR     | 30                                 | 0,17        | 2 942 387,26          | 0,62                 |
| DE000CZ40LR5 COMMERZBANK 0,5%16-130923   | 13.09.2016 | 13.09.2023 | EUR     | 2 000                              | 0,50        | 1 950 355,34          | 0,41                 |
| DE000DL19UC0 DEUTSCHE BANK 1,125%18-300823   | 30.08.2018 | 30.08.2023 | EUR     | 8 182                              | 1,125       | 8 071 451,09          | 1,69                 |
| XS1026109204 FRESENIUS SE 4%14-010224  | 11.02.2014 | 01.02.2024 | EUR     | 1 267                              | 4,00        | 1 287 221,32          | 0,27                 |
| <b>TOTAL FINNLAND</b>  |            |            |         |                                    |             | <b>7 948 040,54</b>   | <b>1,67</b>          |
| XS2101558133 AKTIA BANK 0,1%20-160123 18   | 16.01.2020 | 16.01.2023 | EUR     | 80                                 | 0,10        | 7 948 040,54          | 1,67                 |
| <b>TOTAL FRANKREICH</b>  |            |            |         |                                    |             | <b>15 862 405,68</b>  | <b>3,33</b>          |
| FR0011659366 CREDIT AGRICOLE 3,03%14-210224  | 21.02.2014 | 21.02.2024 | EUR     | 2 000 000                          | 3,03        | 2 010 385,65          | 0,42                 |
| FR0013065372 ILIAD 2,125%15-051222   | 03.12.2015 | 05.12.2022 | EUR     | 27                                 | 2,125       | 2 747 008,11          | 0,58                 |
| FR0013264066 PLASTIC OMNIUM 1,25%17-260624   | 26.06.2017 | 26.06.2024 | EUR     | 10                                 | 1,25        | 942 414,66            | 0,20                 |
| FR0014001YE4 ILIAD 0,75%21-110224  | 11.02.2021 | 11.02.2024 | EUR     | 25                                 | 0,75        | 2 370 821,92          | 0,50                 |
| FR0014002NR7 ARVAL SERV LEAS 0%21-300924   | 30.03.2021 | 30.09.2024 | EUR     | 20                                 |             | 1 853 180,00          | 0,39                 |
| XS1808861840 PSA BANQUE 0,75%18-190423   | 19.04.2018 | 19.04.2023 | EUR     | 3 000                              | 0,75        | 2 971 986,16          | 0,62                 |
| XS1823532640 BNP PARIBAS 1,125%18-221123   | 22.05.2018 | 22.11.2023 | EUR     | 3 000                              | 1,125       | 2 966 609,18          | 0,62                 |
| <b>TOTAL VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>  |            |            |         |                                    |             | <b>12 184 497,59</b>  | <b>2,56</b>          |
| XS2407357768 NATWEST MKTS 0,125%21-121125  | 12.11.2021 | 12.11.2025 | EUR     | 442                                | 0,125       | 394 006,07            | 0,08                 |
| XS2478799948 MITSUBISHI 0,01% 1024   | 11.05.2022 | 10.05.2024 | EUR     | 120                                | 0,01        | 11 790 491,52         | 2,48                 |
| <b>TOTAL IRLAND</b>  |            |            |         |                                    |             | <b>1 279 854,00</b>   | <b>0,27</b>          |
| XS2332254015 FCA BANK 0%21-160424  | 16.04.2021 | 16.04.2024 | EUR     | 1 350                              |             | 1 279 854,00          | 0,27                 |
| <b>TOTAL ITALIEN</b>   |            |            |         |                                    |             | <b>10 114 414,24</b>  | <b>2,12</b>          |

| Bezeichnung der Werte  | Emission   | Fälligkeit | Währung | Menge<br>Anzahl<br>oder<br>nominal | Wechselkurs | Börsen-<br>wert      | % Netto-<br>vermögen |
|--|------------|------------|---------|------------------------------------|-------------|----------------------|----------------------|
| XS1169832810 TELECOM ITALIA 3,25%15-160123   | 16.01.2015 | 16.01.2023 | EUR     | 4 000                              | 3,25        | 4 096 798,90         | 0,86                 |
| XS1754213947 UNICREDIT 1%18-180123   | 18.01.2018 | 18.01.2023 | EUR     | 6 000                              | 1,00        | 6 017 615,34         | 1,26                 |
| <b>TOTAL JAPAN</b>   |            |            |         |                                    |             | <b>5 583 104,17</b>  | <b>1,17</b>          |
| XS2028899727 M BISHI UFJ FINL 0,339%19-0724  | 19.07.2019 | 19.07.2024 | EUR     | 5 000                              | 0,339       | 4 724 975,75         | 0,99                 |
| XS2328980979 ASAHI GROUP HD 0,01%21-190424   | 19.04.2021 | 19.04.2024 | EUR     | 900                                | 0,01        | 858 128,42           | 0,18                 |
| <b>TOTAL LUXEMBURG</b>   |            |            |         |                                    |             | <b>18 409 980,29</b> | <b>3,87</b>          |
| DE000A3KYMA6 TRATON FIN LUX 0,125%21-101124  | 10.11.2021 | 10.11.2024 | EUR     | 67                                 | 0,125       | 6 216 349,02         | 1,31                 |
| XS1909193150 ALLERGAN FUND 1,5%18-151123   | 15.11.2018 | 15.11.2023 | EUR     | 3 180                              | 1,50        | 3 152 569,23         | 0,66                 |
| XS2020670696 MEDTRONIC GLOB 0%19-021222  | 02.07.2019 | 02.12.2022 | EUR     | 400                                |             | 399 556,00           | 0,08                 |
| XS2240133459 MEDTRONIC GLOB 0%20-150323  | 25.09.2020 | 15.03.2023 | EUR     | 2 000                              |             | 1 982 320,00         | 0,42                 |
| XS2406913884 HIGHLAND HLDGS 0%21-121123  | 11.11.2021 | 12.11.2023 | EUR     | 6 903                              |             | 6 659 186,04         | 1,40                 |
| <b>TOTAL NIEDERLANDE</b>   |            |            |         |                                    |             | <b>24 108 197,31</b> | <b>5,08</b>          |
| XS1882544627 ING GROUP 1%18-200923   | 20.09.2018 | 20.09.2023 | EUR     | 50                                 | 1,00        | 4 907 817,81         | 1,03                 |
| XS2349789185 TOYOTA MOTOR FI 0%21-070624   | 07.06.2021 | 07.06.2024 | EUR     | 100                                |             | 9 517 050,00         | 2,01                 |
| XS2407913586 THERMO FISHER SCI.NTS 31122200  | 18.11.2021 | 18.11.2023 | EUR     | 5 000                              |             | 4 841 900,00         | 1,02                 |
| XS2469143205 NIBC BANK 0%22-131023   | 13.04.2022 | 13.10.2023 | EUR     | 50                                 |             | 4 841 429,50         | 1,02                 |
| <b>TOTAL SCHWEDEN</b>  |            |            |         |                                    |             | <b>9 112 385,40</b>  | <b>1,91</b>          |
| XS2115085230 VOLVO TREASURY 0%20-110223  | 11.02.2020 | 11.02.2023 | EUR     | 2 460                              |             | 2 441 525,40         | 0,51                 |
| XS2402009539 VOLVO TREASURY 0%21-090524  | 09.11.2021 | 09.05.2024 | EUR     | 7 000                              |             | 6 670 860,00         | 1,40                 |
| <b>TOTAL VEREINIGTE STAATEN AMERIKA</b>  |            |            |         |                                    |             | <b>1 361 810,04</b>  | <b>0,29</b>          |
| XS2375836470 BECTON DICKINSON&CO 0%21-0823   | 13.08.2021 | 13.08.2023 | EUR     | 750                                |             | 732 015,00           | 0,16                 |
| XS2375836553 BECTON DICKINSON&C 0,034%21-25  | 13.08.2021 | 13.08.2025 | EUR     | 692                                | 0,034       | 629 795,04           | 0,13                 |
| <b>TOTAL Variabel verzinsliche, revidierbare Anleihen, die an einem regulierten oder gleichwertigen Markt gehandelt werden</b> |            |            |         |                                    |             | <b>53 246 228,88</b> | <b>11,18</b>         |
| <b>TOTAL SPANIEN</b>   |            |            |         |                                    |             | <b>8 062 813,83</b>  | <b>1,69</b>          |
| XS1689234570 BANCO SANTANDER TV17-280323   | 28.09.2017 | 28.03.2023 | EUR     | 35                                 |             | 3 510 673,83         | 0,74                 |
| XS2476266205 BANCO SANTANDER TV05052024  | 05.05.2022 | 05.05.2024 | EUR     | 45                                 |             | 4 552 140,00         | 0,95                 |
| <b>TOTAL FRANKREICH</b>  |            |            |         |                                    |             | <b>2 004 217,83</b>  | <b>0,42</b>          |
| FR0013321791 SOCIETE GENERALE TV18-060323  | 06.03.2018 | 06.03.2023 | EUR     | 10                                 |             | 1 002 013,44         | 0,21                 |
| FR0013323672 BPCE TV18-230323  | 23.03.2018 | 23.03.2023 | EUR     | 10                                 |             | 1 002 204,39         | 0,21                 |

| Bezeichnung der Werte   | Emission   | Fälligkeit | Währung | Menge<br>Anzahl<br>oder<br>nominal | Wechselkurs | Börsen-<br>wert       | % Netto-<br>vermögen |
|---|------------|------------|---------|------------------------------------|-------------|-----------------------|----------------------|
| <b>TOTAL VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>   |            |            |         |                                    |             | <b>8 023 240,00</b>   | <b>1,69</b>          |
| XS2381633150 CS AG LDN TV21-010923  | 01.09.2021 | 01.09.2023 | EUR     | 8 000                              |             | 8 023 240,00          | 1,69                 |
| <b>TOTAL NIEDERLANDE</b>  |            |            |         |                                    |             | <b>10 728 493,44</b>  | <b>2,25</b>          |
| DE000A3KY367 ALLIANZ FINANCE II TV21-221124   | 22.11.2021 | 22.11.2024 | EUR     | 76                                 |             | 7 715 835,19          | 1,62                 |
| XS2292545535 NIBC BANK TV21-270123  | 27.01.2021 | 27.01.2023 | EUR     | 30                                 |             | 3 012 658,25          | 0,63                 |
| <b>TOTAL VEREINIGTE STAATEN AMERIKA</b>   |            |            |         |                                    |             | <b>24 427 463,78</b>  | <b>5,13</b>          |
| XS1767930826 FORD MOTOR CRED TV18-071222  | 07.02.2018 | 07.12.2022 | EUR     | 8 400                              |             | 8 378 598,90          | 1,76                 |
| XS2338355360 GOLDMAN SACHS GROUP TV300424 EMTN  | 30.04.2021 | 30.04.2024 | EUR     | 16 000                             |             | 16 048 864,88         | 3,37                 |
| <b>TOTAL Indexierte Anleihen, die an einem regulierten oder gleichwertigen Markt gehandelt werden</b> |            |            |         |                                    |             | <b>1 192 532,84</b>   | <b>0,25</b>          |
| <b>TOTAL FRANKREICH</b>   |            |            |         |                                    |             | <b>1 192 532,84</b>   | <b>0,25</b>          |
| FR0014007KL5 RCI BANQUE 0,5%22-140725   | 14.01.2022 | 14.07.2025 | EUR     | 1 333                              | 0,50        | 1 192 532,84          | 0,25                 |
| <b>TOTAL Nachrangige Wertpapiere (TSR - TSDI)</b>   |            |            |         |                                    |             | <b>1 038 033,84</b>   | <b>0,22</b>          |
| <b>TOTAL FRANKREICH</b>   |            |            |         |                                    |             | <b>1 038 033,84</b>   | <b>0,22</b>          |
| FR0011440130 MACIF 5,5%13-080323  | 08.03.2013 | 08.03.2023 | EUR     | 10                                 | 5,50        | 1 038 033,84          | 0,22                 |
| <b>TOTAL Schuldverschreibungen</b>  |            |            |         |                                    |             | <b>211 108 112,23</b> | <b>44,35</b>         |
| <b>TOTAL An einem regulierten oder gleichwertigen Markt gehandelte Schuldtitel</b>                    |            |            |         |                                    |             | <b>211 108 112,23</b> | <b>44,35</b>         |
| <b>TOTAL Handelbare Schuldtitel</b>   |            |            |         |                                    |             | <b>211 108 112,23</b> | <b>44,35</b>         |
| <b>TOTAL FRANKREICH</b>   |            |            |         |                                    |             | <b>168 782 780,13</b> | <b>35,46</b>         |
| FR0125927485 CFCMOC BMT21102022   | 21.10.2019 | 21.10.2022 | EUR     | 5 000 000                          | 0,42        | 5 005 261,63          | 1,05                 |
| FR0126526104 SOPRA BMT24112023  | 24.11.2020 | 24.11.2023 | EUR     | 7 000 000                          | 0,80        | 7 038 217,28          | 1,48                 |
| FR0126526849 NEXITY BMT09122022   | 09.12.2020 | 09.12.2022 | EUR     | 7 000 000                          | 0,737       | 7 035 751,05          | 1,48                 |
| FR0126704693 EDR.FR BMT10022023   | 10.02.2021 | 10.02.2023 | EUR     | 5 000 000                          | 0,53        | 5 009 631,67          | 1,05                 |
| FR0126868886 KORIAN BMT 150623  | 11.06.2021 | 15.06.2023 | EUR     | 7 000 000                          | 0,90        | 7 050 045,41          | 1,48                 |
| FR0126988288 EDR(FR BMT11082023   | 11.08.2021 | 11.08.2023 | EUR     | 3 000 000                          | 0,48        | 3 004 446,15          | 0,63                 |
| FR0127014407 ALTARE BMT 220323  | 22.09.2021 | 22.03.2023 | EUR     | 10 000 000                         | 0,125       | 10 023 372,39         | 2,11                 |
| FR0127014589 EDR(FR BMT27092023   | 27.09.2021 | 27.09.2023 | EUR     | 2 000 000                          | 0,48        | 2 003 735,69          | 0,42                 |
| FR0127147181 NEXITY BMT24112023   | 24.11.2021 | 24.11.2023 | EUR     | 5 000 000                          | 0,80        | 5 017 115,06          | 1,05                 |
| FR0127201889 F.MARC NCP06012023   | 05.01.2022 | 06.01.2023 | EUR     | 3 000 000                          |             | 2 989 078,34          | 0,63                 |
| FR0127238048 FAUREC NCP24012023   | 19.01.2022 | 24.01.2023 | EUR     | 3 000 000                          |             | 2 979 640,08          | 0,63                 |

| Bezeichnung der Werte  | Emission   | Fälligkeit | Währung | Menge<br>Anzahl<br>oder<br>nominal | Wechselkurs | Börsen-<br>wert      | % Netto-<br>vermögen |
|--|------------|------------|---------|------------------------------------|-------------|----------------------|----------------------|
| FR0127357194 VERALL NCP26102022  | 22.04.2022 | 26.10.2022 | EUR     | 4 000 000                          |             | 3 999 123,85         | 0,84                 |
| FR0127395061 BELLON NCP27102022  | 27.07.2022 | 27.10.2022 | EUR     | 7 000 000                          |             | 6 998 383,54         | 1,47                 |
| FR0127396341 IMERYS NCP 021122   | 29.04.2022 | 02.11.2022 | EUR     | 15 000 000                         |             | 14 992 436,45        | 3,14                 |
| FR0127486894 STEF NCP21102022  | 19.07.2022 | 21.10.2022 | EUR     | 12 000 000                         |             | 11 992 706,40        | 2,52                 |
| FR0127487165 F.MARC NCP25102022  | 21.07.2022 | 25.10.2022 | EUR     | 6 000 000                          |             | 5 999 240,37         | 1,26                 |
| FR0127529941 BOLLOR NCP26102022  | 22.07.2022 | 26.10.2022 | EUR     | 10 000 000                         |             | 9 997 225,05         | 2,10                 |
| FR0127532028 ELIS NCP02112022  | 28.07.2022 | 02.11.2022 | EUR     | 6 000 000                          |             | 5 995 474,26         | 1,26                 |
| FR0127538421 PLAOMN NCP07112022  | 05.08.2022 | 07.11.2022 | EUR     | 10 000 000                         |             | 9 992 306,72         | 2,10                 |
| FR0127562306 FINAGA NCP17112022  | 12.08.2022 | 17.11.2022 | EUR     | 10 000 000                         |             | 9 993 350,32         | 2,10                 |
| FR0127586917 BOLLOR NCP17102022  | 14.09.2022 | 17.10.2022 | EUR     | 11 700 000                         |             | 11 695 064,02        | 2,46                 |
| FR0127587840 FAUREC NCP19102022  | 15.09.2022 | 19.10.2022 | EUR     | 10 000 000                         |             | 9 993 457,12         | 2,10                 |
| FR0127588582 L.D.C. NCP30112022  | 28.09.2022 | 30.11.2022 | EUR     | 10 000 000                         |             | 9 977 717,28         | 2,10                 |
| <b>TOTAL VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>                                      |            |            |         |                                    |             | <b>12 342 739,05</b> | <b>2,59</b>          |
| XS2524768228 CD STD CHARTE.0824  | 19.08.2022 | 19.08.2024 | EUR     | 13 000 000                         |             | 12 342 739,05        | 2,59                 |
| <b>TOTAL ITALIEN</b>   |            |            |         |                                    |             | <b>9 994 804,50</b>  | <b>2,10</b>          |
| XS2537266368 FINCANTIER1022  | 19.09.2022 | 19.10.2022 | EUR     | 10 000 000                         |             | 9 994 804,50         | 2,10                 |
| <b>TOTAL LUXEMBURG</b>   |            |            |         |                                    |             | <b>19 987 788,55</b> | <b>4,20</b>          |
| FR0127545319 L OCCI NCP21102022  | 20.09.2022 | 21.10.2022 | EUR     | 20 000 000                         |             | 19 987 788,55        | 4,20                 |
| <b>TOTAL Wertpapiere des OGA</b>   |            |            |         |                                    |             | <b>42 613 891,46</b> | <b>8,95</b>          |
| <b>TOTAL OGAW und gleichwertige Fonds aus anderen EU-Mitgliedstaaten</b> |            |            |         |                                    |             | <b>42 613 891,46</b> | <b>8,95</b>          |
| <b>TOTAL FRANKREICH</b>  |            |            |         |                                    |             | <b>42 613 891,46</b> | <b>8,95</b>          |
| FR0007033477 CM-AM INSTIT.SH.TERM RC SI.6D                               |            |            | EUR     | 73,42                              |             | 158 162,10           | 0,03                 |
| FR0007081088 CM-AM CREDIT LOW DURATION (RD)                              |            |            | EUR     | 94,748                             |             | 2 532 774,16         | 0,53                 |
| FR0014007LZ3 CM-AM INSTITUTIONAL SHORT TERM (IC)                         |            |            | EUR     | 401,022                            |             | 39 922 955,20        | 8,39                 |
| <b>TOTAL Finanzverträge</b>  |            |            |         |                                    |             | <b>155 095,78</b>    | <b>0,03</b>          |
| <b>TOTAL Finanzkontrakte mit Margin Call</b>                             |            |            |         |                                    |             | <b>-2 780 551,71</b> | <b>-0,58</b>         |
| MARS.EUR Margin-Swap-Calls   |            |            | EUR     | -2 780 551,71                      |             | -2 780 551,71        | -0,58                |
| <b>TOTAL Sonstige Verpflichtungen</b>                                    |            |            |         |                                    |             | <b>2 935 647,49</b>  | <b>0,61</b>          |
| <b>TOTAL Swaps</b>   |            |            |         |                                    |             | <b>2 935 647,49</b>  | <b>0,61</b>          |

| Bezeichnung der Werte             | Emission | Fälligkeit | Währung | Menge<br>Anzahl<br>oder<br>nominal | Wechselkurs | Börsen-<br>wert | % Netto-<br>vermögen |
|-----------------------------------|----------|------------|---------|------------------------------------|-------------|-----------------|----------------------|
| T21002256575 SWTCIC060724-.5073/O |          |            | EUR     | -12 000 000                        |             | 629 867,08      | 0,13                 |
| T21002320071 SWTCIC210423-.508/OI |          |            | EUR     | -20 000 000                        |             | 270 275,67      | 0,06                 |
| T21002335318 SWTCIC171123-.43/OIS |          |            | EUR     | -35 000 000                        |             | 1 058 010,35    | 0,21                 |
| T22002454247 SWTCIC201023.216/OIS |          |            | EUR     | -20 000 000                        |             | 376 157,22      | 0,08                 |
| T22002454299 SWTCIC220424.485/OIS |          |            | EUR     | -10 000 000                        |             | 262 461,40      | 0,06                 |
| T22002461197 SWTCIC060524.733/OIS |          |            | EUR     | -15 000 000                        |             | 338 875,77      | 0,07                 |

## 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.