

CM-CIC CONVERTIBLES EURO

DOCUMENTO DE INFORMACIÓN SEMESTRAL A 30/09/2020
--

FORMA JURÍDICA DEL OIC

SICAV general

CLASIFICACIÓN

Clasificación del BCE Fondos mixtos (ex. diversificados)

ASIGNACIÓN DE RESULTADOS

Resultado de capitalización y de reparto

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	134.277.460,08
b) Activos bancarios	12.237.903,96
c) Otros activos del OICVM	15.261.258,06
d) Total de activos del OICVM	161.776.622,10
e) Pasivo	-255.783,02
f) Valor de inventario neto	161.520.839,08

* 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
C2 CM-CIC CO.E.IC 3D	De capitalización	43.733.503,98	4.299.429,991	10,17
C3 CM CIC CON.EU.RC3D	De capitalización	95.352.694,64	6.055.226,112	15,74
C4 CM CIC CO.EURO S3D	De capitalización	6.484.723,23	198.555,913	32,65
D1 CM CIC CO.EUR.RD3D	De reparto	15.949.917,23	572.912,042	27,84

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	83,13	83,00
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	8,85	8,84

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
ATOS 0%1124 EXCH.	EUR	8.858.500,00	5,42	5,45
CELLNEX TEL.15,%26	EUR	8.457.867,54	5,24	5,23
SYMRISE 0,2375%24	EUR	6.617.335,89	4,10	4,09
ELEC DE FRANCE 24	EUR	6.570.383,04	4,07	4,06
IBERDROLA 0%22 IDX	EUR	6.367.000,00	3,94	3,94
NEXI 1,75%0427 CV	EUR	5.801.291,80	3,59	3,59
DEUTSCHE 0,6%26 CV	EUR	5.378.448,85	3,33	3,32
DW 0,325%260724 CV	EUR	5.290.106,30	3,28	3,27
JUST EAT 2,25%24	EUR	4.950.329,99	3,06	3,06
LEG IMMOB.WLD.17/2	EUR	4.944.197,24	3,06	3,06
CELLNEX 0,5%28 CV	EUR	4.822.170,41	2,99	2,98
CB NEOEN 2% 0625	EUR	4.007.950,00	2,48	2,48
ADIDAS 0,05%23 CV	EUR	3.886.180,82	2,41	2,40
ARC.OBL.0%23 OCC	EUR	3.791.070,00	2,35	2,34
WINCH 0%26 OCEANE	EUR	3.713.213,00	2,30	2,30
ORPEA 0,375%27 CV	EUR	3.156.427,12	1,95	1,95
INGENICO 0%0622	EUR	3.085.160,00	1,91	1,91
KORIAN 0,875%27 OC	EUR	2.587.500,00	1,60	1,60
SELENA 0%0625 EXCH	EUR	2.578.320,00	1,60	1,59
DELIVERY 1%0127 CV	EUR	2.435.021,74	1,51	1,51
SAFRAN 0,875%27 OC	EUR	2.410.000,00	1,49	1,49
DELIVERY 0,25%24CV	EUR	2.370.605,43	1,47	1,47
LEG IMMOBILIEN 28	EUR	2.117.377,78	1,31	1,31
GCP TV020322 CONV.	EUR	2.044.414,36	1,27	1,26
SOITEC 0%23	EUR	1.916.434,65	1,19	1,18
COINTREAU 0,125%26	EUR	1.872.267,22	1,16	1,16
AMADEUS 1,5%25 CV	EUR	1.746.683,61	1,08	1,08
KERING 0%22 OCEANE	EUR	1.606.650,00	0,99	0,99
UBISOFT 0%24OCEANE	EUR	1.602.770,00	0,99	0,99
SNAM 0%200322 CV	EUR	1.574.850,00	0,98	0,97
NEXITY 0,25%ORNANE	EUR	1.561.216,16	0,97	0,97
HELLOFRESH 0,75%25	EUR	1.385.663,42	0,86	0,86
NEON 1,875%24 OCE.	EUR	1.372.000,00	0,85	0,85
MTU 0,05%180327 CV	EUR	1.362.106,85	0,84	0,84
KORIAN TVPERP ODIR	EUR	1.304.290,00	0,81	0,81
JUST EAT 1,25%CV26	EUR	1.011.130,00	0,63	0,63
NEXITY 0,125%23	EUR	865.350,00	0,54	0,53
SAP	EUR	703.628,00	0,44	0,43
SHOP APOT.4,5%23CV	EUR	644.577,97	0,40	0,40
AKKA TECH.TVPERP.	EUR	554.165,11	0,34	0,34
ALSTOM REGROUP T	EUR	484.175,24	0,30	0,30
SANOFI	EUR	469.315,00	0,29	0,29
ZALANDO 0,625%27CV	EUR	464.530,41	0,29	0,29
ZALANDO 0,05%CV25	EUR	463.859,23	0,29	0,29
VEOLIA ENVIRON.	EUR	423.660,00	0,26	0,26

Valores	Divisa	En importe (EUR)	Porcentaje	
			Patrimonio neto	Total de activos
SOLARIA ENERGIA M.	EUR	419.900,00	0,26	0,26
ENCAVIS AG INH. O	EUR	418.500,00	0,26	0,26
NEXI S.P.A.	EUR	325.280,00	0,20	0,20
L'OREAL	EUR	305.360,00	0,19	0,19
SIEMENS	EUR	302.064,00	0,19	0,19
RENAULT TPA 83-84	EUR	266.508,00	0,17	0,16
BE SEMICONDUCTOR	EUR	237.835,00	0,15	0,15
ALFEN N.V.	EUR	179.190,00	0,11	0,11
ERG	EUR	171.680,00	0,11	0,11
AMADEUS IT GRP A	EUR	166.612,59	0,10	0,10
CARREFOUR	EUR	163.980,00	0,10	0,10
SIEMENS HEALTH.AG	EUR	153.200,00	0,09	0,09
SAFRAN PROV.ECH.	EUR	126.744,44	0,08	0,08
AIRBUS	EUR	124.202,07	0,08	0,08
SCHNEIDER ELECTRIC	EUR	106.050,00	0,07	0,07
GRAND CITY PROP.	EUR	82.480,00	0,05	0,05
ASML HOLDING	EUR	78.675,00	0,05	0,05
DELIVERY HERO	EUR	78.496,00	0,05	0,05
TAG IMMOBILIEN	EUR	77.220,00	0,05	0,05
SHOP APOTHEKE EURO	EUR	74.600,00	0,05	0,05
SIEMENS ENERGY AG	EUR	32.200,00	0,02	0,02
ABENGOA CL.B	EUR	2.337,84	0,00	0,00
ABENGOA ABEN 0%49	EUR	0,00	0,00	0,00
TOTAL	EUR	133.523.309,12	82,66	82,54
QIAGEN 0,875%21 CV	USD	622.189,77	0,39	0,38
TOTAL	USD	622.189,77	0,39	0,38
NESTLE NOM.	CHF	131.961,19	0,08	0,08
TOTAL	CHF	131.961,19	0,08	0,08
TOTAL		134.277.460,08	83,13	83,00

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
Inversiones inmobiliarias y servicios	15,43	15,42
Telefonía móvil	8,22	8,21
Electricidad	7,50	7,49
Comercio minorista	7,29	7,28
Software y servicios informáticos	7,10	7,09
Servicios de apoyo a las empresas	6,44	6,42
Otros sectores económicos	31,13	31,07
TOTAL	83,11	82,98

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
FRANCIA	34,18	34,13
ALEMANIA	23,82	23,79
ESPAÑA	9,67	9,65
OTROS PAÍSES	15,46	15,43
TOTAL	83,13	83,00

DESGLOSE DE OTROS ACTIVOS POR TIPO

Tipo de activo	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
PARTICIPACIONES DE OIC	8,85	8,84
▪ OIC y Fondos de inversión de tipo general (no profesionales)	8,85	8,84
▪ 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	8,85	8,84

MOVIMIENTOS EN LA CARTERA DE VALORES DURANTE EL PERIODO

Movimientos registrados durante el periodo	Movimientos (en importe)
Adquisiciones	40 070 503,63
Cesiones	51 588 430,27

DETALLE DE LA CARTERA DE VALORES

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% Patrimonio neto
TOTAL Acciones y valores similares						5.839.346,37	3,62
TOTAL Acciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar						5.839.346,37	3,62
TOTAL Acciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar (salvo warrants y bonos de sus.)						5.839.346,37	3,62
TOTAL SUIZA						131.961,19	0,08
CH0038863350 NESTLE NOM.			CHF	1.300		131.961,19	0,08
TOTAL ALEMANIA						1.765.308,00	1,09
DE0006095003 ENCAVIS			EUR	25.000		418.500,00	0,26
DE0007164600 SAP			EUR	5.300		703.628,00	0,43
DE0007236101 SIEMENS			EUR	2.800		302.064,00	0,19
DE0008303504 TAG IMMOBILIEN			EUR	3.000		77.220,00	0,05
DE000A2E4K43 DELIVERY HERO			EUR	800		78.496,00	0,05
DE000ENER6Y0 SIEMENS ENERGY AG			EUR	1.400		32.200,00	0,02
DE000SHL1006 SIEMENS HEALTHINEERS			EUR	4.000		153.200,00	0,09
TOTAL ESPAÑA						588.850,43	0,36
ES0105200002 ABENGOA CL.B			EUR	487.051		2.337,84	0,00
ES0109067019 AMADEUS IT GROUP CL.A			EUR	3.501		166.612,59	0,10
ES0165386014 SOLARIA ENERGIA MEDIOAMBIENTE			EUR	26.000		419.900,00	0,26
TOTAL FRANCIA						2.079.284,68	1,30
FR0000073272 SAFRAN PROV.ECHANGE			EUR	1.501		126.744,44	0,08
FR0000120172 CARREFOUR			EUR	12.000		163.980,00	0,10
FR0000120321 L'OREAL			EUR	1.100		305.360,00	0,19
FR0000120578 SANOFI			EUR	5.500		469.315,00	0,29
FR0000121972 SCHNEIDER ELECTRIC			EUR	1.000		106.050,00	0,07
FR0000124141 VEOLIA ENVIRONNEMENT			EUR	23.000		423.660,00	0,26
FR0010220475 ALSTOM REGROUPT			EUR	11.387		484.175,24	0,31
TOTAL ITALIA						496.960,00	0,31
IT0001157020 ERG			EUR	8.000		171.680,00	0,11

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% Patrimonio neto
IT0005366767 NEXI S.P.A.			EUR	19.000		325.280,00	0,20
TOTAL LUXEMBURGO						82.480,00	0,05
LU0775917882 GRAND CITY PROPERTIES			EUR	4.000		82.480,00	0,05
TOTAL PAÍSES BAJOS						694.502,07	0,43
NL0000235190 AIRBUS			EUR	2.001		124.202,07	0,08
NL0010273215 ASML HOLDING			EUR	250		78.675,00	0,05
NL0012044747 SHOP APOTHEKE EUROPE NV			EUR	500		74.600,00	0,05
NL0012817175 ALFEN N.V.			EUR	3.300		179.190,00	0,11
NL0012866412 BE SEMICONDUCTOR			EUR	6.500		237.835,00	0,14
TOTAL Bonos y valores similares						128.438.113,71	79,52
TOTAL Bonos y valores similares negociados en un mercado regulado o similar						128.438.113,71	79,52
TOTAL Bonos de tipo de fijo negociados en un mercado regulado o similar						0,00	0,00
TOTAL ESPAÑA						0,00	0,00
XS1960252606 ABENGOA ABEN 2 0%17-311249	29/03/2017	31/12/2049	EUR	161.321		0,00	0,00
TOTAL Bonos convertibles negociados en un mercado regulado o similar						128.171.605,71	79,35
TOTAL BÉLGICA						554.165,11	0,34
BE6317643334 AKKA TECH.TV19-PERP.CONV.	27/11/2019	31/12/2050	EUR	10		554.165,11	0,34
TOTAL ALEMANIA						36.715.433,96	22,73
DE000A254Y84 DELIVERY 0,25%20-230124 CONV.	23/01/2020	23/01/2024	EUR	20	0,25	2.370.605,43	1,47
DE000A254Y92 DELIVERY 1%19-230127 CV REGS	23/01/2020	23/01/2027	EUR	20	1,00	2.435.021,74	1,51
DE000A289DA3 HELLOFRESH 0,75%20-130525 CONV	13/05/2020	13/05/2025	EUR	11	0,75	1.385.663,42	0,86
DE000A289T23 LEG IMMOBILIEN AG 0,4% 300628	24/06/2020	30/06/2028	EUR	20	0,40	2.117.377,78	1,31
DE000A2BPB84 DEUTSCHE WOHN 0,325%17-24 CONV	27/02/2017	26/07/2024	EUR	48	0,325	5.290.106,30	3,28
DE000A2GS377 DEUTSCHE 0,6%17-050126 CONV.	04/10/2017	05/01/2026	EUR	49	0,60	5.378.448,85	3,33
DE000A2GSDH2 LEG IMMOB.0,875%17-010925 CV	01/09/2017	01/09/2025	EUR	40	0,875	4.944.197,24	3,06
DE000A2LQRW5 ADIDAS 0,05%18-120923 CONV.	12/09/2018	12/09/2023	EUR	16	0,05	3.886.180,82	2,41
DE000A2YPE76 MTU 0,05%19-180327 CONV.	18/09/2019	18/03/2027	EUR	15	0,05	1.362.106,85	0,84
DE000A3E4589 ZALANDO 0,05%20-060825 CV.TR.A	06/08/2020	06/08/2025	EUR	4	0,05	463.859,23	0,29
DE000A3E4597 ZALANDO 0,625%20-0827 CONV.T.B	06/08/2020	06/08/2027	EUR	4	0,625	464.530,41	0,29
DE000SYM7787 SYMRISE 0,2375%17-200624 CV	20/06/2017	20/06/2024	EUR	49	0,2375	6.617.335,89	4,08

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% Patrimonio neto
TOTAL ESPAÑA						15.026.721,56	9,30
XS1750026186 CELLNEX TELECOM 1,5%16-26 CV	16/01/2018	16/01/2026	EUR	48	1,50	8.457.867,54	5,23
XS2021212332 CELLNEX TELECOM 0,5%19-0728 CV	05/07/2019	05/07/2028	EUR	36	0,50	4.822.170,41	2,99
XS2154448059 AMADEUS IT GRP 1,5%20-0425 CV	09/04/2020	09/04/2025	EUR	14	1,50	1.746.683,61	1,08
TOTAL FRANCIA						52.859.501,19	32,72
FR0012817542 INGENICO 0%15-260622 OCEANE	26/06/2015	26/06/2022	EUR	17.000		3.085.160,00	1,91
FR0013170925 NEXITY 0,125%16-010123 OCEANE	13/05/2016	01/01/2023	EUR	15.000	0,125	865.350,00	0,54
FR0013200995 COINTREAU 0,125%16-26 OCEANE	07/09/2016	07/09/2026	EUR	11.533	0,125	1.872.267,22	1,16
FR0013266087 KORIAN TV17-PERP ODIRNANE	03/07/2017	31/12/2050	EUR	32.500		1.304.290,00	0,81
FR0013284130 ARCHER OBL.0%17-310323 OCC	22/09/2017	31/03/2023	EUR	27		3.791.070,00	2,35
FR0013321429 NEXITY 0,25%18-020325 ORNANE	02/03/2018	02/03/2025	EUR	28.826	0,25	1.561.216,16	0,97
FR0013345949 SOITEC 0%18 280623 OCEANE	28/06/2018	28/06/2023	EUR	14.365		1.916.434,65	1,19
FR0013418795 ORPEA 0,375%19-170527 CV	17/05/2019	17/05/2027	EUR	22.682	0,375	3.156.427,12	1,95
FR0013439304 WORLDLINE 0%19-300726 OCEANE	30/07/2019	30/07/2026	EUR	32.515		3.713.213,00	2,30
FR0013448412 UBISOFT 0%19-240924 OCEANE	19/09/2019	24/09/2024	EUR	13.000		1.602.770,00	0,99
FR0013450483 KERING 0%19-300922 OCEANE	30/09/2019	30/09/2022	EUR	15		1.606.650,00	0,99
FR0013451820 NEOEN 1,875%19-071024 OCEANE	07/10/2019	07/10/2024	EUR	28.000	1,875	1.372.000,00	0,85
FR0013457942 ATOS 0%19-061124 EXCH.	06/11/2019	06/11/2024	EUR	70		8.858.500,00	5,47
FR0013489739 KORIAN 0,875%20-060327 OCEANE	06/03/2020	06/03/2027	EUR	50.000	0,875	2.587.500,00	1,60
FR0013513041 SAFRAN 0,875%20-150527 OCEAN	15/05/2020	15/05/2027	EUR	20.000	0,875	2.410.000,00	1,49
FR0013515707 CB NEOEN 2% 02062025	02/06/2020	02/06/2025	EUR	71.000	2,00	4.007.950,00	2,48
FR0013520681 SELENA 0%20-250625 EXCH.REGS	25/06/2020	25/06/2025	EUR	24		2.578.320,00	1,60
FR0013534518 ELECTRICITE DE FRANCE 192425	14/09/2020	14/09/2024	EUR	536.796		6.570.383,04	4,07
TOTAL ITALIA						7.376.141,80	4,57
XS1583310807 SNAM 0%17-200322 CV	20/03/2017	20/03/2022	EUR	15		1.574.850,00	0,98
XS2161819722 NEXI 1,75%20-240427 CV	24/04/2020	24/04/2027	EUR	48	1,75	5.801.291,80	3,59
TOTAL LUXEMBURGO						2.044.414,36	1,27
XS1373990834 GRAND CITY TV16-020322 CONV.SR	02/03/2016	02/03/2022	EUR	20	0,25	2.044.414,36	1,27
TOTAL PAÍSES BAJOS						13.595.227,73	8,42
DE000A19Y072 SHOP APOT.EUR.4,5%18-190423 CV	19/04/2018	19/04/2023	EUR	2	4,50	644.577,97	0,40

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% Patrimonio neto
XS1046477581 QIAGEN 0,875%14-190321 CONV.	13/03/2014	19/03/2021	USD	2	0,875	622.189,77	0,39
XS1321004118 IBERDROLA 0%15-111122 IDX CV	16/11/2015	11/11/2022	EUR	50		6.367.000,00	3,94
XS1940192039 JUST EAT 2,25%19-250124CV	25/01/2019	25/01/2024	EUR	33	2,25	4.950.329,99	3,06
XS2166095146 JUST EAT 1,25%CV26	30/04/2020	30/04/2026	EUR	9	1,25	1.011.130,00	0,63
TOTAL Títulos de participación						266.508,00	0,17
TOTAL FRANCIA						266.508,00	0,17
FR0000140014 RENAULT TPA 83-84	03/10/1983	31/12/2050	EUR	792		266.508,00	0,17
TOTAL Títulos de OIC						14.299.547,89	8,85
TOTAL OICVM y equivalentes de otros Estados miembros de la UE						14.299.547,89	8,85
TOTAL FRANCIA						14.299.547,89	8,85
FR0000009987 UNION + (IC)			EUR	36,99		7.017.358,10	4,35
FR0007033477 CM-CIC INSTIT.SH.TERM RC FCP3D			EUR	1.110,067		2.410.554,89	1,49
FR0013373206 CM-CIC SHORT TERM BONDS (IC)			EUR	24,045		2.411.272,51	1,49
FR0013507605 CM-CIC OBLI SPREAD 2023 (S)			EUR	23.764,729		2.460.362,39	1,52

REGLAMENTO SFTR

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