CM-CIC GREEN BONDS

HALBJAHRESBERICHT ZUM 30.09.2020

RECHTSFORM DES OGA

Klassische SICAV

KLASSIFIKATION

Nach EZB-Richtlinie als Anleihenfonds klassifiziert

ERTRAGSVERWENDUNG

Thesaurierung

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

Elemente des Vermögens	Betrag zum Ende des Berichtszeitraums*
a) Unter Ziffer I Punkt 1 von Artikel L. 214-20 aufgeführte, zulässige Wertpapiere	34.979.876,70
b) Bankguthaben	672.082,42
c) Sonstige vom OGAW gehaltene Aktiva	352.024,90
d) Gesamte vom OGAW gehaltene Aktiva	36.003.984,02
e) Passiva	-192.062,14
f) Nettoinventarwert	35.811.921,88

*** Die Beträge sind gezeichnet**

ANZAHL DER IM UMLAUF BEFINDLICHEN ANTEILE UND NETTOINVENTARWERT PRO ANTEIL ODER AKTIE

Anteilklasse	Art des Anteils	Nettovermögen	Im Umlauf befindliche Anteile	Liquidationswert
C1 CM-CIC GR.BDS RC3D	Thesaurierend	3.566.106,32	35.261,212	101,13
I1 CM-CIC GR.BDS IC3D	Thesaurierend	32.245.815,56	317,715	101.492,89

WERTPAPIERBESTAND

Instrumente des Wertpapierbestands:	In Prozent des	
	Nettovermögens	Gesamt-vermögens
a) Gemäß Artikel L. 422-1 zum Handel an einem geregelten Markt zugelassene Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	97,68	97,16
b) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zum Handel an einem anderen geregelten, ordnungsgemäß funktionierenden, anerkannten und für das Publikum offenen Markt in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder einem anderen, dem Europäischen Wirtschaftsraum angeschlossenen Staat zugelassen sind	0,00	0,00
c) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zum amtlichen Handel an einer Wertpapierbörse eines Drittlandes oder an einem anderen, regelmäßig funktionierenden, anerkannten, für das Publikum offenen, geregelten Markt eines Drittlandes zugelassen sind, sofern diese Börse oder dieser Markt nicht auf der Liste der von der französischen Aufsichtsbehörde (AMF) ausgeschlossenen Märkte geführt wird oder die Wahl dieser Börse oder dieses Marktes laut Gesetz, dem Verwaltungsreglement oder der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist	0,00	0,00
d) Unter Ziffer I Punkt 4 von Artikel R. 214-11 des französischen Währungs- und Finanzgesetzbuches aufgeführte, neu emittierte Wertpapiere	0,00	0,00
e) Sonstige Aktiva	0,00	0,00

AUFSCHLÜSSELUNG DER AKTIVA VON A), B) UND F) AUS ARTIKEL R.214-1-1 NACH WÄHRUNGEN

Wertpapiere	Währung	Betrag (EUR)	In Prozent des	
			Nettovermögens	Gesamtvermögens
RATP 0,875%250527	EUR	2.146.352,88	5,99	5,95
ALLIANDER 0,875%26	EUR	2.008.105,31	5,61	5,58
OAT 1,75%17-39	EUR	1.967.439,86	5,49	5,46
ICADE 1,5%130927	EUR	1.879.885,48	5,25	5,22
SNCF RESEAU 1%31	EUR	1.777.522,80	4,96	4,94
BELGIUM 1,25%33	EUR	1.777.038,29	4,96	4,94
BPCE 1,125%22 EMTN	EUR	1.658.345,84	4,63	4,61
IRELAND 1,35%31	EUR	1.631.550,60	4,56	4,53
NRW.BANK 0,5%27	EUR	1.590.000,41	4,44	4,42
KRED WIEDE 0,25%25	EUR	1.561.760,75	4,36	4,34
ASIAN DEV 0,35%25	EUR	1.559.936,92	4,36	4,33
SSE 0,875%060925	EUR	1.545.634,93	4,32	4,29
KRED WIEDE 0,05%24	EUR	1.536.676,85	4,29	4,27
DEUTSCHE K 0,75%24	EUR	1.512.784,93	4,22	4,20
TENNET 0,75%260625	EUR	1.455.851,18	4,07	4,04
FERR STAT 0,875%23	EUR	1.231.598,56	3,44	3,42
LDBK BADEN- 0,2%21	EUR	1.204.927,87	3,36	3,35
SGP 1,125%221028	EUR	1.118.785,25	3,12	3,11
ADIF 0,95%300427	EUR	1.060.864,25	2,96	2,95
NETHERLANDS 0,5%40	EUR	904.364,46	2,53	2,51
CDC 0,2%22 EMTN	EUR	808.878,47	2,26	2,25
IBERDROLA FIN 1%25	EUR	630.537,62	1,76	1,75
IBERDROLA FIN 1%24	EUR	624.465,62	1,74	1,73
SNCF RESE 1,875%34	EUR	614.682,40	1,72	1,71
SHB 0,375%030723	EUR	610.790,96	1,71	1,70
TENNET 1,75%040627	EUR	335.455,03	0,94	0,93
ORSTED 1,5%261129	EUR	225.639,18	0,63	0,63
GESAMT	**EUR**	**34.979.876,70**	**97,68**	**97,16**
GESAMT		**34.979.876,70**	**97,68**	**97,16**

AUFSCHLÜSSELUNG DER AKTIVA VON A), B) UND F) AUS ARTIKEL R.214-1-1 NACH WIRTSCHAFTSSEKTOREN

Wirtschaftssektor	In Prozent des	
	Nettovermögens	Gesamtvermögens
Banken	18,37	18,27
Staatliche Emittenten	17,54	17,44
Emittenten ohne Staatsgarantie	12,67	12,61
Staatsnahe Emittenten	10,91	10,85
Stromversorgung	9,32	9,27
Transportwesen	6,40	6,37
Sonstige Wirtschaftssektoren	22,47	22,35
GESAMT	**97,68**	**97,16**

AUFSCHLÜSSELUNG DER AKTIVA VON A), B) UND F) AUS ARTIKEL R.214-1-1 NACH SITZLAND DES EMITTENTEN

Land	In Prozent des	
	Nettovermögens	Gesamtvermögens
FRANKREICH	33,42	33,26
DEUTSCHLAND	20,68	20,57
NIEDERLANDE	13,13	13,06
SONSTIGE LÄNDER	30,45	30,27
GESAMT	**97,68**	**97,16**

AUFSCHLÜSSELUNG DER WEITEREN AKTIVA NACH ART DER AKTIVA

Art der Aktiva	In Prozent des	
	Nettovermögens	Gesamtvermögens
ANTEILE VON OGA	**0,00**	**0,00**
▪ Nicht professionellen Anlegern offen stehende OGA und allgemein ausgerichtete Investmentfonds	0,00	0,00
▪ Nicht professionellen Anlegern offen stehende FCPR, FCPI und FIP	0,00	0,00
▪ Verbriefungsfonds	0,00	0,00
▪ Nicht professionellen Anlegern offen stehende OPCI und SCPI	0,00	0,00
▪ SEF, SICAF und alternative Dachfonds	0,00	0,00
▪ Professionellen Anlegern vorbehaltene professionelle allgemeine Investmentfonds	0,00	0,00
▪ Professionellen Anlegern vorbehaltene OPCI und spezialisierte FPS und FPCI	0,00	0,00
▪ Sonstige kollektive Kapitalanlagen	0,00	0,00
ANDERE ARTEN VON AKTIVA	**0,00**	**0,00**
▪ Optionsscheine	0,00	0,00
▪ Sparzertifikate	0,00	0,00
▪ Eigenwechsel	0,00	0,00
▪ Hypothekenscheine	0,00	0,00
▪ Sonstige	0,00	0,00
GESAMT	**0,00**	**0,00**

BEWEGUNGEN INNERHALB DES WERTPAPIERPORTFOLIOS WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMS

Bewegungen innerhalb des Berichtszeitraums	Bewegungen (Betrag)
Akquisitionen	1.908.492,29
Veräußerungen	1.517.372,54

EINZELTITEL DES PORTFOLIOS

Bezeichnung der Titel	Ausgabe	Fälligkeit	Währung	Anzahl oder Nennwert	Zinsen	Börsenwert	% des Nettovermögens
Anleihen und gleichwertige Wertpapiere GESAMT						**30.666.923,35**	**85,64**
An einem gereg. o. gleichw. Markt gehandelte Anleihen & gleichwertige Wertp. GESAMT						**30.666.923,35**	**85,64**
An einem gereg. o. gleichw. Markt gehandelte festverzinste Anleihen GESAMT						**30.666.923,35**	**85,64**
DEUTSCHLAND GESAMT						**7.406.150,81**	**20,68**
DE000GRN0016 DEUTSCHE KREDITBANK 0,75%17-24	26.09.2017	26.09.2024	EUR	15	0,75	1.512.784,93	4,22
DE000LB1M214 LDBK BADEN-WUERTT 0,2%17-1221	13.12.2017	13.12.2021	EUR	12	0,20	1.204.927,87	3,36
DE000NWB0AE6 NRW.BANK 0,5%17-130927	13.09.2017	13.09.2027	EUR	1.500	0,50	1.590.000,41	4,45
XS1414146669 KRED WIEDERAUFBAU 0,05%16-0524	20.05.2016	30.05.2024	EUR	1.500	0,05	1.536.676,85	4,29
XS1612940558 KRED WIEDERAUFBAU 0,25%17-0625	16.05.2017	30.06.2025	EUR	1.500	0,25	1.561.760,75	4,36
DÄNEMARK GESAMT						**225.639,18**	**0,63**
XS1721760541 ORSTED 1,5%17-261129	24.11.2017	26.11.2029	EUR	200	1,50	225.639,18	0,63
SPANIEN GESAMT						**2.315.867,49**	**6,47**
ES0200002048 ADIF 0,95%19-300427	25.04.2019	30.04.2027	EUR	10	0,95	1.060.864,25	2,97
XS1527758145 IBERDROLA FINANZAS 1%16-070324	07.12.2016	07.03.2024	EUR	6	1,00	624.465,62	1,74
XS1575444622 IBERDROLA FINC 1%17-070325	07.03.2017	07.03.2025	EUR	6	1,00	630.537,62	1,76
FRANKREICH GESAMT						**11.971.892,98**	**33,42**
FR0013067170 BPCE 1,125%15-141222 EMTN	14.12.2015	14.12.2022	EUR	16	1,125	1.658.345,84	4,63
FR0013234333 OAT 1,75%17-25062039	31.01.2017	25.06.2039	EUR	1.500.000	1,75	1.967.439,86	5,49
FR0013239985 CDC 0,2%17-010322 EMTN	01.03.2017	01.03.2022	EUR	8	0,20	808.878,47	2,26
FR0013264488 RATP 0,875%17-250527	29.06.2017	25.05.2027	EUR	20	0,875	2.146.352,88	5,99
FR0013281755 ICADE 1,5%17-130927	13.09.2017	13.09.2027	EUR	18	1,50	1.879.885,48	5,25
FR0013372299 SGP 1,125%18-221028	22.10.2018	22.10.2028	EUR	10	1,125	1.118.785,25	3,12
XS1514051694 SNCF RESEAU 1%16-091131	09.11.2016	09.11.2031	EUR	16	1,00	1.777.522,80	4,96
XS1588061777 SNCF RESEAU 1,875%17-300334	30.03.2017	30.03.2034	EUR	5	1,875	614.682,40	1,72
VEREINIGTES KÖNIGREICH GESAMT						**1.545.634,93**	**4,32**
XS1676952481 SSE 0,875%17-060925	06.09.2017	06.09.2025	EUR	1.500	0,875	1.545.634,93	4,32

Bezeichnung der Titel	Ausgabe	Fälligkeit	Währung	Anzahl oder Nennwert	Zinsen	Börsenwert	% des Nettovermögens
ITALIEN GESAMT						**1.231.598,56**	**3,44**
XS1732400319 FERR STATO IT 0,875%17-071223	07.12.2017	07.12.2023	EUR	1.200	0,875	1.231.598,56	3,44
NIEDERLANDE GESAMT						**3.799.411,52**	**10,61**
XS1241581096 TENNET 1,75%15-040627	04.06.2015	04.06.2027	EUR	300	1,75	335.455,03	0,94
XS1400167133 ALLIANDER 0,875%16-220426 MTN	22.04.2016	22.04.2026	EUR	19	0,875	2.008.105,31	5,60
XS1632897762 TENNET 0,75%17-260625	26.06.2017	26.06.2025	EUR	1.400	0,75	1.455.851,18	4,07
PHILIPPINEN GESAMT						**1.559.936,92**	**4,36**
XS1854893291 ASIAN DEVELOP BANK 0,35%18-25	16.07.2018	16.07.2025	EUR	1.500	0,35	1.559.936,92	4,36
SCHWEDEN GESAMT						**610.790,96**	**1,71**
XS1848875172 SHB 0,375%18-030723	03.07.2018	03.07.2023	EUR	600	0,375	610.790,96	1,71
Schuldtitel GESAMT						**4.312.953,35**	**12,04**
An einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelte Schuldtitel GESAMT						**4.312.953,35**	**12,04**
Übertragbare Schuldtitel GESAMT						**4.312.953,35**	**12,04**
BELGIEN GESAMT						**1.777.038,29**	**4,95**
BE0000346552 BELGIUM 1,25%18-220433	05.03.2018	22.04.2033	EUR	150.000.000	1,25	1.777.038,29	4,95
IRLAND GESAMT						**1.631.550,60**	**4,56**
IE00BFZRQ242 IRELAND 1,35%18-180331	17.10.2018	18.03.2031	EUR	140.000.000	1,35	1.631.550,60	4,56
NIEDERLANDE GESAMT						**904.364,46**	**2,53**
NL0013552060 NETHERLANDS 0,5%19-150140	23.05.2019	15.01.2040	EUR	800.000	0,50	904.364,46	2,53
Finanzkontrakte GESAMT						**0,00**	**0,00**
Finanztermingeschäfte mit Margenausgleich GESAMT						**0,00**	**0,00**
Unbedingte Termingeschäfte GESAMT						**0,00**	**0,00**
FGBLZ0F00002 BUND-EUX 1220			EUR	-67		-144.020,00	-0,40
FGBMZ0F00002 BOBL-EUX 1220			EUR	44		23.760,00	0,52
FGBXZ0F00001 BUXL-EUX 1220			EUR	-5		-41.800,00	-0,12
FRANKREICH GESAMT						**162.060,00**	**0,00**
MARF.EUR Appels marge futures			EUR	162.060		162.060,00	0,00

EUROPÄISCHE VORSCHRIFTEN ZUR ERHÖHUNG DER TRANSPARENZ VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (SFT-VERORDNUNG)

Der OGA hat im Berichtszeitraum keine Geschäfte getätigt, die der EU-Verordnung 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und die Weiterverwendung („SFT-Verordnung“) unterliegen, womit das Erfordernis einer diesbezüglichen Mitteilung an die Anleger entfällt.