

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

Informationsdokument vom 30.09.2024

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

Inhalt

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR	3
NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART OU ACTION	4
ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR	5
MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR	6
DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE	7
RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR DEVISE	8
RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR SECTEUR ÉCONOMIQUE	9
RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR	10
VENTILATION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE	11
COMMISSION DE PERFORMANCE	12
INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)	13
INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE	17
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS	18
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS	19
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE	20
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT	21
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS	22
INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	23
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	24
SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE	25

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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	87 838 137,15
b) Bankguthaben	12 664 697,19
c) Sonstige Aktiva des OGAW	12 171 699,08
d) Vom OGAW gehaltene Vermögenswerte insgesamt	112 674 533,42
e) Passiva	-237 609,93
f) Nettoinventarwert	112 436 923,49

* Negative Beträge sind mit einem Minuszeichen gekennzeichnet

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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)
FR0013384617	ANTEILSKLASSE THES. IC	Thesaurierbar	EUR	34 763 397,25	3 286 374,965	10,57
FR0013384591	ANTEILSKLASSE THES. RC	Thesaurierbar	EUR	56 364 141,61	3 511 045,578836	16,05
FR0013481082	ANTEILSKLASSE THES. S	Thesaurierbar	EUR	8 540 597,04	252 494,771	33,82
FR0013481074	ANTEILSKLASSE AUSSCH. RD	Ausschüttbar	EUR	12 768 787,59	455 975,687814	28,00

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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	77,93	77,76
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	0,19	0,20
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	9,50	9,48

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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	146 774 544,60	152 236 680,74
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	3 409 783,72	3 698 999,39
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	2 600 000,00	2 606 826,26

Veränderung im Berichtszeitraum	Veränderung (Betrag)
Käufe	152 784 328,32
Veräußerungen	158 542 506,39

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

AUSSCHÜTTUNGEN IM BERICHTSZEITRAUM

	Anteilsklasse	Nettobetrag je Anteil	Steuerguthaben	Bruttobetrag je Anteil
Ausgeschüttete Dividenden				
20/08/2024	ANTEILSKLASSE AUSSCH. RD	0,37	0,01	0,38
Auszuschüttende Dividenden				

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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

Währung	Betrag (EUR)	Prozentsatz	
		Nettovermögen	Gesamtvermögen
Euro	83 167 616,68	73,97	73,81
US-Dollar	4 537 746,59	4,03	4,03
Pfund Sterling	132 773,88	0,12	0,12
Summe	87 838 137,15	78,12	77,96

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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

Wirtschaftssektor	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
Luft- und Raumfahrt / Rüstung	11,55	11,53
Elektronik / Elektrische Geräte	10,38	10,36
Unterstützungsdienste für Unternehmen	8,01	7,99
Festnetztelefonie	6,37	6,36
Allgemeine Finanzen	5,55	5,54
Inv. Immobilien und Dienstl.	5,33	5,32
Reise und Freizeit	4,57	4,56
Bau / Grundstoffe	3,67	3,67
Staatsanleihen	3,56	3,55
Automobil und Zulieferer	3,13	3,12
EDV-Geräte und -Ausrüstung	2,77	2,77
Software / EDV-Dienstleistungen	2,30	2,30
Gesundheitseinrichtungen und -dienste	1,87	1,87
Getränke	1,58	1,58
Industrieller Transport	1,48	1,47
Gas, Wasser und sonstige Versorgungsdienste	1,43	1,43
Pharmazeutische u. Biotechnologie-Industrie	0,87	0,86
	0,66	0,66
Produkte für den Hausgebrauch	0,65	0,65
Allgemeine Industrie	0,64	0,64
Mehrgefahrenversicherungen	0,40	0,39
Banken	0,32	0,31
Chemie	0,28	0,28
Medien	0,27	0,27
Einzelhandel	0,16	0,16
Strom	0,13	0,13
Ausrüstg. Dienstleistg./Vertr. Erdölprod.	0,10	0,10
Industrielles Ingenieurwesen	0,09	0,09
ALTERNATIVE ENERGIEN	0,00	0,00
Summe	78,12	77,96

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH DEM SITZLAND DES EMITTENTEN

Land	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
Frankreich	43,22	43,13
Spanien	10,44	10,42
Deutschland	10,14	10,12
Italien	6,09	6,07
Niederlande	5,01	5,00
Vereinigtes Königreich	1,28	1,28
Schweiz	1,28	1,28
Belgien	0,42	0,42
USA	0,24	0,24
Summe	78,12	77,96

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

AUFSCHLÜSSELUNG DER SONSTIGEN VERMÖGENSWERTE E) DES WERTPAPIERPORTFOLIOS NACH ART

Art des Wertpapiers	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
OGA-Anteile	9,50	9,48
Summe OGAW und vergleichbare Titel aus anderen EU-Mitgliedstaaten	9,50	9,48
Summe AIF und vergleichbare Titel aus anderen EU-Mitgliedstaaten	0,00	0,00
Sonstige OGA und Investmentfonds	0,00	0,00
Sonstige Aktiva	0,00	0,00
Summe	9,50	9,48

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

AN DIE WERTENTWICKLUNG GEBUNDENE GEBÜHREN

ANTEILSKLASSE THES. IC	30.09.2024
An die Wertentwicklung gebundene Gebühren (variable Kosten)	0,00
Prozentualer Anteil der an die Wertentwicklung gebundenen	0,00

ANTEILSKLASSE THES. RC	30.09.2024
An die Wertentwicklung gebundene Gebühren (variable Kosten)	0,00
Prozentualer Anteil der an die Wertentwicklung gebundenen	0,00

ANTEILSKLASSE THES. S	30.09.2024
An die Wertentwicklung gebundene Gebühren (variable Kosten)	0,00
Prozentualer Anteil der an die Wertentwicklung gebundenen	0,00

ANTEILSKLASSE AUSSCH. RD	30.09.2024
An die Wertentwicklung gebundene Gebühren (variable Kosten)	0,00
Prozentualer Anteil der an die Wertentwicklung gebundenen	0,00

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

AUFSTELLUNG DER ZULÄSSIGEN AKTIVA UND PASSIVA (OHNE TFI)

Instrumente	Währung	Menge	Betrag	%NV
Aktien und aktienähnliche Wertpapiere			8 877 319,39	7,89
An einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelte Aktien und ähnliche Wertpapiere			8 877 319,39	7,89
Luft- und Raumfahrt / Rüstung			84 000,00	0,07
MTU AERO ENGINES	EUR	300	84 000,00	0,07
Mehrfahrenversicherungen			444 870,00	0,40
MUNCHENER RUCKVERSICHERUNGS	EUR	900	444 870,00	0,40
Automobil und Zulieferer			100 010,00	0,09
FERRARI NV	EUR	100	41 970,00	0,04
MERCEDES-BENZ GROUP	EUR	1 000	58 040,00	0,05
Banken			355 026,00	0,32
BNP PARIBAS ACTIONS A	EUR	2 000	123 100,00	0,11
CAIXABANK	EUR	22 000	118 008,00	0,11
ING GROEP	EUR	7 000	113 918,00	0,10
Chemie			311 868,00	0,28
AIR LIQUIDE	EUR	1 800	311 868,00	0,28
Einzelhandel			179 419,86	0,16
AMAZON COM	USD	310	51 883,86	0,05
INDITEX	EUR	2 400	127 536,00	0,11
Bau / Grundstoffe			351 546,46	0,31
CRH PLC	GBP	600	49 182,46	0,04
SAINT-GOBAIN	EUR	3 700	302 364,00	0,27
Strom			143 500,00	0,13
ENEL	EUR	20 000	143 500,00	0,13
Elektronik / Elektrische Geräte			770 830,00	0,69
LEGRAND	EUR	700	72 310,00	0,07
NEXANS	EUR	3 500	460 600,00	0,41
PRYSMIAN	EUR	2 200	143 440,00	0,13
SCHNEIDER ELECTRIC	EUR	400	94 480,00	0,08
ALTERNATIVE ENERGIEN			3 165,83	0,00
ABENGOA CL.B	EUR	487 051	3 165,83	0,00
Gesundheitseinrichtungen und -dienste			578 121,80	0,51
ESSILORLUXOTTICA	EUR	2 350	499 610,00	0,44
QIAGEN	EUR	1 940	78 511,80	0,07
Ausrüstg. Dienstleistg./Vertr. Erdölprod.			114 030,00	0,10
GAZTRANSPORT TECHNIGAZ	EUR	900	114 030,00	0,10
Allgemeine Finanzen			84 280,00	0,07
DEUTSCHE BOERSE	EUR	400	84 280,00	0,07
Gas, Wasser und sonstige Versorgungsdienste			29 520,00	0,03
VEOLIA ENVIRONNEMENT	EUR	1 000	29 520,00	0,03
Pharmazeutische u. Biotechnologie-Industrie			975 281,42	0,87
ASTRAZENECA PLC	GBP	600	83 591,42	0,07
SANOFI	EUR	4 100	421 890,00	0,38
UCB	EUR	2 900	469 800,00	0,42

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

AUFSTELLUNG DER ZULÄSSIGEN AKTIVA UND PASSIVA (OHNE TFI)

Instrumente	Währung	Menge	Betrag	%NV
Allgemeine Industrie			725 360,00	0,65
SIEMENS	EUR	4 000	725 360,00	0,65
Industrielles Ingenieurwesen			103 200,00	0,09
KRONES	EUR	800	103 200,00	0,09
Inv. Immobilien und Dienstl.			1 273 911,00	1,13
LEG IMMOBILIEN	EUR	6 200	581 436,00	0,52
LEG IMMOBILIEN	EUR	21 000	348 810,00	0,31
VONOVIA	EUR	10 500	343 665,00	0,30
Software / EDV-Dienstleistungen			101 664,43	0,09
META PLATFORMS CLA	USD	100	51 418,31	0,05
MICROSOFT	USD	130	50 246,12	0,04
EDV-Geräte und -Ausrüstung			125 840,00	0,11
INFINEON TECHNOLOGIES	EUR	4 000	125 840,00	0,11
Medien			302 600,00	0,27
WOLTERS KLUWER	EUR	2 000	302 600,00	0,27
Produkte für den Hausgebrauch			732 694,57	0,65
DECKERS OUTDOOR	USD	200	28 644,57	0,03
HERMES INTERNATIONAL	EUR	150	330 900,00	0,29
L'OREAL	EUR	500	201 025,00	0,18
LVMH MOET HENNESSY VUITTON	EUR	250	172 125,00	0,15
Unterstützungsdienste für Unternehmen			36 540,02	0,03
AMERICAN EXPRESS	USD	150	36 540,02	0,03
Festnetztelefonie			950 040,00	0,84
DEUTSCHE TELEKOM	EUR	36 000	950 040,00	0,84
Anleihen			74 962 297,76	66,67
In Aktien wandelbare Anleihen, die an einem geregelten Markt gehandelt werden			73 299 280,20	65,19
Luft- und Raumfahrt / Rüstung			11 548 680,08	10,27
MTU 0,05%19-180327 CONV.	EUR	20	1 963 202,47	1,75
RHMGR 1 7/8 02/07/28	EUR	2	325 410,65	0,29
RHMGR 2 1/4 02/07/30	EUR	5	835 656,96	0,74
SAFFP 0 04/01/28	EUR	38 000	8 424 410,00	7,49
Automobil und Zulieferer			3 107 880,00	2,76
PCIM 0 12/22/25	EUR	30	3 107 880,00	2,76
Getränke			1 775 518,97	1,58
DAV CAM MIL 2,375%24-170129 CV	EUR	18	1 775 518,97	1,58
Bau / Grundstoffe			3 780 207,30	3,36
SPIEFP 2 01/17/28	EUR	32	3 780 207,30	3,36
			747 231,44	0,67
LEGGR 1 09/04/30	EUR	7	747 231,44	0,67
Elektronik / Elektrische Geräte			10 899 346,70	9,69
SUFP 1.97 11/27/30	EUR	53	6 708 857,52	5,96
SUFP 1 5/8 06/28/31	EUR	40	4 190 489,18	3,73
ALTERNATIVE ENERGIEN			17,11	0,00
ABENGOA 2 1,5%19-261024	EUR	165 622	17,11	0,00

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

AUFSTELLUNG DER ZULÄSSIGEN AKTIVA UND PASSIVA (OHNE TFI)

Instrumente	Währung	Menge	Betrag	%NV
Gesundheitseinrichtungen und -dienste			1 523 961,20	1,36
QIAGEN 17122027	USD	9	1 523 961,20	1,36
Allgemeine Finanzen			6 152 920,93	5,47
IBESM 0.8 12/07/27	EUR	25	2 790 218,44	2,48
ORPAR 2%24-070231 EXCH	EUR	2	189 505,09	0,17
WENDEL 2,625% 270326	EUR	30	3 173 197,40	2,82
Gas, Wasser und sonstige Versorgungsdienste			1 580 750,00	1,41
VEOLIA 0%19-010125 CONV.REGS	EUR	50 000	1 580 750,00	1,41
Inv. Immobilien und Dienstl.			4 715 978,80	4,20
ARMISG 0 06/25/25	EUR	20	1 946 400,00	1,73
LEG IMMOBILIEN AG 0,4% 300628	EUR	20	1 828 957,39	1,63
TAG IMMOBIL.0,625%20-0826 CV	EUR	10	940 621,41	0,84
Software / EDV-Dienstleistungen			2 486 166,23	2,21
AMSSM 1 1/2 04/09/25	EUR	20	2 486 166,23	2,21
EDV-Geräte und -Ausrüstung			2 994 296,03	2,66
BE SEMICONDUCTOR INDUS 1,87%060429	EUR	8	1 050 280,07	0,93
SOITEC 0%20-011025 CONV.REGS	EUR	3 000	503 283,00	0,45
STMICROELECT.0%20-040827 CO CO	USD	8	1 440 732,96	1,28
Unterstützungsdienste für Unternehmen			8 964 496,08	7,97
ELISGP 2 1/4 09/22/29	EUR	21	2 718 967,52	2,42
NEXI 0%24022028	EUR	20	1 740 880,00	1,55
NEXI 1,75%20-240427 CV	EUR	18	1 707 998,56	1,52
WORLDLINE 0%20-300725 OCEANE	EUR	25 000	2 796 650,00	2,48
Festnetztelefonie			6 217 990,54	5,53
CELLNEX 0,75%20-201131 CV	EUR	28	2 483 644,52	2,21
CELLNEX TELECOM 0,5%19-0728 CV	EUR	12	1 284 047,01	1,14
CELLNEX TELECOM 2,125%23-30 CV	EUR	23	2 450 299,01	2,18
Industrieller Transport			1 661 038,79	1,48
DHLGR 0.05 06/30/25	EUR	17	1 661 038,79	1,48
Reise und Freizeit			5 142 800,00	4,57
ACFP 0.7 12/07/27	EUR	100 000	5 142 800,00	4,57
Sonstige an einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelte Anleihen und ähnliche Wertpapiere			1 663 017,56	1,48
Luft- und Raumfahrt / Rüstung			1 354 319,55	1,21
ROLLS-ROYCE 3,625%15-141025	USD	1 500	1 354 319,55	1,21
Automobil und Zulieferer			307 869,90	0,27
CIE PLASTIC 4,875%13032029	EUR	3	307 869,90	0,27
ALTERNATIVE ENERGIEN			828,11	0,00
ABENGOA ABEN.2 1,5%19-24 INDEX	EUR	165 622	828,11	0,00
Schuldtitel			3 998 520,00	3,56
An einem organisierten oder gleichwertigen Markt gehandelte Schuldtitel			3 998 520,00	3,56
Staatsanleihen			3 998 520,00	3,56
FRA.BT BNT02102024	EUR	2 000 000	1 999 820,00	1,78
FRA.BT BNT09102024	EUR	2 000 000	1 998 700,00	1,78

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

AUFSTELLUNG DER ZULÄSSIGEN AKTIVA UND PASSIVA (OHNE TFI)

Instrumente	Währung	Menge	Betrag	%NV
Anteile von OGA und Investmentfonds			10 678 163,74	9,50
OGAW und vergleichbare Titel aus anderen EU-Mitgliedstaaten			10 678 163,74	9,50
CM-AM CONVICTS USA-ICEURACC	EUR	1,698	231 167,32	0,21
CM-AM DOLLAR CASH-C	USD	2 645,664	5 026 048,68	4,47
CM-AM HIGH YIELD 2026-ICEUR	EUR	26,631	2 718 873,04	2,42
CM-AM OBL CR 29 IC EUR C.	EUR	26	2 702 074,70	2,40
Summe			98 516 300,89	87,62

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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 (*)
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 CONVERTIBLES EUROPE

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 CONVERTIBLES EUROPE

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				
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 CONVERTIBLES EUROPE

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				
EURUSD-CME 1224	60,00	53 526,68	0,00	0,00
Untersumme		53 526,68	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		53 526,68	0,00	0,00

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

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

TERMINFINANZINSTRUMENTE – KREDITRISIKO

Terminfinanzinstrumente – 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 CONVERTIBLES EUROPE

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				
STX50E-EUX 1224	30,00	17 100,00	0,00	1 500 135,00
Untersumme		17 100,00	0,00	1 500 135,00
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		17 100,00	0,00	1 500 135,00

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

CM-AM CONVERTIBLES EUROPE

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	Fremdwährungs-forderungen (+)		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 CONVERTIBLES EUROPE

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – DEVISEN (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 CONVERTIBLES EUROPE

ZUSAMMENFASSENDE AUFSTELLUNG

	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert
Summe Aufstellung der zulässigen Aktiva und Passiva (ohne TFI)	98 516 300,89
Aufstellung der TFI (ohne TFI, die zur Absicherung ausgegebener Anteile verwendet werden):	
Summe Devisen-Termingeschäfte	0,00
Summe Termin-Finanzinstrumente – Aktien	0,00
Summe Termin-Finanzinstrumente – Zinssätze	0,00
Summe Termin-Finanzinstrumente – Devisen	53 526,68
Summe Termin-Finanzinstrumente – Anleihen	0,00
Summe Termin-Finanzinstrumente – Sonstige Engagements	17 100,00
Aufstellung der Termin-Finanzinstrumente, die zur Absicherung ausgegebener Anteile verwendet werden	0,00
Sonstige Aktiva (+)	14 087 605,85
Sonstige Passiva (-)	-237 609,93
Summe = Nettovermögen	112 436 923,49

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 Anleger Der ausführliche Verkaufsprospekt, die Ausgabe und Rücknahmepreise, die Wesentlichen Anlegerinformation bzw. Basisinformationsblatt, 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.

- e) Beschwerden können kostenlos an die Zahl- und Informationsstelle TARGOBANK AG, Kasernenstraße 10, 40213 Düsseldorf, Deutschland, oder an die Verwaltungsgesellschaft CM-AM SICAV, 4 rue Gaillon - 75002 PARIS, gerichtet werden.

VERÖFFENTLICHUNG VON PREISEN UND MITTEILUNGEN AN DIE AKTIONÄRE

Die jüngsten Ausgabe- und Rücknahmepreise für die Anteile (Nettoinventarwert) werden auf der Website der Gesellschaft unter www.creditmutuel-am.eu veröffentlicht.

Informationen und Mitteilungen an die Anteilinhaber werden auf der Website der Gesellschaft unter www.creditmutuel-am.eu veröffentlicht und sind bei der Fazilitätsstelle erhältlich.

In den folgenden Fällen werden die Mitteilungen an die Aktionäre in Deutschland auf einem dauerhaften Datenträger veröffentlicht und zusätzlich auf der Website der Gesellschaft, www.creditmutuel-am.eu :

- - Aussetzung des Rückkaufs von Anteilen der Gesellschaft oder eines ihrer Teilfonds;
- - Beendigung der Verwaltung oder Auflösung der Gesellschaft oder eines ihrer Teilfonds;
- Änderungen der Bedingungen, die nicht mit der bestehenden Anlagepolitik vereinbar sind, die wesentliche Rechte der Anteilhaber berühren oder die Erstattung von Kosten betreffen, die von der Gesellschaft übernommen werden können Änderungen der Anlagebedingungen, die nicht mit der bestehenden Anlagepolitik vereinbar sind, die wesentliche Rechte der Anteilhaber berühren oder die sich auf die Erstattung von Aufwendungen auswirken, die von der Gesellschaft übernommen werden können, einschließlich der Gründe für die Änderungen und der Rechte der Anteilhaber in verständlicher Form sowie ihrer Möglichkeiten, sich darüber zu informieren; Im Falle einer Verschmelzung der Gesellschaft oder eines ihrer Teilfonds in Form von Verschmelzungsinformationen, die gemäß Artikel 43 der Richtlinie 2009/65/EG zu erstellen sind;
- Im Falle der Umwandlung der Gesellschaft oder eines ihrer Teilfonds in einen Feeder-Fonds. - Im Falle der Umwandlung der Gesellschaft oder eines ihrer Teilfonds in einen Feeder-Fonds.
- Im Falle einer Änderung eines Master-Fonds, in Form von Informationen, die gemäß Artikel 64 der Richtlinie 2009/65/E