

CM-AM OBLI SOUVERAINS

DOCUMENTO DE INFORMACIÓN SEMESTRAL A 30/06/2021
--

FORMA JURÍDICA DEL OIC

Fondo de inversión colectiva general

CLASIFICACIÓN

Clasificación del BCE Fondo de renta fija

ASIGNACIÓN DE RESULTADOS

Resultado de capitalización

ESTADO DEL PATRIMONIO

Componentes del estado del patrimonio	Importe al cierre del periodo*
a) Valores financieros admisibles mencionados en el punto 1.º del apartado I del artículo L. 214-20 del Código monetario y financiero francés	114.638.148,32
b) Activos bancarios	2.136.011,07
c) Otros activos del OICVM	12.452.867,44
d) Total de activos del OICVM	129.227.026,83
e) Pasivo	-160.583,19
f) Valor de inventario neto	129.066.443,64

* Importes certificados

NÚMERO DE PARTICIPACIONES EN CIRCULACIÓN Y VALOR DE INVENTARIO NETO POR PARTICIPACIÓN O ACCIÓN

Participación	Tipo de participación	Patrimonio neto	Número de participaciones en circulación	Valor liquidativo
A1 CM-AM OB.SOUV.6DEC	De capitalización	7.367.667,74	69.350,376213	106,23
C1 CM-AM OBLI SOUV.C	De capitalización	121.698.775,90	24.042,00	5.061,92

COMPONENTES DE LA CARTERA DE VALORES

Componentes de la cartera de valores:	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
a) Valores financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en un mercado regulado según lo dispuesto en el artículo L. 422-1	88,82	88,71
b) Valores financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en otro mercado regulado, con funcionamiento periódico, reconocido, abierto al público y que tenga su domicilio social en un Estado miembro de la Unión Europea o en otro Estado que forme parte del Acuerdo sobre el Espacio Económico Europeo (EEE)	0,00	0,00
c) Valores financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores de un tercer país o negociados en otro mercado de un tercer país regulado, con funcionamiento periódico, reconocido y abierto al público, siempre que dicha bolsa o mercado no figure en una lista elaborada por la Autoridad de los Mercados Financieros o que la elección de dicha bolsa o mercado esté prevista por la ley o el reglamento o los estatutos del organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios	0,00	0,00
d) Valores financieros de reciente emisión que se indican en el punto 4.º del apartado I del artículo R. 214-11 del Código Monetario y Financiero francés	0,00	0,00
e) Otros activos	9,50	9,49

DESGLOSE DE LOS ACTIVOS DE LOS APARTADOS A), B) Y F) DEL ARTÍCULO R.214-1-1 POR DIVISA

Valores	Divisa	En importe (EUR)	Porcentaje	
			Patrimonio neto	Total de activos
SPANIEN 18-28	EUR	9.859.737,94	7,60	7,63
SPAIN 1,5%300427	EUR	7.025.657,86	5,44	5,44
KRED WIED 0,625%27	EUR	6.332.976,16	4,91	4,90
ITALIA 3%010829	EUR	5.784.498,24	4,48	4,48
ITALY 4,75%010944	EUR	5.498.195,76	4,26	4,25
BELGIUM 0,8%220628	EUR	5.376.195,89	4,17	4,16
ALEMANIA 0%150230	EUR	5.148.650,00	3,99	3,98
OAT 0,75%20-52	EUR	5.023.939,32	3,89	3,89
ESPAÑA 0,6%311029	EUR	4.142.243,83	3,21	3,21
PORTUGAL 18-28	EUR	4.102.421,91	3,18	3,17
ITALIA 2,05%27 BTP	EUR	3.900.753,85	3,02	3,02
AUSTRIA 0,5%200427	EUR	3.685.955,00	2,86	2,85
RATP 0,875%250527	EUR	3.168.872,87	2,46	2,45
OAT0,50%19-29	EUR	3.149.611,64	2,44	2,44
SPAIN 1,25% 311030	EUR	2.947.633,64	2,28	2,28
ITALY 2,45% 010950	EUR	2.885.122,25	2,24	2,23
GERMANY 0% 150850	EUR	2.759.130,00	2,14	2,14
GERMANY 0,25% 28	EUR	2.632.596,58	2,04	2,04
NETHERLAND 0,75%27	EUR	2.375.896,33	1,84	1,84
OAT0,50%16-26	EUR	2.303.357,21	1,78	1,78
DEXIA CLF 1%181027	EUR	2.149.962,19	1,67	1,66
ITALY 1,45% 151124	EUR	2.111.582,60	1,64	1,63
KRED WIEDERA 0%26	EUR	2.037.300,00	1,58	1,58
UNEDIC 0,1%34 EMTN	EUR	1.930.448,22	1,50	1,49
DT. BAHN FIN. 18/2	EUR	1.925.149,07	1,49	1,49
CADES 0%250531	EUR	1.673.089,00	1,30	1,29
AG.F.DEV.0,25%26	EUR	1.540.754,79	1,19	1,19
GERMANY 2,5%040744	EUR	1.403.687,71	1,09	1,09
BÉLGICA 5% 35 OLO	EUR	1.322.000,55	1,02	1,02
EUROPEAN UNI 0%30	EUR	1.304.446,00	1,01	1,01
ALEMANIA TV26 INF	EUR	1.174.911,78	0,91	0,91
PORTUGAL 1,95% 29	EUR	1.150.158,22	0,89	0,89
NORTH RHIN 0,95%28	EUR	1.079.499,04	0,84	0,84
ITALY 3,45%010348	EUR	961.730,91	0,75	0,74
EUROPEAN U 0,3%50	EUR	912.685,75	0,71	0,71
OAT 0,50%20-40	EUR	784.664,44	0,61	0,61
NETHERLANDS 0%52	EUR	716.816,00	0,56	0,55
OAT 2%17-48	EUR	645.016,10	0,50	0,50
BELGIUM 1,7% 220650	EUR	604.782,88	0,47	0,47
OATE0,25%13-24 IND	EUR	579.380,96	0,45	0,45
BÉLGICA 1%220626	EUR	214.766,79	0,17	0,17
SPAIN 2,7%311048	EUR	199.700,90	0,15	0,15
OAT 1,25%16-36	EUR	112.168,14	0,09	0,09
TOTAL	EUR	114.638.148,32	88,82	88,71
TOTAL		114.638.148,32	88,82	88,71

DESGLOSE DE LOS ACTIVOS DE LOS APARTADOS A), B) Y F) DEL ARTÍCULO R.214-1-1 POR SECTOR ECONÓMICO

Sector económico	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
Soberanos	70,17	70,09
Entidades garantizadas por el Estado	10,47	10,46
Entidad no garantizada por el Estado	3,95	3,94
Supranacionales	1,72	1,72
Bancos, antiguo código ICB	1,67	1,66
Administraciones territoriales	0,84	0,84
TOTAL	88,82	88,71

DESGLOSE DE LOS ACTIVOS DE LOS APARTADOS A), B) Y F) DEL ARTÍCULO R.214-1-1 POR PAÍS DE RESIDENCIA DEL EMISOR

País	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
ALEMANIA	18,97	18,95
ESPAÑA	18,73	18,71
FRANCIA	17,87	17,85
OTROS PAÍSES	33,25	33,20
TOTAL	88,82	88,71

DESGLOSE DE OTROS ACTIVOS POR TIPO

Tipo de activo	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
PARTICIPACIONES DE OIC	9,50	9,49
▪ OIC y Fondos de inversión de tipo general (no profesionales)	9,50	9,49
▪ FCPR, FCPI y FIP abiertos a inversores no profesionales	0,00	0,00
▪ Organismo de titulización	0,00	0,00
▪ OPCI y SCPI abiertos a inversores no profesionales	0,00	0,00
▪ SEF, SICAF y fondos de inversión alternativos	0,00	0,00
▪ Fondos profesionales de tipo general (abiertos a inversores profesionales)	0,00	0,00
▪ OPCI profesionales, Fondos profesionales especializados y fondos profesionales de capital riesgo (private equity)	0,00	0,00
▪ Otras inversiones colectivas	0,00	0,00
OTROS TIPOS DE ACTIVOS	0,00	0,00
▪ Bonos de suscripción	0,00	0,00
▪ Bonos de caja	0,00	0,00
▪ Pagarés	0,00	0,00
▪ Cédulas hipotecarias	0,00	0,00
▪ Otros	0,00	0,00
TOTAL	9,50	9,49

MOVIMIENTOS EN LA CARTERA DE VALORES DURANTE EL PERIODO

Movimientos registrados durante el periodo	Movimientos (en importe)
Adquisiciones	16.846.611,16
Cesiones	4.050.399,96

Reglamento SFTR

Este OIC no ha participado en operaciones sujetas al Reglamento de la UE 2015/2365 sobre transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización («Reglamento SFTR») durante el periodo, por lo que no tiene información que divulgar a los inversores al respecto.

DETALLE DE LA CARTERA DE VALORES

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% del patrimonio neto
TOTAL Bonos y valores similares						43.388.339,39	33,62
TOTAL Bonos y valores similares negociados en un mercado regulado o similar						43.388.339,39	33,62
TOTAL Bonos de tipo de fijo negociados en un mercado regulado o similar						42.808.958,43	33,17
TOTAL ALEMANIA						14.007.520,85	10,85
DE0001102457 GERMANY 0,25%18-150828	13/07/2018	15/08/2028	EUR	250.000.000	0,25	2.632.596,58	2,04
DE000A2DAR65 KRED WIEDERAUFBAU 0,625%17-27	21/02/2017	22/02/2027	EUR	6.000	0,625	6.332.976,16	4,90
DE000A2TSTU4 KRED WIEDERAUFBAU 0%19-300926	24/09/2019	30/09/2026	EUR	2.000		2.037.300,00	1,58
DE000NRW0K03 NORTH RHINE-W 0,95%18-130328	13/03/2018	13/03/2028	EUR	1.000	0,95	1.079.499,04	0,84
XS1752475720 DEUTSCHBAHNFIN 1%18-171227	18/01/2018	17/12/2027	EUR	1.800	1,00	1.925.149,07	1,49
TOTAL FRANCIA						22.481.883,92	17,42
FR0013131877 OAT 0,50%16-25052026	03/03/2016	25/05/2026	EUR	2.200.000	0,50	2.303.357,21	1,78
FR0013154044 OAT 1,25%16-25052036	19/04/2016	25/05/2036	EUR	100.000	1,25	112.168,14	0,09
FR0013190188 AGENCE FR.DEV.0,25%16-21072026	21/07/2016	21/07/2026	EUR	15	0,25	1.540.754,79	1,19
FR0013257524 OAT 2%17-25052048	25/05/2017	25/05/2048	EUR	500.000	2,00	645.016,10	0,50
FR0013264488 RATP 0,875%17-250527	29/06/2017	25/05/2027	EUR	30	0,875	3.168.872,87	2,46
FR0013407236 OAT 0,50%19-25052029	11/03/2019	25/05/2029	EUR	3.000.000	0,50	3.149.611,64	2,44
FR0013480613 OAT 0,75%20-25052052	04/02/2020	25/05/2052	EUR	5.250.000	0,75	5.023.939,32	3,88
FR0013515806 OAT 0,50%20-25052040	03/06/2020	25/05/2040	EUR	800.000	0,50	784.664,44	0,61
FR0014001S17 CADES 0%21-250531	03/02/2021	25/05/2031	EUR	17		1.673.089,00	1,30
FR0014001ZY9 UNEDIC 0,1%21-250534 EMTN	16/02/2021	25/05/2034	EUR	20	0,10	1.930.448,22	1,50
XS1700578724 DEXIA CLF 1%17-181027	18/10/2017	18/10/2027	EUR	40	1,00	2.149.962,19	1,67
TOTAL LUXEMBURGO						2.217.131,75	1,72
EU000A283859 EUROPEAN UNION 0%20-041030	27/10/2020	04/10/2030	EUR	1.300		1.304.446,00	1,01
EU000A284469 EUROPEAN UNION 0,3%20-041150	17/11/2020	04/11/2050	EUR	1.000	0,30	912.685,75	0,71
TOTAL PORTUGAL						4.102.421,91	3,18
PTOTEVOE0018 PORTUGAL 2,125%18-171028	17/01/2018	17/10/2028	EUR	350.000.000	2,125	4.102.421,91	3,18

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% del patrimonio neto
TOTAL Bonos indexados negociados en un mercado regulado o similar						579.380,96	0,45
TOTAL FRANCIA						579.380,96	0,45
FR0011427848 OATE 0,25%13-25072024 INDX	26/02/2013	25/07/2024	EUR	500.000	0,25	579.380,96	0,45
TOTAL Títulos de crédito						71.249.808,93	55,20
TOTAL Títulos de crédito negociados en un mercado regulado o similar						71.249.808,93	55,20
TOTAL Títulos de crédito negociables						71.249.808,93	55,20
TOTAL AUSTRIA						3.685.955,00	2,86
AT0000A1VGK0 AUSTRIA 0,5%17-200427	11/04/2017	20/04/2027	EUR	3.500	0,50	3.685.955,00	2,86
TOTAL BÉLGICA						7.517.746,11	5,82
BE0000304130 BÉLGICA 5%04-35 OLO	19/05/2004	28/03/2035	EUR	80.000.000	5,00	1.322.000,55	1,02
BE0000337460 BÉLGICA 1%16-220626	13/01/2016	22/06/2026	EUR	20.000.000	1,00	214.766,79	0,17
BE0000345547 BÉLGICA 0,8%18-220628	23/01/2018	22/06/2028	EUR	500.000.000	0,80	5.376.195,89	4,16
BE0000348574 BÉLGICA 1,7%19-220650 OLO	05/02/2019	22/06/2050	EUR	50.000.000	1,70	604.782,88	0,47
TOTAL ALEMANIA						10.486.379,49	8,12
DE0001030567 ALEMANIA TV15-150426 INFLAT.	12/03/2015	15/04/2026	EUR	100.000.000	0,10	1.174.911,78	0,91
DE0001102481 GERMANY 0%19-150850	23/08/2019	15/08/2050	EUR	300.000.000		2.759.130,00	2,14
DE0001102499 ALEMANIA 0%20-150230	10/01/2020	15/02/2030	EUR	500.000.000		5.148.650,00	3,98
DE0001135481 GERMANY 2,5%12-040744	27/04/2012	04/07/2044	EUR	90.000.000	2,50	1.403.687,71	1,09
TOTAL ESPAÑA						24.174.974,17	18,73
ES00000128P8 SPAIN 1,5%17-300427	31/01/2017	30/04/2027	EUR	6.400	1,50	7.025.657,86	5,44
ES0000012B39 SPAIN 1,4%18-300428	30/01/2018	30/04/2028	EUR	9.000	1,40	9.859.737,94	7,65
ES0000012B47 SPAIN 2,7%18-311048	27/02/2018	31/10/2048	EUR	150	2,70	199.700,90	0,15
ES0000012F43 ESPAÑA 0,6%19-311029	12/06/2019	31/10/2029	EUR	4.000	0,60	4.142.243,83	3,21
ES0000012G34 SPAIN 1,25%20-311030	30/04/2020	31/10/2030	EUR	2.700	1,25	2.947.633,64	2,28
TOTAL ITALIA						21.141.883,61	16,38
IT0004923998 ITALY 4,75%13-010944	22/05/2013	01/09/2044	EUR	3.400	4,75	5.498.195,76	4,26
IT0005273013 ITALY 3,45%17-010348	07/06/2017	01/03/2048	EUR	700	3,45	961.730,91	0,75
IT0005274805 ITALIA 2,05%17-010827 BTP	30/06/2017	01/08/2027	EUR	3.500	2,05	3.900.753,85	3,02
IT0005282527 ITALY 1,45%17-151124	15/09/2017	15/11/2024	EUR	2.000	1,45	2.111.582,60	1,64
IT0005365165 ITALIA 3%19-010829	27/02/2019	01/08/2029	EUR	4.800	3,00	5.784.498,24	4,47

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% del patrimonio neto
IT0005398406 ITALY 2,45%20-010950	22/01/2020	01/09/2050	EUR	2.500	2,45	2.885.122,25	2,24
TOTAL PAÍSES BAJOS						3.092.712,33	2,40
NL0012171458 NETHERLANDS 0,75%17-150727	09/02/2017	15/07/2027	EUR	2.200.000	0,75	2.375.896,33	1,84
NL0015614579 NETHERLANDS 0%20-150152	24/09/2020	15/01/2052	EUR	800.000		716.816,00	0,56
TOTAL PORTUGAL						1.150.158,22	0,89
PTOTEXOE0024 PORTUGAL 1,95%19-150629	16/01/2019	15/06/2029	EUR	100.000.000	1,95	1.150.158,22	0,89
TOTAL Títulos de OIC						12.263.542,44	9,50
TOTAL OICVM y equivalentes de otros Estados miembros de la UE						12.263.542,44	9,50
TOTAL FRANCIA						12.263.542,44	9,50
FR0000009987 UNION + (IC)			EUR	13,544		2.560.839,52	1,98
FR0011153378 CM-AM INFLATION (C)			EUR	36.076,576		4.137.622,50	3,20
FR0013246550 CM-AM GREEN BONDS (IC)			EUR	15		1.518.884,40	1,18
FR0013373206 CM-AM SHORT TERM BONDS (IC)			EUR	29,883		3.002.456,77	2,33
FR0013380748 CM-AM OBLI LONG TERME IC FCP			EUR	1		1.043.739,25	0,81
TOTAL Contratos financieros						0,00	0,00
TOTAL Contratos financieros con ajuste de márgenes de garantía						0,00	0,00
TOTAL Compromisos a plazo firme						0,00	0,00
FGBLU1F00002 BUND-EUX 0921			EUR	-51		-53.550,00	-0,04
TOTAL FRANCIA						53.550,00	0,00
MARF.EUR Ajustes de margen futuros			EUR	53.550		53.550,00	0,00